

【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29年 3月24日

【発行者名】 J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 大越 昇一

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内二丁目7番3号 東京ビルディング

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

【電話番号】 03 - 6736 - 2000

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 J P Mグローバルマイスター

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】 2兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## ・【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、平成28年9月26日付で提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また記載事項の一部訂正を行うため、訂正届出書を提出いたします。

## ・【訂正の内容】

### 第二部【ファンド情報】

#### 第1【ファンドの状況】

##### 1【ファンドの性格】

###### （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28年8月末現在）

（略）

大株主の状況（平成28年8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29年1月末現在）

（略）

大株主の状況（平成29年1月末現在）

（以下略）

##### 2【投資方針】

###### （3）運用体制

<訂正前>

###### （イ）当ファンドの運用体制

～（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、平成28年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（略）

###### （八）投資先ファンドの運用体制

以下は、投資先ファンドにおける運用体制です。

グローバル株式ファンド

～（略）

（注1）（略）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、平成28年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### マネープール・ファンド

以下は、当該投資先ファンドの主要投資先であるマネープール・マザーファンドにおける運用体制です。

（略）

委託会社の債券運用部（3名）に所属するマネープール・マザーファンドのポートフォリオ・マネジャーは、運用計画を策定し、運用計画に基づき、投資判断を行いポートフォリオを構築し、投資判断に基づく債券の売買を執行します。

、（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、平成28年9月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（以下略）

<訂正後>

（イ）当ファンドの運用体制

～（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、平成28年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（略）

（ハ）投資先ファンドの運用体制

以下は、投資先ファンドにおける運用体制です。

グローバル株式ファンド

～（略）

（注1）（略）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、平成28年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### マネープール・ファンド

以下は、当該投資先ファンドの主要投資先であるマネープール・マザーファンドにおける運用体制です。

（略）

委託会社の債券運用部（2名）に所属するマネープール・マザーファンドのポートフォリオ・マネジャーは、運用計画を策定し、運用計画に基づき、投資判断を行いポートフォリオを構築し、投資判断に基づく債券の売買を執行します。

、（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、平成28年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（以下略）

### 3【投資リスク】

（1）リスク要因

<訂正前>

（略）

投資先ファンドのリスク

グローバル株式ファンド

（略）

マネープール・ファンド

（略）

信用リスク

（略）

\* 「格付機関」とは、債券の発行体の財政状況等を総合的に分析判断し格付を付与する企業をいい、スタンダード&プアーズ・レーティングズ・サービス、ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク等の格付機関が格付を付与します。「格付」とは、債券の元本・利息の支払いの確実性の度合いを一定の指標で表したものをいいます。

（略）

<訂正後>

（略）

投資先ファンドのリスク

グローバル株式ファンド

（略）

マネープール・ファンド

（略）

信用リスク

（略）

\* 「格付機関」とは、債券の発行体の財政状況等を総合的に分析判断し格付を付与する企業をいい、S & Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク等の格付機関が格付を付与します。「格付」とは、債券の元本・利息の支払いの確実性の度合いを一定の指標で表したものをいいます。

（略）

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

<更新・訂正後>

## 参考情報

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

## ＜ファンドの基準価額・年間騰落率の推移＞

2012年1月～2016年12月の5年間に於ける、ファンドの基準価額(日次)と、年間騰落率(毎月末時点)の推移を示したものです。



## ＜ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較＞

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



(ご注意)

- 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2015年5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エマーキング・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・・・シティ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-エマーキング・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エマーキング・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、東証に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

MSCIコクサイ指数およびMSCIエマーキング・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エマーキング・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エマーキング・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。

シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている債券インデックスであり、著作権はCitigroup Index LLCに帰属しています。

JPモルガンGBI-エマーキング・マーケット・グローバルは、J.P.モルガン・セキュリティー・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・エルエルシーに帰属しています。

## ( 2 ) 投資リスクに関する管理体制

&lt; 訂正前 &gt;

( 略 )

## ( ロ ) 投資先ファンドにおけるリスク管理

グローバル株式ファンド

( 略 )

(平成28年 6月末現在)

( 略 )

マネープール・ファンド

( 略 )

(平成28年 6月末現在)

( 略 )

< 当ファンドまたはマネープール・マザーファンドにおいて行われることがある、投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引が、投資者の利益を害しないことを確保するための措置の詳細 >

( 略 )

