

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 2019年12月16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北米高配当株プライム

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

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## ・【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2019年6月13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】

#### （5）申込手数料

##### <訂正前>

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

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

手数料率は、販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

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

（以下略）

##### <訂正後>

発行価格に販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。ただし、有価証券届出書提出日現在、販売会社における手数料率\*は、3.85%（税抜3.50%）が上限となっています。

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

手数料率は、販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

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

（以下略）

### 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

##### （ハ）委託会社の概況

##### <訂正前>

資本金 2,218百万円（2019年4月末現在）

（略）

大株主の状況（2019年4月末現在）

（以下略）

##### <訂正後>

資本金 2,218百万円（2019年10月末現在）

（略）

大株主の状況（2019年10月末現在）

（以下略）

#### 2【投資方針】

##### （3）運用体制

- ・ 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

<訂正前>

(略)

(注1)運用体制については、JPMIM社を含めたJ.P.モルガン・アセット・マネジメントのものを記載しています。

(注2)前記の運用体制、組織名称等は、2019年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(略)

(注1)運用体制については、JPMIM社を含めたJ.P.モルガン・アセット・マネジメントのものを記載しています。

(注2)前記の運用体制、組織名称等は、2019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。

### 3【投資リスク】

#### (1) リスク要因

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

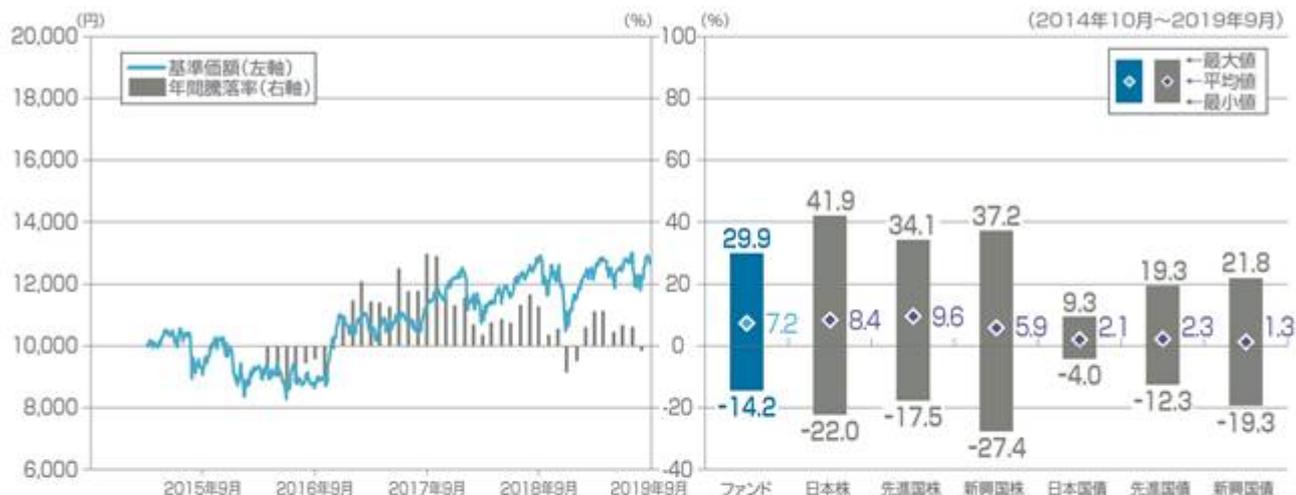
下記グラフは、ファンドの投資リスクをご理解いただくための情報の一つとしてご利用ください。

## ＜ファンドの基準価額・年間騰落率の推移＞

2014年10月～2019年9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2016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)

(2019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)

(2019年9月末現在)

(以下略)

## 4【手数料等及び税金】

<訂正前>

### (1) 申込手数料

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

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

申込手数料\*の詳細（具体的な手数料率、徴収時期、徴収方法）については、販売会社にお問い合わせください。

\* 購入時における当ファンド・投資環境についての説明・情報提供、事務手続き等の対価として、販売会社に支払われます。

(略)

### (3) 信託報酬等

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、前営業日の信託財産の純資産総額に対し年率1.674%\*（税抜1.55%）を乗じて得た額とします。

\* 2019年10月1日より消費税率が10%に引上げられる予定です。その場合、純資産総額に対して年率1.705%となります。

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

	委託会社	販売会社	受託会社
信託報酬の配分 (純資産総額に対し)	年率0.81% (税抜0.75%)	年率0.81% (税抜0.75%)	年率0.054% (税抜0.05%)
	投資判断、受託会社に対する指図等の運用業務、目論見書、運用報告書等の開示資料作成業務、基準価額の計算業務、およびこれらに付随する業務の対価	受益者の口座管理業務、収益分配金・換金代金・償還金の支払い業務、交付運用報告書の交付業務、購入後の投資環境等の情報提供業務、およびこれらに付随する業務の対価	信託財産の記帳・保管・管理業務、委託会社からの指図の執行業務、信託財産の計算業務、およびこれらに付随する業務の対価

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

信託報酬の配分 (純資産総額に対し)	委託会社	販売会社	受託会社
	年率0.825% (税抜0.75%)	年率0.825% (税抜0.75%)	年率0.055% (税抜0.05%)

委託会社の受ける報酬には、運用委託先への報酬\*（信託財産の純資産総額に対し年率0.50%）が含まれています。

\* 投資判断等の運用業務およびこれに付随する業務の対価として支払われます。

信託報酬は、毎日費用計上し、毎計算期間終了日および信託終了日の翌営業日に信託財産中から支弁されます。

マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

### (4) その他の手数料等

1、2（略）





(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

(2019年10月10日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	G I M北米高配当株式マザーファンド (適格機関投資家専用)	17,306,939	2.5490	44,116,104	2.4738	42,813,905	100.11

## (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)

(2019年10月10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	CHEVRON CORP	エネルギー	25,021	12,366.87	309,431,620	12,147.84	303,951,150	2.93
2	アメリカ	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	101,490	2,842.08	288,443,095	2,994.54	303,916,808	2.93
3	アメリカ	アメリカ	株式	CME GROUP INC	各種金融	12,569	22,678.69	285,048,472	23,098.50	290,325,148	2.80
4	アメリカ	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	18,255	14,322.08	261,449,649	14,842.82	270,955,840	2.61
5	アメリカ	アメリカ	株式	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	銀行	15,970	13,216.17	211,062,288	14,662.44	234,159,282	2.26
6	アメリカ	アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS INC	半導体・半導体製造装置	16,139	12,915.53	208,443,856	13,683.23	220,833,694	2.13
7	アメリカ	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	44,410	4,555.70	202,319,041	4,765.08	211,617,229	2.04
8	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	37,934	5,001.29	189,719,109	5,457.61	207,029,247	2.00
9	アメリカ	アメリカ	株式	CONOCOPHILLIPS	エネルギー	34,392	5,413.59	186,184,373	5,898.90	202,875,237	1.96
10	アメリカ	アメリカ	株式	BLACKROCK INC	各種金融	4,493	43,726.43	196,462,861	44,791.54	201,248,402	1.94
11	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	21,357	9,120.00	194,776,007	9,038.40	193,033,250	1.86
12	アメリカ	アメリカ	株式	MCDONALD'S CORPORATION	消費者サービス	8,436	23,048.04	194,433,301	22,851.55	192,775,736	1.86
13	アメリカ	アメリカ	株式	ANALOG DEVICES INC	半導体・半導体製造装置	16,125	11,184.73	180,353,818	11,603.47	187,106,049	1.80
14	アメリカ	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	35,806	4,779.03	171,118,260	5,169.86	185,112,204	1.78
15	アメリカ	アメリカ	株式	NEXTERA ENERGY INC	公益事業	7,342	23,825.40	174,926,109	25,055.86	183,960,148	1.77
16	アメリカ	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	28,904	6,004.13	173,543,385	6,358.45	183,784,679	1.77
17	アメリカ	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	7,033	23,349.75	164,218,819	24,581.28	172,880,197	1.67
18	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	44,569	3,687.08	164,329,727	3,832.03	170,789,981	1.65
19	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	6,792	21,757.45	147,776,647	24,376.21	165,563,226	1.60
20	アメリカ	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	12,490	12,596.64	157,332,139	13,096.99	163,581,438	1.58
21	アメリカ	アメリカ	株式	GENERAL DYNAMICS CORP	資本財	8,574	19,707.76	168,974,365	19,009.85	162,990,527	1.57
22	アメリカ	アメリカ	株式	AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC	素材	7,086	23,690.11	167,868,168	22,734.52	161,096,836	1.55
23	アメリカ	アメリカ	株式	DOVER CORPORATION	資本財	15,499	9,476.47	146,875,905	10,026.21	155,396,238	1.50
24	アメリカ	アメリカ	株式	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	食品・飲料・タバコ	25,090	5,758.25	144,474,570	5,899.98	148,030,536	1.43

25	アメリカ	アメリカ	株式	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	保険	23,283	6,238.19	145,243,941	6,236.04	145,193,943	1.40
26	アメリカ	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	18,497	7,246.40	134,036,685	7,241.03	133,937,384	1.29
27	アメリカ	アメリカ	株式	MEDTRONIC PLC	ヘルスケア機器・サービス	11,609	11,386.58	132,186,906	11,461.74	133,059,427	1.28
28	アメリカ	アメリカ	株式	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	保険	14,328	8,496.18	121,733,383	9,240.26	132,394,477	1.28
29	アメリカ	アメリカ	株式	THE TRAVELERS COS INC	保険	8,691	15,539.66	135,055,186	15,171.38	131,854,472	1.27
30	アメリカ	アメリカ	株式	XCEL ENERGY INC	公益事業	19,178	6,705.25	128,593,409	6,863.09	131,620,348	1.27

(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、どこの国への投資であるかを委託会社が分類し、記載したものです。そのため、有価証券の発行地と実質的な事業活動が行われている地域が異なる場合等には、上記の「国/地域」と「投資国」における国/地域名が異なる場合があります。

## 種類別および業種別投資比率

(2019年10月10日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.11

## (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)

(2019年10月10日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	6.99
		素材	3.91
		資本財	8.58
		商業・専門サービス	0.60
		運輸	1.07
		耐久消費財・アパレル	1.82
		消費者サービス	3.27
		メディア・娯楽	2.04
		小売	2.43
		食品・生活必需品小売り	0.88
		食品・飲料・タバコ	5.50
		家庭用品・パーソナル用品	1.58
		ヘルスケア機器・サービス	3.31
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.21
		銀行	10.13
		各種金融	8.05
		保険	8.09
		ソフトウェア・サービス	5.48
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.60
電気通信サービス	1.77		
公益事業	6.08		
半導体・半導体製造装置	3.93		
小計			95.32
投資証券	-		3.60