| 投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引の内容  | 投資者の利益を害しないことを確保するための措置   |
|---|---|
| ( 略 )   | ( 略 )   |
| ( 略 )   | ( 略 )   |
| 当ファンドおよびマネープール・マザーファンドにおける有価証券取引等の、委託会社の関係会社である証券会社等に対する発注  | 社内規程に基づき、各証券会社等の調査能力、売買執行能力等を考慮して、発注先として選定する証券会社等を定期的に見直します。株式会社については、前記で選定した証券会社への予定発注量も定期的に見直したうえで、リスク管理部門とインベストメント・ダイレクターが各証券会社への実際の発注量を定期的にモニタリングし、関係会社である証券会社に対し合理的な理由なく多量に発注されていないことを確認しています。株式以外については、関係会社であるかどうかに関わりなく、最良の取引条件となる証券会社等に発注しているかをコンプライアンス部門が確認しています。なお、当ファンドおよびマネープール・マザーファンドが関係会社である証券会社に対し支払った売買委託手数料の額（手数料相当額が取引の価格に織り込まれているものを除きます。）は、当ファンドの運用報告書で開示されます。 |
| 当ファンドおよびマネープール・マザーファンドにおいて保有もしくは取引する有価証券または当ファンドの受益権の、委託会社またはその関係会社の役員による売買等の取引   | 委託会社の役員による有価証券の売買等の取引は、社内規程に基づき原則としてコンプライアンス部門の事前承認を得ることが義務付けられており、利益相反をうかがわせる事実がないことが確認できた場合のみ承認がなされます。また、取引後にコンプライアンス部門が取引内容を精査し、役職員の取引の時期・銘柄が、当ファンドおよびマネープール・マザーファンドにおいて取引されたものと重なる等の利益相反が生じていないことを確認します。  |
| 当ファンドおよびマネープール・マザーファンドにおける有価証券取引等の発注と、委託会社が運用する他の運用資産における有価証券取引等の発注を、束ねて一括して発注すること（一括発注）  | 一括発注は、社内規程に定める条件の下に行われ、その約定結果は社内規程に基づき、発注のあった運用資産間で公平に配分します。コンプライアンス部門は、配分結果が社内規程にしたがって公平になされたかどうかをモニタリングします。   |
| 当ファンドおよびマネープール・マザーファンドの運用担当者（ポートフォリオ・マネジャー、アナリスト等）が贈答、茶菓の接待等を受けた、証券会社等に対する当ファンドおよびマネープール・マザーファンドにおける有価証券等の発注、または有価証券の発行体の発行する有価証券の当ファンドおよびマネープール・マザーファンドでの組入れ | 委託会社の役員が贈答、茶菓の接待等を受けた際は、原則として社内規程に基づきその内容をコンプライアンス部門に報告する義務があります。コンプライアンス部門は、当該報告に基づき、贈答、茶菓の接待等を受けたことが、特定の証券会社等への取引の発注や特定の銘柄の有価証券の組入れにつながっていないことをモニタリングします。   |

|  |  |
|--|--|
| 委託会社またはその関係会社と取引関係のある有価証券の発行体が発行する有価証券にかかる議決権の当ファンドおよびマネープール・マザーファンドにおける行使 | 当ファンドおよびマネープール・マザーファンドで保有する有価証券にかかる議決権の行使は、社内規程に基づいて、当ファンドの受益者の経済的利益に最も資するという原則の下に行われます。インベストメント・ダイレクターは、議決権行使の前にその内容が社内規程に沿っているか確認します。                      |
| 当ファンドおよびマネープール・マザーファンドと、委託会社が運用する他の運用資産間において行う有価証券等の取引（クロス取引）              | 有価証券届出書提出日現在、社内規程によりクロス取引は原則として禁止されています。今後、クロス取引を行う場合には、社内規程を変更して投資者の利益を損ねることのない一定の条件を定め、当該条件を満たすクロス取引のみを行うこととし、当該条件の逸脱がないことをコンプライアンス部門がモニタリングする体制を構築する予定です。 |
| 委託会社による当ファンドの受益権の取得申込みおよび換金  | 委託会社による当ファンドの受益権の取得申込みおよび換金は、社内規程に則り、取得申込みの目的および金額、受益権の保有期間、換金時期等について一定の制限を設けて、一般的な投資者の利益を害しないように行います。また、財務部門が、社内規程にしたがった取得申込み等が行われていることをモニタリングします。          |

## &lt; 訂正後 &gt;

(略)

## (ロ) 投資先ファンドにおけるリスク管理

グローバル株式ファンド

(略)

(平成28年12月末現在)

(略)

マネープール・ファンド

(略)

(平成28年12月末現在)

(略)

< 当ファンドまたはマネープール・マザーファンドにおいて行われることがある、投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引が、投資者の利益を害しないことを確保するための措置の詳細 >

(略)

| 投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引の内容  | 投資者の利益を害しないことを確保するための措置  |
|---|--|
| (略)   | (略)  |
| (略)   | (略)  |
| 当ファンドおよびマネープール・マザーファンドにおける有価証券取引等の、委託会社の関係会社である証券会社等に対する発注                      | 社内規程等に基づき、各証券会社等の調査能力、売買執行能力等を考慮して、発注先として選定する証券会社等を定期的に見直します。株式会社については、前記で選定した証券会社への予定発注量も定期的に見直したうえで、リスク管理部門とインベストメント・ダイレクターが各証券会社への実際の発注量を定期的にモニタリングし、関係会社である証券会社に対し合理的な理由なく多量に発注されていないことを確認しています。株式以外については、関係会社であるかどうかに関わりなく、最良の取引条件となる証券会社等に発注しているかをコンプライアンス部門が確認しています。なお、当ファンドおよびマネープール・マザーファンドが関係会社である証券会社に対し支払った売買委託手数料の額（手数料相当額が取引の価格に織り込まれているものを除きます。）は、当ファンドの運用報告書で開示されます。 |
| 当ファンドおよびマネープール・マザーファンドにおいて保有もしくは取引する有価証券または当ファンドの受益権の、委託会社またはその関係会社の役員による売買等の取引 | 委託会社の役員による有価証券の売買等の取引は、社内規程等に基づき原則としてコンプライアンス部門の事前承認を得ることが義務付けられており、利益相反をうかがわせる事実がないことが確認できた場合のみ承認がなされます。また、取引後にコンプライアンス部門が取引内容を精査し、役職員の取引の時期・銘柄が、当ファンドおよびマネープール・マザーファンドにおいて取引されたものと重なる等の利益相反が生じていないことを確認します。  |