## 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

2019年10月10日および同日前1年以内における各月末ならびに下記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 (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	(2015年9月15日)	37	37	0.9381	0.9381
2期	(2016年3月15日)	50	50	0.9309	0.9309
3期	(2016年9月15日)	69	69	0.8763	0.8763
4期	(2017年3月15日)	45	45	1.1026	1.1026
5期	(2017年9月15日)	41	41	1.0850	1.0850
6期	(2018年3月15日)	35	35	1.1403	1.1403
7期	(2018年9月18日)	44	44	1.2574	1.2574
8期	(2019年3月15日)	48	48	1.2476	1.2476
9期	(2019年9月17日)	44	44	1.2833	1.2833
	2018年10月末日	43	-	1.2029	-
	2018年11月末日	44	-	1.2433	-
	2018年12月末日	40	-	1.1124	-
	2019年1月末日	42	-	1.1591	-
	2019年2月末日	47	-	1.2293	-
	2019年3月末日	47	-	1.2361	-
	2019年4月末日	42	-	1.2780	-
	2019年5月末日	40	-	1.2106	-
	2019年6月末日	42	-	1.2463	-
	2019年7月末日	45	-	1.2953	-
	2019年8月末日	41	-	1.2265	-
	2019年9月末日	43	-	1.2795	-
	2019年10月10日	42	-	1.2439	-

## 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	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

## 収益率の推移

期	収益率（％）
1期	6.19
2期	0.77
3期	5.87
4期	25.82
5期	1.60
6期	5.10
7期	10.27
8期	0.78
9期	2.86

（注）収益率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	45,718,971	5,636,136	40,082,835
2期	16,943,144	3,211,915	53,814,064
3期	29,807,970	4,186,959	79,435,075
4期	76,840,138	115,197,834	41,077,379
5期	3,155,738	5,612,514	38,620,603
6期	3,640,656	11,350,090	30,911,169
7期	8,262,113	4,114,347	35,058,935
8期	5,541,097	1,849,533	38,750,499
9期	6,836,760	11,056,674	34,530,585

(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。

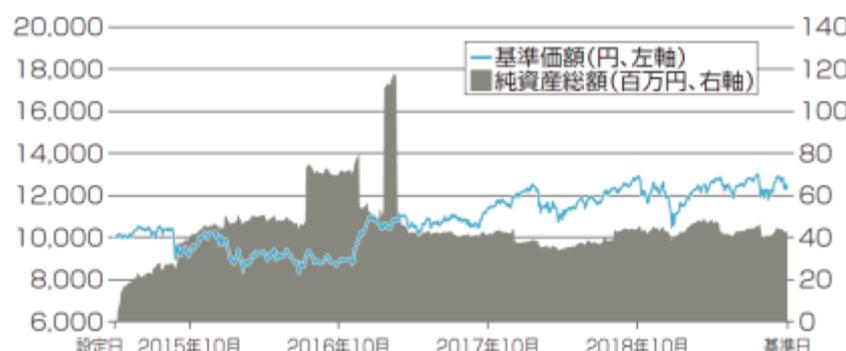
## &lt;参考情報&gt;

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

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

基準日	2019年10月10日	設定日	2015年4月2日
純資産総額	42百万円	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
5期	2017年9月	0
6期	2018年3月	0
7期	2018年9月	0
8期	2019年3月	0
9期	2019年9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	99.0%

## 通貨別構成状況

通貨	投資比率 2
米ドル	99.0%

## 業種別構成状況

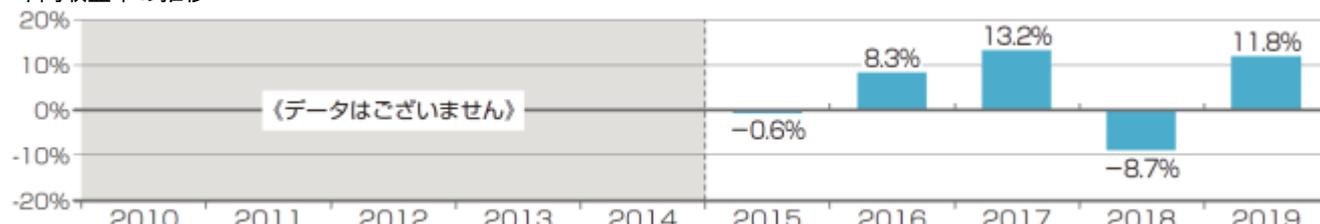
業種	投資比率 2
銀行	10.1%
資本財	8.6%
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.2%
保険	8.1%
各種金融	8.1%
その他	52.3%

\* 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 <sup>①</sup>	通貨	業種	投資比率 <sup>②</sup>
1	シェブロン	アメリカ	米ドル	エネルギー	2.9%
2	バンク・オブ・アメリカ	アメリカ	米ドル	銀行	2.9%
3	CMEグループ	アメリカ	米ドル	各種金融	2.8%
4	マイクロソフト	アメリカ	米ドル	ソフトウェア・サービス	2.6%
5	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	2.3%
6	テキサス・インスツルメンツ	アメリカ	米ドル	半導体・半導体製造装置	2.1%
7	コムキャスト	アメリカ	米ドル	メディア・娯楽	2.0%
8	プリストル・マイヤーズ スクイブ	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	2.0%
9	コノコフィリップス	アメリカ	米ドル	エネルギー	2.0%
10	ブラックロック	アメリカ	米ドル	各種金融	1.9%

## 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

\* 2015年の年間収益率は設定日から年末営業日、2019年の年間収益率は前年末営業日から2019年10月10日までのものです。

\* ベンチマークは設定していません。

\* 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北米高配当株プライム」です。

運用実績において、金額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3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、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9期計算期間（2019年3月16日から2019年9月17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北米高配当株プライム】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (2019年3月15日現在)	第9期 (2019年9月17日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	48,705,911	44,689,541
流動資産合計	48,705,911	44,689,541
資産合計	48,705,911	44,689,541
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	11,492	11,962
未払委託者報酬	344,668	358,883
その他未払費用	4,538	4,729
流動負債合計	360,698	375,574
負債合計	360,698	375,574
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 38,750,499	1 34,530,585
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,594,714	9,783,382
（分配準備積立金）	6,227,662	5,517,907
元本等合計	48,345,213	44,313,967
純資産合計	48,345,213	44,313,967
負債純資産合計	48,705,911	44,689,541

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第 8 期 (自 2018年 9 月19日 至 2019年 3 月15日)	第 9 期 (自 2019年 3 月16日 至 2019年 9 月17日)
営業収益		
有価証券売買等損益	234,636	1,418,323
営業収益合計	234,636	1,418,323
営業費用		
受託者報酬	11,492	11,962
委託者報酬	1 344,668	1 358,883
その他費用	4,538	4,729
営業費用合計	360,698	375,574
営業利益又は営業損失 ( )	126,062	1,042,749
経常利益又は経常損失 ( )	126,062	1,042,749
当期純利益又は当期純損失 ( )	126,062	1,042,749
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 ( )	14,171	126,265
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	9,024,043	9,594,714
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,158,983	1,767,318
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,158,983	1,767,318
剰余金減少額又は欠損金増加額	476,421	2,747,664
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	476,421	2,747,664
分配金	2 -	2 -
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	9,594,714	9,783,382

## (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 2019年9月15日および2019年9月16日が休日のため、信託約款第34条により、第9期計算期間末日を2019年9月17日としております。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 (2019年3月15日現在)	第9期 (2019年9月17日現在)
1期首元本額	35,058,935円	38,750,499円
期中追加設定元本額	5,541,097円	6,836,760円
期中一部解約元本額	1,849,533円	11,056,674円
受益権の総数	38,750,499口	34,530,585口
1口当たりの純資産額 (1万口当たりの純資産額)	1.2476円 (12,476円)	1.2833円 (12,833円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第8期 (自 2018年9月19日 至 2019年3月15日)	第9期 (自 2019年3月16日 至 2019年9月17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	178,743円	422,801円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	533,324円
収益調整金額	3,367,052円	4,265,475円
分配準備積立金額	6,048,919円	4,561,782円
当ファンドの分配対象収益額	9,594,714円	9,783,382円
当ファンドの期末残存口数	38,750,499口	34,530,585口
1万口当たり収益分配対象額	2,476.02円	2,833.25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8期 (2019年3月15日現在)	第9期 (2019年9月17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	265,589	1,513,892
合計	265,589	1,513,892

（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（2019年9月17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）	17,529,435	44,689,541	
合計			17,529,435	44,689,541	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは「G I M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	(2019年3月15日現在)	(2019年9月17日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		167,788,105	237,658,167
コール・ローン		19,430,750	10,789,622
株式		10,772,720,688	10,347,795,274
投資証券		366,486,241	381,225,957
未収入金		-	24,489,538
未収配当金		26,053,445	21,883,782
流動資産合計		11,352,479,229	11,023,842,340
資産合計		11,352,479,229	11,023,842,340
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	15,703
未払金		-	11,215,970
未払解約金		31,218,074	18,043,065
未払利息		53	26
流動負債合計		31,218,127	29,274,764
負債合計		31,218,127	29,274,764
純資産の部			
元本等			
元本	1	4,606,107,640	4,312,604,603
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		6,715,153,462	6,681,962,973
元本等合計		11,321,261,102	10,994,567,576
純資産合計		11,321,261,102	10,994,567,576
負債純資産合計		11,352,479,229	11,023,842,340

（注）「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）」の計算期間は、毎年2月27日から8月26日および8月27日から翌年2月26日まで（計算期間終了日が休業日の場合は、その翌営業日まで）であり、当ファンドの計算期間と異なります。

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

	当財務諸表対象期間
1. 有価証券の評価基準および評価方法	<p>株式および投資証券 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	(2019年3月15日現在)	(2019年9月17日現在)
1期首元本額	4,367,111,048円	4,606,107,640円
期中追加設定元本額	756,203,646円	603,700,323円
期中解約元本額	517,207,054円	897,203,360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)	207,147,775円	-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)	2,399,499,249円	2,348,128,790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)	216,591,827円	163,207,013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)	1,642,939,335円	1,486,422,873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)	120,113,387円	297,316,492円
J P M北米高配当株プライム	19,816,067円	17,529,435円
合計	4,606,107,640円	4,312,604,603円
受益権の総数	4,606,107,640口	4,312,604,603口
1口当たりの純資産額 (1万口当たりの純資産額)	2.4579円 (24,579円)	2.5494円 (25,494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
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 2019年3月15日現在、該当事項はありません。 2019年9月17日現在、「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (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る場合、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	(2019年3月15日現在)	(2019年9月17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	28,874,167	560,275,560
投資証券	3,826,001	14,321,864
合計	32,700,168	574,597,424