|   |  |
|---|--|
| 当ファンドおよびマネープール・マザーファンドにおける有価証券取引等の発注と、委託会社が運用する他の運用資産における有価証券取引等の発注を、束ねて一括して発注すること(一括発注)  | 一括発注は、社内規程等に定める条件の下に行われ、その約定結果は社内規程等に基づき、発注のあった運用資産間で公平に配分します。コンプライアンス部門は、配分結果が社内規程等にしがたって公平になされたかどうかをモニタリングします。   |
| 当ファンドおよびマネープール・マザーファンドの運用担当者(ポートフォリオ・マネジャー、アナリスト等)が贈答、茶菓の接待等を受けた、証券会社等に対する当ファンドおよびマネープール・マザーファンドにおける有価証券等の発注、または有価証券の発行体の発行する有価証券の当ファンドおよびマネープール・マザーファンドでの組入れ | 委託会社の役職員が贈答、茶菓の接待等を受けた際は、原則として社内規程等に基づきその内容をコンプライアンス部門に報告する義務があります。コンプライアンス部門は、当該報告に基づき、贈答、茶菓の接待等を受けたことが、特定の証券会社等への取引の発注や特定の銘柄の有価証券の組入れにつながっていないことをモニタリングします。  |
| 委託会社またはその関係会社と取引関係のある有価証券の発行体が発行する有価証券にかかる議決権の当ファンドおよびマネープール・マザーファンドにおける行使  | 当ファンドおよびマネープール・マザーファンドで保有する有価証券にかかる議決権の行使は、社内規程等に基づいて、当ファンドの受益者の経済的利益に最も資するという原則の下に行われます。インベストメント・ダイレクターは、議決権行使の前にその内容が社内規程等に沿っているか確認します。                      |
| 当ファンドおよびマネープール・マザーファンドと、委託会社が運用する他の運用資産間において行う有価証券等の取引(クロス取引)   | 有価証券届出書提出日現在、社内規程等によりクロス取引は原則として禁止されています。今後、クロス取引を行う場合には、社内規程等を変更して投資者の利益を損ねることのない一定の条件を定め、当該条件を満たすクロス取引のみを行うこととし、当該条件の逸脱がないことをコンプライアンス部門がモニタリングする体制を構築する予定です。 |
| 委託会社による当ファンドの受益権の取得申込みおよび換金   | 委託会社による当ファンドの受益権の取得申込みおよび換金は、社内規程等に則り、取得申込みの目的および金額、受益権の保有期間、換金時期等について一定の制限を設けて、一般的な投資者の利益を害しないように行います。また、財務部門が、社内規程等にしがたって取得申込み等が行われていることをモニタリングします。          |



## 4【手数料等及び税金】

## (5) 課税上の取扱い

&lt;訂正前&gt;

(略)

なお、税法が改正された場合には、以下の内容が変更になることがあります。以下の税制は平成28年7月末現在適用されるものです。

(以下略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

なお、税法が改正された場合には、以下の内容が変更になることがあります。以下の税制は平成29年1月末現在適用されるものです。

(以下略)

## 5【運用状況】

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

&lt;更新・訂正後&gt;

## (1) 投資状況

(平成29年1月4日現在)

| 資産の種類               | 国/地域    | 時価合計(円)       | 投資比率(%) |
|---------------------|---------|---------------|---------|
| 投資信託受益証券            | 日本      | 1,007,296     | 0.03    |
| 投資証券                | ルクセンブルク | 3,216,563,738 | 100.50  |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | -       | 16,883,031    | 0.53    |
| 合計(純資産総額)           |         | 3,200,688,003 | 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。

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

(平成29年1月4日現在)

| 順位 | 国/地域    | 種類           | 銘柄名                               | 口数          | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|---------|--------------|-----------------------------------|-------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1  | ルクセンブルク | 投資証券         | JPM GL UNCONSTRAINED EQ I JPY     | 254,817.693 | 9,661.58          | 2,461,941,526     | 12,623           | 3,216,563,738    | 100.50          |
| 2  | 日本      | 投資信託<br>受益証券 | G I Mジャパン・マネーブール・ファンドF(適格機関投資家専用) | 999,401     | 1.0189            | 1,018,289         | 1.0079           | 1,007,296        | 0.03            |

## 種類別投資比率

（平成29年1月4日現在）

| 種類       | 投資比率（％） |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 0.03    |
| 投資証券     | 100.50  |

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## （3）運用実績

純資産の推移

平成29年1月4日および同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

| 期  | 年月日          | 純資産総額<br>（百万円）<br>（分配落） | 純資産総額<br>（百万円）<br>（分配付） | 1口当たり<br>純資産額<br>（円）<br>（分配落） | 1口当たり<br>純資産額<br>（円）<br>（分配付） |
|----|--------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| 1期 | (平成27年6月26日) | 3,513                   | 3,513                   | 1.3100                        | 1.3100                        |
| 2期 | (平成28年6月27日) | 3,086                   | 3,086                   | 0.9311                        | 0.9311                        |
|    | 平成28年1月末日    | 3,466                   | -                       | 1.0515                        | -                             |
|    | 平成28年2月末日    | 3,338                   | -                       | 1.0134                        | -                             |
|    | 平成28年3月末日    | 3,424                   | -                       | 1.0470                        | -                             |
|    | 平成28年4月末日    | 3,477                   | -                       | 1.0709                        | -                             |
|    | 平成28年5月末日    | 3,405                   | -                       | 1.0472                        | -                             |
|    | 平成28年6月末日    | 3,059                   | -                       | 0.9227                        | -                             |
|    | 平成28年7月末日    | 3,307                   | -                       | 1.0113                        | -                             |
|    | 平成28年8月末日    | 3,248                   | -                       | 1.0061                        | -                             |
|    | 平成28年9月末日    | 3,101                   | -                       | 0.9913                        | -                             |
|    | 平成28年10月末日   | 3,153                   | -                       | 1.0182                        | -                             |
|    | 平成28年11月末日   | 3,372                   | -                       | 1.1224                        | -                             |
|    | 平成28年12月末日   | 3,152                   | -                       | 1.1852                        | -                             |
|    | 平成29年1月4日    | 3,200                   | -                       | 1.2105                        | -                             |

分配の推移

| 期       | 1口当たり分配金（円） |
|---------|-------------|
| 1期      | 0.0000      |
| 2期      | 0.0000      |
| 3期（中間期） | 0.0000      |

## 収益率の推移

| 期       | 収益率（％） |
|---------|--------|
| 1期      | 31.00  |
| 2期      | 28.92  |
| 3期（中間期） | 28.12  |

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

## （4）設定及び解約の実績

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

| 期       | 設定口数（口）       | 解約口数（口）       | 残存口数（口）       |
|---------|---------------|---------------|---------------|
| 1期      | 7,518,432,881 | 4,836,420,521 | 2,682,012,360 |
| 2期      | 1,322,840,888 | 690,221,424   | 3,314,631,824 |
| 3期（中間期） | 55,566,737    | 695,009,866   | 2,675,188,695 |

（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。

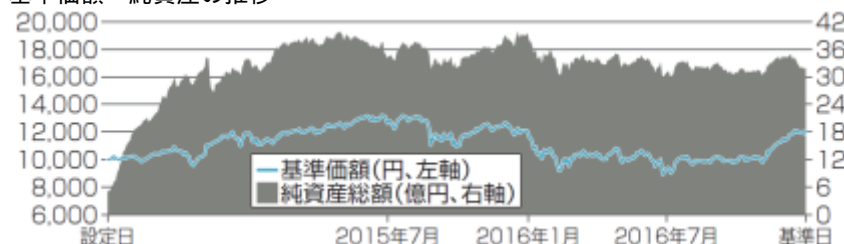
（注2）設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

## &lt;参考情報&gt;

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

| 基準日   | 2017年1月4日 | 設定日  | 2014年6月30日 |
|-------|-----------|------|------------|
| 純資産総額 | 32億円      | 決算回数 | 年1回        |

## 基準価額・純資産の推移



## 分配の推移

| 期  | 年月      | 円 |
|----|---------|---|
| 1期 | 2015年6月 | 0 |
| 2期 | 2016年6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。

## ポートフォリオの構成状況

| 資産の種類                                    | 投資比率 1 |
|--|--------|
| J Pモルガン・ファンズ・グローバル・アンコンストレインド・エクイティ・ファンド | 100.5% |
| G I Mジャパン・マネーブル・ファンドF（適格機関投資家専用）         | 0.0%   |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後）                      | -0.5%  |
| 合計（純資産総額）                                | 100.0% |

## 国別構成状況

| 投資国 2 | 投資比率 3 |
|-------|--------|
| アメリカ  | 47.5%  |
| イギリス  | 9.7%   |
| 中国    | 8.6%   |
| スイス   | 6.5%   |
| フランス  | 5.5%   |
| その他   | 22.6%  |

## 通貨別構成状況

| 通貨      | 投資比率 3 |
|---------|--------|
| 米ドル     | 66.8%  |
| ユーロ     | 11.7%  |
| イギリスポンド | 8.2%   |
| スイスフラン  | 4.6%   |
| 香港ドル    | 3.9%   |
| その他     | 5.2%   |

## 業種別構成状況

| 業種         | 投資比率 3 |
|------------|--------|
| 一般消費財・サービス | 20.5%  |
| 金融         | 19.6%  |
| ヘルスケア      | 15.7%  |
| 情報技術       | 10.3%  |
| 電気通信サービス   | 6.5%   |
| その他        | 22.3%  |

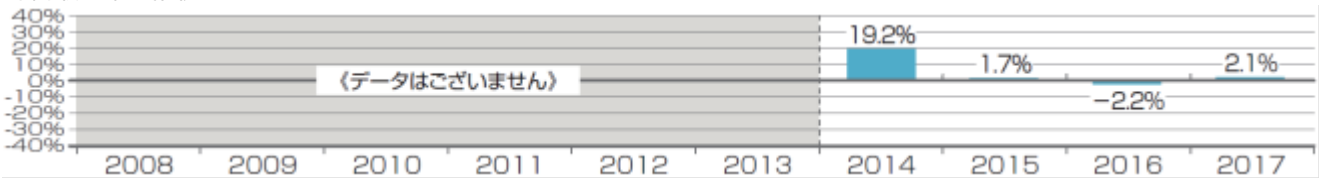
\*上記比率に投資先ファンドが保有する公社債および投資信託証券は含んでいません。

## 組入上位銘柄

| 順位 | 銘柄名                          | 投資国*2 | 通貨     | 業種         | 投資比率*3 |
|----|------------------------------|-------|--------|------------|--------|
| 1  | JPM USD リクイディティ・ファンド (Xクラス)* | アメリカ  | 米ドル    | -          | 5.4%   |
| 2  | アルファベット                      | アメリカ  | 米ドル    | 情報技術       | 4.5%   |
| 3  | テバ・ファーマシューティカル・インダストリーズ      | イスラエル | 米ドル    | ヘルスケア      | 3.4%   |
| 4  | アマゾン・ドット・コム                  | アメリカ  | 米ドル    | 一般消費財・サービス | 3.2%   |
| 5  | シティグループ                      | アメリカ  | 米ドル    | 金融         | 3.0%   |
| 6  | 21世紀フォックス                    | アメリカ  | 米ドル    | 一般消費財・サービス | 3.0%   |
| 7  | タイム                          | アメリカ  | 米ドル    | 一般消費財・サービス | 2.6%   |
| 8  | クローガー                        | アメリカ  | 米ドル    | 生活必需品      | 2.6%   |
| 9  | ノバルティス                       | スイス   | スイスフラン | ヘルスケア      | 2.3%   |
| 10 | シャイアー                        | アメリカ  | 米ドル    | ヘルスケア      | 2.2%   |

\*グローバル・アンコンストレインド・エクイティ・ファンドでは現金の代替として投資を行っています。当銘柄は米ドル建ての流動性の高い短期金融商品に投資しています。

## 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

\* 2014年の年間収益率は設定日から年末営業日、2017年の年間収益率は前年末営業日から2017年1月4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グローバルマイスターです。