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間開始日から本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## (通貨関連)

区分	種類	(2019年3月15日現在)				(2019年9月17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	-	-	-	-	9,267,903	-	9,283,606	15,703
合計		-	-	-	-	9,267,903	-	9,283,606	15,703

(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（2019年9月17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	25,301	124.12	3,140,360.12	
	CONOCOPHILLIPS	34,778	62.53	2,174,668.34	
	EXXON MOBIL CORPORATION	18,705	73.73	1,379,119.65	
	VALERO ENERGY CORPORATION	9,291	82.39	765,485.49	
	AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC	7,165	215.24	1,542,194.60	
	CORTEVA INC	4,970	29.40	146,118.00	
	DUPONT DE NEMOURS INC	8,038	72.14	579,861.32	
	PPG INDUSTRIES INC	10,760	115.36	1,241,273.60	

	RPM INTERNATIONAL INC	6,260	67.21	420,734.60	
	DEERE & COMPANY	5,699	164.59	937,998.41	
	DOVER CORPORATION	15,673	99.25	1,555,545.25	
	GENERAL DYNAMICS CORP	9,970	190.97	1,903,970.90	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	4,152	166.21	690,103.92	
	ILLINOIS TOOL WORKS INC	5,770	156.79	904,678.30	
	PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,641	179.18	1,189,934.38	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	6,193	143.63	889,500.59	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	6,885	138.08	950,680.80	
	REPUBLIC SERVICES INC	6,837	84.89	580,392.93	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	6,040	182.28	1,100,971.20	
	HASBRO INC	7,332	119.07	873,021.24	
	VF CORP	10,359	88.42	915,942.78	
	LAS VEGAS SANDS CORP	13,539	59.64	807,465.96	
	MCDONALD'S CORPORATION	8,531	207.40	1,769,329.40	
	STARBUCKS CORPORATION	3,316	89.42	296,516.72	
	WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC	7,338	53.25	390,748.50	
	COMCAST CORP-CL A	44,908	46.27	2,077,893.16	
	GENUINE PARTS CO	1,038	97.89	101,609.82	
	HOME DEPOT INC	7,794	230.99	1,800,336.06	
	TIFFANY & CO	8,416	96.40	811,302.40	
	WALMART INC	7,249	115.57	837,766.93	
	ALTRIA GROUP INC	13,512	41.41	559,531.92	
	COCA-COLA COMPANY	25,626	53.96	1,382,778.96	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	25,372	54.05	1,371,356.60	
	PEPSICO INC	8,431	134.88	1,137,173.28	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	12,235	72.60	888,261.00	
	PROCTER & GAMBLE CO	12,630	119.75	1,512,442.50	
	ABBOTT LABORATORIES	5,319	83.36	443,391.84	
	BECTON DICKINSON AND COMPANY	4,653	258.73	1,203,870.69	
	MEDTRONIC PLC	11,739	109.05	1,280,137.95	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB COMPANY	38,359	49.47	1,897,619.73	
	ELI LILLY AND COMPANY	9,165	110.13	1,009,341.45	
	GILEAD SCIENCES INC	7,620	65.88	502,005.60	
	JOHNSON & JOHNSON	9,201	129.54	1,191,897.54	
	MERCK & CO INC	21,596	82.03	1,771,519.88	
	PFIZER INC	45,069	36.83	1,659,891.27	
	BANK OF AMERICA CORP	102,627	30.13	3,092,151.51	
	BB&T CORPORATION	23,652	52.92	1,251,663.84	
	CULLEN/FROST BANKERS INC	5,310	91.05	483,475.50	
	M & T BANK CORP	2,163	159.61	345,236.43	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	16,149	140.50	2,268,934.50	
	US BANCORP	20,583	55.86	1,149,766.38	
	WELLS FARGO COMPANY	36,207	48.98	1,773,418.86	
	BLACKROCK INC	4,543	435.71	1,979,430.53	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10,083	94.34	951,230.22	
	CME GROUP INC	12,710	207.00	2,630,970.00	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,337	83.59	864,069.83	
	NORTHERN TRUST CORPORATION	6,483	98.01	635,398.83	
	T ROWE PRICE GROUP INC	9,307	116.85	1,087,522.95	
	ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,397	87.56	822,801.32	