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。

- 各比率はファンドの純資産総額に対する比率を記載しています。
- 国はMSCI分類、業種はMSCI11分類に基づき分類していますが、J.P.モルガン・アセット・マネジメントの判断に基づき分類したものが一部含まれます。J.P.モルガン・アセット・マネジメントとは、JPMモルガン・チェース・アンド・カンパニーおよび世界の関連会社の資産運用ビジネスのブランドです。
- ファンドは各投資先ファンドを通じて投資を行うため、各投資先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。なお、運用実績の基準日のファンドの基準価額算出に使用されているデータ（JPMモルガン・ファンズ・グローバル・アイコンストレインド・エクイティ・ファンドおよびGIMジャパン・マネーパール・ファンド（適格機関投資家専用）は2016年12月最終営業日のもの）を使用しています。

### 第3【ファンドの経理状況】

#### < 訂正前 >

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. 当ファンドの第1期計算期間は信託約款第30条により、平成26年6月30日から平成27年6月26日までとしております。
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2期計算期間（平成27年6月27日から平成28年6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。

#### < 訂正後 >

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
また、当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3および第57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、財務諸表および中間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. 当ファンドの第1期計算期間は信託約款第30条により、平成26年6月30日から平成27年6月26日までとしております。
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2期計算期間（平成27年6月27日から平成28年6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。  
また、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、当中間計算期間（平成28年6月28日から平成28年12月27日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

原届出書「第二部ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」について、以下の中間財務諸表に関する事項が追加されます。

#### < 追加 >

## 中間財務諸表

## 【JPMグローバルマイスター】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 前計算期間末<br>(平成28年6月27日現在) | 当中間計算期間末<br>(平成28年12月27日現在) |
|-----------------|--------------------------|-----------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                          |                             |
| 流動資産            |                          |                             |
| コール・ローン         | 76,920,758               | 138,889,417                 |
| 投資信託受益証券        | 1,018,289                | 1,006,596                   |
| 投資証券            | 3,052,759,202            | 3,169,422,465               |
| 未収入金            | -                        | 32,100,000                  |
| 流動資産合計          | 3,130,698,249            | 3,341,418,478               |
| 資産合計            | 3,130,698,249            | 3,341,418,478               |
| <b>負債の部</b>     |                          |                             |
| 流動負債            |                          |                             |
| 未払金             | 25,000,000               | -                           |
| 未払解約金           | 19,013                   | 131,838,872                 |
| 未払受託者報酬         | 551,517                  | 522,348                     |
| 未払委託者報酬         | 18,383,905               | 17,411,483                  |
| 未払利息            | 198                      | 357                         |
| その他未払費用         | 367,622                  | 348,169                     |
| 流動負債合計          | 44,322,255               | 150,121,229                 |
| 負債合計            | 44,322,255               | 150,121,229                 |
| <b>純資産の部</b>    |                          |                             |
| 元本等             |                          |                             |
| 元本              | 1 3,314,631,824          | 1 2,675,188,695             |
| 剰余金             |                          |                             |
| 中間剰余金又は中間欠損金( ) | 2 228,255,830            | 2 516,108,554               |
| (分配準備積立金)       | 323,117,991              | 256,147,266                 |
| 元本等合計           | 3,086,375,994            | 3,191,297,249               |
| 純資産合計           | 3,086,375,994            | 3,191,297,249               |
| 負債純資産合計         | 3,130,698,249            | 3,341,418,478               |

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

|   | 前中間計算期間 |                            | 当中間計算期間 |                            |
|---|---------|----------------------------|---------|----------------------------|
|   | （自<br>至 | 平成27年6月27日<br>平成27年12月26日） | （自<br>至 | 平成28年6月28日<br>平成28年12月27日） |
| 営業収益                                      |         |                            |         |                            |
| 受取利息                                      |         | 4,990                      |         | -                          |
| 有価証券売買等損益                                 |         | 261,324,582                |         | 831,751,570                |
| その他収益                                     |         | 184                        |         | -                          |
| 営業収益合計                                    |         | 261,319,408                |         | 831,751,570                |
| 営業費用                                      |         |                            |         |                            |
| 支払利息                                      |         | -                          |         | 12,593                     |
| 受託者報酬                                     |         | 575,326                    |         | 522,348                    |
| 委託者報酬                                     |         | 19,177,285                 |         | 17,411,483                 |
| その他費用                                     |         | 462,336                    |         | 361,184                    |
| 営業費用合計                                    |         | 20,214,947                 |         | 18,307,608                 |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             |         | 281,534,355                |         | 813,443,962                |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             |         | 281,534,355                |         | 813,443,962                |
| 中間純利益又は中間純損失（ ）                           |         | 281,534,355                |         | 813,443,962                |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ） |         | 23,083,462                 |         | 117,506,206                |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           |         | 831,331,310                |         | 228,255,830                |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |         | 237,592,046                |         | 48,426,628                 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |         | -                          |         | 47,266,059                 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |         | 237,592,046                |         | 1,160,569                  |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |         | 135,086,887                |         | -                          |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |         | 135,086,887                |         | -                          |
| 分配金                                       |         | -                          |         | -                          |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ）                           |         | 675,385,576                |         | 516,108,554                |

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

|                              | 当中間財務諸表対象期間  |
|------------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準および評価方法          | <p>投資信託受益証券<br/>移動平均法に基づき、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券<br/>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<br/>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。<br/>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<br/>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<br/>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. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>計算期間末日の取扱い<br/>平成28年6月26日が休日のため、信託約款第30条により、前計算期間末日を平成28年6月27日としており、当中間計算期間末日を平成28年12月27日としております。</p>   |