	CHUBB LIMITED	6,534	158.55	1,035,965.70	
	CINCINNATI FINANCIAL CORPORATION	2,829	112.78	319,054.62	
	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	23,544	60.03	1,413,346.32	
	MARSH & MCLENNAN COMPANIES INC	3,692	100.03	369,310.76	
	METLIFE INC	19,358	47.55	920,472.90	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,489	89.10	1,290,969.90	
	THE PROGRESSIVE CORPORATION	7,607	73.40	558,353.80	
	THE TRAVELERS COS INC	9,694	146.34	1,418,619.96	
	ACCENTURE PLC-CL A	3,774	194.16	732,759.84	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	5,811	158.17	919,125.87	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	8,962	133.06	1,192,483.72	
	MICROSOFT CORP	18,459	136.33	2,516,515.47	
	APPLE INC	6,868	219.90	1,510,273.20	
	VERIZON COMMUNICATIONS	29,228	59.50	1,739,066.00	
	CMS ENERGY CORP	16,177	61.46	994,238.42	
	DTE ENERGY COMPANY	1,690	130.05	219,784.50	
	EDISON INTERNATIONAL	8,073	71.48	577,058.04	
	NEXTERA ENERGY INC	7,424	218.31	1,620,733.44	
	NISOURCE INC	15,664	29.04	454,882.56	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP	11,797	60.80	717,257.60	
	XCEL ENERGY INC	19,393	62.83	1,218,462.19	
	ANALOG DEVICES INC	16,306	115.26	1,879,429.56	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	16,320	128.36	2,094,835.20	
小計	銘柄数 :	82		95,635,815.85	
				(10,347,795,274)	
	組入時価比率 :	94.1%		100.0%	
合計				10,347,795,274	
				(10,347,795,274)	

(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		2,583	395,612.28	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC-REIT		4,924	1,033,547.60	
		BOSTON PROPERTIES INC-REIT		3,639	480,457.17	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT		4,156	641,644.84	
		VENTAS INC-REIT		5,041	357,205.26	
		VORNADO REALTY TRUST-REIT		9,621	614,878.11	
	計	銘柄数：	6	29,964	3,523,345.26	
					(381,225,957)	
		組入時価比率：	3.5%		100.0%	
	小計				381,225,957	
					(381,225,957)	
	合計				381,225,957	
					(381,225,957)	

(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】

(2019年10月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	42,813,905	円
負債総額	46,698	円
純資産総額( - )	42,767,207	円
発行済口数	34,381,334	口
1口当たり純資産額( / )	1.2439	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)

(2019年10月10日現在)

種類	金額	単位
資産総額	10,377,137,353	円
負債総額	6,040,827	円
純資産総額( - )	10,371,096,526	円
発行済口数	4,192,377,691	口

1口当たり純資産額( / )	2.4738	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（2019年4月末現在）

（略）

投資運用の意思決定機構

（略）

（注）前記（イ）および（ロ）の意思決定機構、組織名称等は、2019年4月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 訂正後 >

資本金の額（2019年10月末現在）

（略）

投資運用の意思決定機構

（略）

（注）前記（イ）および（ロ）の意思決定機構、組織名称等は、2019年10月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

##### 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、2019年4月末現在以下のとおりです（親投資信託は本数のみ。）。

	本数	純資産額（百万円）
公募追加型株式投資信託	66	902,493
公募単位型株式投資信託	-	-
公募追加型債券投資信託	-	-
公募単位型債券投資信託	-	-
私募投資信託	56	3,112,649
総合計	122	4,015,142
親投資信託	51	-

（注）百万円未満は四捨五入

< 訂正後 >

（略）

委託会社が設定・運用している投資信託は、2019年10月末現在以下のとおりです（親投資信託は本数のみ。）。

	本数	純資産額（百万円）
公募追加型株式投資信託	70	841,583
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	57	3,419,191
総合計	127	4,260,774
親投資信託	53	-

(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29期事業年度（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表について、P w Cあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

3．第29期事業年度より、日付の表示を和暦から西暦に変更しております。

## (1)【貸借対照表】

		第28期 (2018年3月31日)			第29期 (2019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			11,797,632			15,698,047	
前払費用			24,288			20,735	
未収入金			36,147			11,933	
未収委託者報酬			2,408,280			2,066,605	
未収収益			1,464,696			1,359,147	
関係会社短期貸付金			4,751,000			3,901,000	
その他			14,055			574	
流動資産計			20,496,100	98.6		23,058,042	98.6
固定資産							
投資その他の資産			294,112			317,400	
関係会社株式		60,000			60,000		
投資有価証券		27			27		
敷金保証金		97,612			98,545		
前払年金費用		60,699			88,900		
その他		75,773			69,926		
固定資産計			294,112	1.4		317,400	1.4
資産合計			20,790,213	100.0		23,375,443	100.0

		第28期 (2018年3月31日)			第29期 (2019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			219,484			124,997	
未払金			1,762,101			1,586,271	
未払手数料		1,193,819			1,020,805		
その他未払金		568,282			565,466		
未払費用			539,165			569,460	
未払法人税等			624,002			1,066,438	
賞与引当金			634,004			590,294	
役員賞与引当金			-			35,788	
流動負債計			3,778,757	18.2		3,973,252	17.0
固定負債							
長期未払金			349,014			286,824	
賞与引当金			308,985			389,086	
役員賞与引当金			-			106,665	
固定負債計			658,000	3.1		782,576	3.3
負債合計			4,436,757	21.3		4,755,829	20.3

		第28期 (2018年3月31日)			第29期 (2019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	10.7		2,218,000	9.5
資本剰余金			1,000,000	4.8		1,000,000	4.3
資本準備金		1,000,000			1,000,000		
利益剰余金			13,135,458	63.2		15,401,616	65.9
利益準備金		33,676			33,676		
その他利益剰余金							
繰越利益剰余金		13,101,782			15,367,939		
株主資本計			16,353,458	78.7		18,619,616	79.7
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金			2	0.0		2	0.0
評価・換算差額等計			2	0.0		2	0.0
純資産合計			16,353,456	78.7		18,619,613	79.7
負債・純資産合計			20,790,213	100.0		23,375,443	100.0

## (2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	第28期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)			第29期 (自2018年4月1日 至2019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			12,446,131			14,035,964	
運用受託報酬			5,788,387			6,154,913	
業務受託報酬			1,430,987			2,057,519	
その他営業収益			348,871			256,704	
営業収益計			20,014,377	100.0		22,505,101	100.0
営業費用							
支払手数料			6,209,103			7,436,223	
広告宣伝費			153,740			162,266	
調査費			1,897,150			1,760,202	
委託調査費		1,555,380			1,454,877		
調査費		324,761			286,936		
図書費		17,007			18,388		
委託計算費			303,836			288,996	
営業雑経費			286,552			247,970	
通信費		13,917			12,017		
印刷費		241,049			198,583		
協会費		28,217			33,731		
諸会費		3,369			3,638		
営業費用計			8,850,383	44.2		9,895,658	44.0

区分	注記 番号	第28期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)			第29期 (自2018年4月1日 至2019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			5,064,982			5,056,630	
役員報酬及び賞与		302,393			283,061		
給料・手当		3,186,497			3,093,292		
賞与		905,378			942,629		
賞与引当金繰入額		670,712			639,350		
役員賞与引当金繰入額		-			98,296		
福利厚生費			393,358			383,253	
交際費			17,403			13,830	
寄付金			11,544			8,404	
旅費交通費			149,516			176,449	
租税公課			140,135			152,677	
不動産関連費用			1,114,905			1,051,170	
退職給付費用			248,750			217,801	
退職金			154,442			158,967	
消耗器具備品費			50,426			29,676	
事務委託費			331,399			322,502	
関係会社等配賦経費			2,062,711			1,845,247	
諸経費			96,551			79,342	
一般管理費計			9,836,127	49.2		9,495,955	42.2
営業利益			1,327,866	6.6		3,113,488	13.8

区分	注記 番号	第28期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)			第29期 (自2018年4月1日 至2019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	454,000			437,000		
投資有価証券売却益		86,573			0		
受取利息	1	14,113			16,957		
その他営業外収益		34,949			61,187		
営業外収益計			589,637	2.9		515,145	2.3
営業外費用							
投資有価証券売却損		1,447			-		
為替差損		25,196			13,470		
その他営業外費用		4,484			216		
営業外費用計			31,128	0.1		13,686	0.1
経常利益			1,886,375	9.4		3,614,946	16.0
税引前当期純利益			1,886,375	9.4		3,614,946	16.0
法人税、住民税及び事業税			839,234	4.2		1,348,788	6.0
当期純利益			1,047,141	5.2		2,266,157	10.0

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第28期（自2017年4月1日 至2018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

第29期（自2018年4月1日 至2019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	13,101,782	13,135,458	16,353,458
当期変動額							
当期純利益	-	-	-	-	2,266,157	2,266,157	2,266,157
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	2,266,157	2,266,157	2,266,157
当期末残高	2,218,000	1,000,000	1,000,000	33,676	15,367,939	15,401,616	18,619,616

	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	2	2	16,353,456
当期変動額			
当期純利益	-	-	2,266,157
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	0	0	0
当期変動額合計	0	0	2,266,157
当期末残高	2	2	18,619,613

## 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

2022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28期 (2018年3月31日)	第29期 (2019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28期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第29期 (自2018年4月1日 至2019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 14,112千円 関係会社からの受取配当金 454,000千円	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 16,957千円 関係会社からの受取配当金 437,000千円

## （株主資本等変動計算書関係）

第28期（自2017年4月1日 至2018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29期（自2018年4月1日 至2019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28期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第29期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)						
該当事項はありません。	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。  <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="padding-right: 20px;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">48,482千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td style="text-align: right;">20,201千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">68,683千円</td> </tr> </table>	1年以内	48,482千円	1年超	20,201千円	合計	68,683千円
1年以内	48,482千円						
1年超	20,201千円						
合計	68,683千円						

## （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28期（2018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。

第29期（2019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	15,698,047	15,698,047	-
(2) 未収委託者報酬	2,066,605	2,066,605	-
(3) 未収収益	1,359,147	1,359,147	-
(4) 関係会社短期貸付金	3,901,000	3,901,000	-
資産計	23,024,800	23,024,800	-
(1) 未払手数料	1,020,805	1,020,805	-
(2) その他未払金	565,466	565,466	-
(3) 未払費用	569,460	569,460	-
(4) 長期未払金	286,824	286,824	-
負債計	2,442,557	2,442,557	-

(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28期(2018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	-	-	-

第29期(2019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	15,698,047	-	-	-
未収委託者報酬	2,066,605	-	-	-
未収収益	1,359,147	-	-	-
関係会社短期貸付金	3,901,000	-	-	-
合計	23,024,800	-	-	-

## (有価証券関係)

## 1. 関係会社株式

関係会社株式(第28期の貸借対照表計上額は60,000千円、第29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28期(2018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

第29期(2019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28期(自2017年4月1日至2018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