( 中間貸借対照表に関する注記 )

| 区分               | 前計算期間末<br>(平成28年6月27日現在) | 当中間計算期間末<br>(平成28年12月27日現在) |
|------------------|--------------------------|-----------------------------|
| 1 期首元本額          | 2,682,012,360円           | 3,314,631,824円              |
| 期中追加設定元本額        | 1,322,840,888円           | 55,566,737円                 |
| 期中一部解約元本額        | 690,221,424円             | 695,009,866円                |
| 2 元本の欠損          | 228,255,830円             | - 円                         |
| 受益権の総数           | 3,314,631,824口           | 2,675,188,695口              |
| 1 口当たりの純資産額      | 0.9311円                  | 1.1929円                     |
| ( 1 万口当たりの純資産額 ) | (9,311円)                 | (11,929円)                   |

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

|                            | 前計算期間末または当中間計算期間末  |
|----------------------------|--|
| 1. 中間貸借対照表計上額、時価およびその差額    | 中間貸借対照表計上額は前計算期間末または当中間計算期間末の時価で計上しているため、その差額はありません。   |
| 2. 時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>「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。<br>(2)有価証券以外の金融商品<br>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。          |

## （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。

## 2【ファンドの現況】

原届出書「第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況 2ファンドの現況」について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

## 【純資産額計算書】

（平成29年1月4日現在）

| 種類             | 金額            | 単位 |
|----------------|---------------|----|
| 資産総額           | 3,247,314,342 | 円  |
| 負債総額           | 46,626,339    | 円  |
| 純資産総額( - )     | 3,200,688,003 | 円  |
| 発行済口数          | 2,644,182,359 | 口  |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.2105        | 円  |

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

原届出書「第三部委託会社等の情報 第1委託会社等の概況 1委託会社等の概況」について、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

資本金の額（平成29年1月末現在）

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

会社の意思決定機構

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

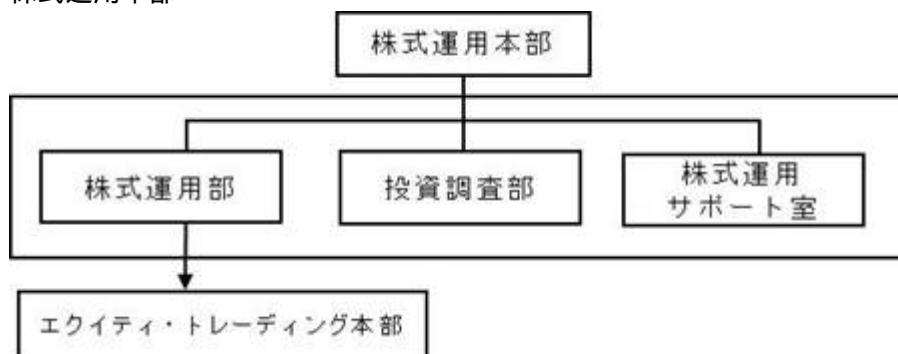
取締役は、株主総会において選任され、任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。増員により、または補欠として選任された取締役の任期は、他の在任取締役の任期の満了する時までとします。

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

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

投資運用の意思決定機構

（イ）株式運用本部



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

## (ロ) 債券運用部

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

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

(注) 前記(イ)、(ロ)および(ハ)の意思決定機構、組織名称等は、平成29年1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】

## &lt; 訂正前 &gt;

(略)

委託会社が設定・運用している投資信託は、平成28年8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 | 72  | 606,823   |
| 公募単位型株式投資信託 | -   | -         |
| 公募追加型債券投資信託 | -   | -         |
| 公募単位型債券投資信託 | -   | -         |
| 私募投資信託      | 63  | 1,998,756 |
| 総合計         | 135 | 2,605,579 |
| 親投資信託       | 58  | -         |

(注) 百万円未満は四捨五入

## &lt; 訂正後 &gt;

(略)

委託会社が設定・運用している投資信託は、平成29年1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  | 639,297   |
| 公募単位型株式投資信託 | -   | -         |
| 公募追加型債券投資信託 | -   | -         |
| 公募単位型債券投資信託 | -   | -         |
| 私募投資信託      | 61  | 2,241,988 |
| 総合計         | 135 | 2,881,285 |
| 親投資信託       | 58  | -         |

(注) 百万円未満は四捨五入

### 3【委託会社等の経理状況】

#### <訂正前>

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

なお、財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、P w Cあらた監査法人により監査を受けております。

なお、あらた監査法人は平成27年7月1日付をもって、名称をP w Cあらた監査法人に変更しております。

#### <訂正後>

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

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

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

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、P w Cあらた監査法人により監査を受けております。

また、第27期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、P w Cあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

なお、P w Cあらた監査法人は平成28年7月1日付をもって、名称をP w Cあらた有限責任監査法人に変更しております。

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

#### <追加>

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

|           |          | 第27期中間会計期間末<br>(平成28年9月30日) |            |       |
|-----------|----------|-----------------------------|------------|-------|
| 資産の部      |          |                             |            |       |
| 区分        | 注記<br>番号 | 内訳                          | 金額         | 構成比   |
|           |          | (千円)                        | (千円)       | (%)   |
| 流動資産      |          |                             |            |       |
| 現金及び預金    |          |                             | 10,094,984 |       |
| 前払費用      |          |                             | 116,250    |       |
| 未収入金      |          |                             | 7,979      |       |
| 未収委託者報酬   |          |                             | 2,145,846  |       |
| 未収収益      |          |                             | 1,539,462  |       |
| 関係会社短期貸付金 |          |                             | 4,395,000  |       |
| 繰延税金資産    |          |                             | 414,740    |       |
| その他       |          |                             | 113,576    |       |
| 流動資産計     |          |                             | 18,827,839 | 93.9  |
| 固定資産      |          |                             |            |       |
| 投資その他の資産  |          |                             | 1,224,764  |       |
| 関係会社株式    |          | 60,000                      |            |       |
| 投資有価証券    |          | 431,529                     |            |       |
| 敷金保証金     |          | 567,845                     |            |       |
| 繰延税金資産    |          | 103,963                     |            |       |
| 前払年金費用    |          | 41,925                      |            |       |
| その他       |          | 19,500                      |            |       |
| 固定資産計     |          |                             | 1,224,764  | 6.1   |
| 資産合計      |          |                             | 20,052,604 | 100.0 |