第29期(自2018年4月1日至2019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	10	0	-

## （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28期 (2018年3月31日)	第29期 (2019年3月31日)
	(千円)	(千円)
退職給付債務の期首残高	1,438,648	1,376,741
勤務費用	185,799	170,477
利息費用	5,755	5,507
数理計算上の差異の発生額	12,545	180,184
退職給付の支払額	240,916	222,653
退職給付債務の期末残高	1,376,741	1,510,256

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第28期 (2018年3月31日)	第29期 (2019年3月31日)
	(千円)	(千円)
年金資産の期首残高	1,596,600	1,601,397
期待運用収益	11,176	8,007
数理計算上の差異の発生額	58,590	184,461
事業主からの拠出額	175,947	168,622
退職給付の支払額	240,916	222,653
年金資産の期末残高	1,601,397	1,739,834

## (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28期 (2018年3月31日)	第29期 (2019年3月31日)
	(千円)	(千円)
積立型制度の退職給付債務	1,376,741	1,510,256
年金資産	1,601,397	1,739,834
	224,656	229,578
未認識数理計算上の差異	163,853	140,678
未認識過去勤務費用	104	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	60,699	88,900
前払年金費用	60,699	88,900
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	60,699	88,900

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第28期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第29期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
	(千円)	(千円)
勤務費用	185,799	170,477
利息費用	5,755	5,507
期待運用収益	11,176	8,007
数理計算上の差異の費用処理額	18,366	27,452
過去勤務債務の費用処理額	414	104
その他(注1)	13,607	8,919
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)	175,205	149,340

(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28期 (2018年3月31日)	第29期 (2019年3月31日)
債券	49%	51%
現金及び預金	51%	49%
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28期 (2018年3月31日)	第29期 (2019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	0.7%	0.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第28期事業年度73,544千円、第29期事業年度68,460千円であります。

## （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

	第28期 (2018年3月31日)	第29期 (2019年3月31日)
繰延税金資産	(千円)	(千円)
賞与引当金	240,628	286,600
未払費用	123,728	173,650
未払事業税	40,523	59,662
長期前払費用	76,161	84,986
減価償却超過額	113,576	138,298
その他	12,691	8,350
繰延税金資産小計	581,925	734,846
評価性引当額（注）	581,925	734,846
繰延税金資産合計	-	-
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産又は繰延税金負債（ ）の純額	-	-

（注）評価性引当額が152,921千円増加しております。この増加の内容は、上記の一時差異の増加に関わる評価性引当額を追加的に認識したことに伴うものであります。

## 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

	第28期 (2018年3月31日)	第29期 (2019年3月31日)
法定実効税率	30.86%	30.62%
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	4.40%	2.28%
評価性引当額	3.16%	4.25%
住民税等均等割	0.31%	0.13%
過年度法人税等	5.67%	0.02%
その他	0.09%	0.00%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.49%	37.31%

(セグメント情報等)

## セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 関連情報

第28期(自2017年4月1日 至2018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

第29期（自2018年4月1日 至2019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	14,035,964	6,154,913	2,057,519	256,704	22,505,101

## 2．地域ごとの情報

営業収益

（単位：千円）

日本	英国	香港	その他	合計
15,553,649	2,453,206	2,613,294	1,884,951	22,505,101

（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	2,436,118	資産運用業
JF Asset Management Limited	2,613,294	資産運用業

## （関連当事者情報）

## 1. 関連当事者との取引

第28期（自2017年4月1日 至2018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	J P モルガン・チェース・ホールディングス・エルエルシー	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J P モルガン・チェース・ホールディングス・エルエルシー（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。

第29期（自2018年4月1日 至2019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	J Pモルガン・チェース・ホールディングス・エルエルシー	米国 ニューヨーク	222,876 百万米ドル	持株会社	被所有 間接 100%	人件費の立替	-	-	未払金	397,949

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

当社の役員への賞与の支払いの一部はJ Pモルガン・チェース・ホールディングス・エルエルシー（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）	17,554,000	関係会社 短期貸付金	3,901,000
							資金の回収	18,404,000		
							受取利息	16,957	未収収益	118
							配当の受取	437,000	-	-

(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	1,003,333	未払費用	279,661
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	2,457,468	未収収益	603,775

(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28期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第29期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
1株当たり純資産額	290,650.60円	330,927.11円
1株当たり当期純利益	18,610.88円	40,276.51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。

## 1株当たりの当期純利益の算定上の基礎

	第28期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第29期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
損益計算書上の当期純利益	1,047,141千円	2,266,157千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,047,141千円	2,266,157千円
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】

&lt;訂正前&gt;

## (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(2018年9月末現在)

(略)

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2018年9月末現在)	事業の内容
(略)		

(略)

## (3) 運用委託先の会社

名 称	資本金の額 (2018年9月末現在)	事業の内容
(以下略)		

(以下略)

&lt;訂正後&gt;

## (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(2019年3月末現在)

(略)

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2019年3月末現在)	事業の内容
(略)		

(略)

## (3) 運用委託先の会社

名 称	資本金の額 (2019年3月末現在)	事業の内容
(以下略)		

(以下略)

独立監査人の監査報告書

2019年10月30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	鶴田光夫
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山口健志

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北米高配当株プライムの2019年3月16日から2019年9月17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北米高配当株プライムの2019年9月17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

2019年6月14日

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会御中

P w C あらた有限責任監査法人

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第29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2019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。