|         |          | 第27期中間会計期間末<br>(平成28年9月30日) |           |      |
|---------|----------|-----------------------------|-----------|------|
| 負債の部    |          |                             |           |      |
| 区分      | 注記<br>番号 | 内訳                          | 金額        | 構成比  |
|         |          | (千円)                        | (千円)      | (%)  |
| 流動負債    |          |                             |           |      |
| 預り金     |          |                             | 105,652   |      |
| 未払金     |          |                             | 1,790,359 |      |
| 未払手数料   |          | 1,018,265                   |           |      |
| その他未払金  | 1        | 772,093                     |           |      |
| 未払費用    |          |                             | 700,422   |      |
| 未払法人税等  |          |                             | 293,618   |      |
| 賞与引当金   |          |                             | 989,074   |      |
| 流動負債計   |          |                             | 3,879,128 | 19.3 |
| 固定負債    |          |                             |           |      |
| 長期未払金   |          |                             | 257,957   |      |
| 賞与引当金   |          |                             | 595,077   |      |
| 役員賞与引当金 |          |                             | 185,128   |      |
| 固定負債計   |          |                             | 1,038,163 | 5.2  |
| 負債合計    |          |                             | 4,917,292 | 24.5 |

|              |          | 第27期中間会計期間末<br>(平成28年9月30日) |            |       |
|--------------|----------|-----------------------------|------------|-------|
| 純資産の部        |          |                             |            |       |
| 区分           | 注記<br>番号 | 内訳                          | 金額         | 構成比   |
|              |          | (千円)                        | (千円)       | (%)   |
| 株主資本         |          |                             |            |       |
| 資本金          |          |                             | 2,218,000  |       |
| 資本剰余金        |          |                             | 1,000,000  |       |
| 資本準備金        |          | 1,000,000                   |            |       |
| 利益剰余金        |          |                             | 11,941,656 |       |
| 利益準備金        |          | 33,676                      |            |       |
| その他利益剰余金     |          |                             |            |       |
| 繰越利益剰余金      |          | 11,907,979                  |            |       |
| 株主資本計        |          |                             | 15,159,656 | 75.6  |
| 評価・換算差額等     |          |                             |            |       |
| その他有価証券評価差額金 |          |                             | 24,344     |       |
| 評価・換算差額等計    |          |                             | 24,344     | 0.1   |
| 純資産合計        |          |                             | 15,135,312 | 75.5  |
| 負債・純資産合計     |          |                             | 20,052,604 | 100.0 |

## (2) 中間損益計算書

|              |          | 第27期中間会計期間<br>(自平成28年4月1日<br>至平成28年9月30日) |           |       |
|--------------|----------|---|-----------|-------|
| 区分           | 注記<br>番号 | 内訳  | 金額        | 百分比   |
|              |          | (千円)                                      | (千円)      | (%)   |
| 営業収益         |          |   |           |       |
| 委託者報酬        |          |   | 5,230,257 |       |
| 運用受託報酬       |          |   | 2,908,954 |       |
| 業務受託報酬       |          |   | 444,231   |       |
| その他          |          |   | 231,585   |       |
| 営業収益計        |          |   | 8,815,029 | 100.0 |
| 営業費用・一般管理費   |          |   |           |       |
| 営業費用         |          |   | 3,680,576 |       |
| 支払手数料        |          | 2,416,553                                 |           |       |
| 調査費          |          | 943,058                                   |           |       |
| その他営業費用      |          | 320,964                                   |           |       |
| 一般管理費        |          |   | 5,613,404 |       |
| 営業費用・一般管理費計  |          |   | 9,293,980 | 105.4 |
| 営業損失         |          |   | 478,951   | 5.4   |
| 営業外収益        | 1        | 102,225                                   |           |       |
| 営業外収益計       |          |   | 102,225   | 1.2   |
| 営業外費用        | 2        | 27,734                                    |           |       |
| 営業外費用計       |          |   | 27,734    | 0.3   |
| 経常損失         |          |   | 404,460   | 4.5   |
| 税引前中間純損失     |          |   | 404,460   | 4.5   |
| 法人税、住民税及び事業税 |          |   | 260,939   | 3.0   |
| 法人税等調整額      |          |   | 206,290   | 2.3   |
| 中間純損失        |          |   | 459,109   | 5.2   |



## 重要な会計方針

| 項目                                   | 第27期中間会計期間<br>(自平成28年4月1日<br>至平成28年9月30日)  |
|--------------------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準<br>及び評価方法               | <p>(1) 関係会社株式<br/>移動平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券<br/>時価のあるもの<br/>中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。</p>   |
| 2. 引当金の計上基準                          | <p>(1) 賞与引当金<br/>従業員に対する賞与の支給、及び親会社の運営する株式報酬制度に係る将来の費用負担に備えるため、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金<br/>役員に対する賞与の支給、及び親会社の運営する株式報酬制度に係る将来の費用負担に備えるため、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金<br/>従業員に対する退職給付に備えるため、当中間期末における退職給付債務と年金資産の見込額に基づき退職給付引当金を計上しております。ただし、当中間期末においては、年金資産の額が、退職給付債務に未認識数理計算上の差異等を加減した額を超過するため、資産の部に前払年金費用を計上しております。<br/>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間期末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。<br/>過去勤務債務については、その発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（8年）による定額法により、発生した事業年度から費用処理しております。<br/>数理計算上の差異は、その発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（8年）による定額法により按分額を、それぞれ発生した翌事業年度から費用処理することとしております。</p> |
| 3. その他中間財務諸表<br>作成のための基本と<br>なる重要な事項 | <p>消費税等の会計処理<br/>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>  |

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

|                             |   |
|-----------------------------|---|
| 第27期中間会計期間末<br>(平成28年9月30日) |   |
| 1                           | 消費税等の取扱い<br>仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。 |

## （中間損益計算書関係）

|   |  |
|---|--|
| 第27期中間会計期間<br>(自平成28年4月1日<br>至平成28年9月30日) |  |
| 1   | 営業外収益のうち主要なもの (千円)<br>為替差益 69,443      |
| 2   | 営業外費用のうち主要なもの (千円)<br>投資有価証券売却損 27,733 |

## （リース取引関係）

|   |              |
|---|--------------|
| 第27期中間会計期間末<br>(平成28年9月30日)                     |              |
| オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料は以下のとおりであります。 |              |
| 1年以内  | 635,819 千円   |
| 1年超   | 2,040,376 千円 |
| 合計  | 2,676,195 千円 |

## （金融商品関係）

第27期中間会計期間末（平成28年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、金額的重要性が低いと判断するものは次表には含めておりません。また、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません（注）2．参照）。

（単位：千円）

|               | 中間貸借対照表<br>計上額 | 時価         | 差額    |
|---------------|----------------|------------|-------|
| (1) 現金及び預金    | 10,094,984     | 10,094,984 | -     |
| (2) 未収委託者報酬   | 2,145,846      | 2,145,846  | -     |
| (3) 未収収益      | 1,539,462      | 1,539,462  | -     |
| (4) 関係会社短期貸付金 | 4,395,000      | 4,395,000  | -     |
| (5) 投資有価証券    | 431,529        | 431,529    | -     |
| (6) 敷金保証金     | 567,845        | 571,269    | 3,424 |
| 資産計           | 19,174,668     | 19,178,092 | 3,424 |
| (1) 未払手数料     | 1,018,265      | 1,018,265  | -     |
| (2) その他未払金    | 772,093        | 772,093    | -     |
| (3) 未払費用      | 700,422        | 700,422    | -     |
| (4) 長期未払金     | 257,957        | 259,647    | 1,689 |
| 負債計           | 2,748,740      | 2,750,429  | 1,689 |

（注）1．金融商品の時価算定方法

資産

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

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

(5) 投資有価証券

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

(6) 敷金保証金

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

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、及び(3) 未払費用

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

## (4) 長期未払金

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

## (注) 2 . 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## (有価証券関係)

第27期中間会計期間末（平成28年9月30日）

## 1 . 関係会社株式

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

## 2 . その他有価証券

(単位：千円)

|                        | 種類      | 中間貸借対照表計上額 | 取得原価    | 差額     |
|------------------------|---------|------------|---------|--------|
| 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | その他投資信託 | 431,529    | 466,620 | 35,090 |
| 合計                     |         | 431,529    | 466,620 | 35,090 |

（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期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

### 1. サービスごとの情報

（単位：千円）

|           | 委託者報酬     | 運用受託報酬    | 業務受託報酬  | その他     | 合計        |
|-----------|-----------|-----------|---------|---------|-----------|
| 外部顧客への売上高 | 5,230,257 | 2,908,954 | 444,231 | 231,585 | 8,815,029 |

### 2. 地域ごとの情報

営業収益

（単位：千円）

| 日本        | その他       | 合計        |
|-----------|-----------|-----------|
| 6,606,359 | 2,208,670 | 8,815,029 |

（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。

（1株当たり情報）

| 第27期中間会計期間<br>（自平成28年4月1日<br>至平成28年9月30日）                           |             |
|---|-------------|
| 1株当たり純資産額   | 269,000円48銭 |
| 1株当たり中間純損失金額  | 8,159円77銭   |
| なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、1株当たり中間純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 |             |
| 1株当たりの中間純損失の算定上の基礎  |             |
| 中間損益計算書上の中間純損失  | 459,109千円   |
| 普通株主に帰属しない金額  | -           |
| 普通株式に係る中間純損失  | 459,109千円   |
| 普通株式の期中平均株式数  | 56,265株     |

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

&lt;訂正前&gt;

## (1) 受託会社

名 称 三菱UFJ信託銀行株式会社  
 資本金の額 324,279百万円（平成28年3月末現在）

(略)

## (2) 販売会社

|     | 名 称                     | 資本金の額<br>(平成28年3月末現在)     | 事業の内容 |
|-----|-------------------------|---------------------------|-------|
| (略) |                         |                           |       |
| 5   | 野村證券株式会社                | 10,000百万円<br>(平成28年8月末現在) | 同 上   |
| 6   | 三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社 | 8,000百万円                  | 同 上   |

(以下略)

&lt;訂正後&gt;

## (1) 受託会社

名 称 三菱UFJ信託銀行株式会社  
 資本金の額 324,279百万円（平成28年9月末現在）

(略)

## (2) 販売会社

|     | 名 称                     | 資本金の額<br>(平成28年9月末現在)     | 事業の内容 |
|-----|-------------------------|---------------------------|-------|
| (略) |                         |                           |       |
| 5   | 野村證券株式会社                | 10,000百万円<br>(平成29年1月末現在) | 同 上   |
| 6   | 三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社 | 8,000百万円<br>(平成28年10月末現在) | 同 上   |

(以下略)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成29年2月8日

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているJPMグローバルマイスターの平成28年6月28日から平成28年12月27日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、JPMグローバルマイスターの平成28年12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中間計算期間（平成28年6月28日から平成28年12月27日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月9日

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 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28年4月1日から平成29年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。