

【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】 2023年9月19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】 日興JPM環太平洋ディスカバリー・ファンド（年4回決算型）

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】 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、2023年3月17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より訂正するため、また記載事項の一部訂正を行うため、訂正届出書を提出いたします。

・【訂正の内容】

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）ファンドの目的及び基本的性格

（二）ファンドの特色

<訂正前>

（略）

投資先ファンドの特徴

アジア・オセアニア株式ファンド

（略）

北米株式ファンド

（略）	
運用会社	J．P．モルガン・インベストメント・マネージメント・インク*（米国人） 2022年12月末時点において実際に運用を行っている運用会社であり、今後変更される場合があります。

中南米株式ファンド

（略）	
運用会社	J．P．モルガン・インベストメント・マネージメント・インク*（米国人） 2022年12月末時点において実際に運用を行っている運用会社であり、今後変更される場合があります。

*（略）

（略）

<訂正後>

（略）

投資先ファンドの特徴

アジア・オセアニア株式ファンド

（略）

北米株式ファンド

（略）	
-----	--

運用会社	J . P . モルガン・インベストメント・マネージメント・インク* (米国人) 2023年6月末時点において実際に運用を行っている運用会社であり、今後変更される場合があります。
------	--

中南米株式ファンド

(略)	
運用会社	J . P . モルガン・インベストメント・マネージメント・インク* (米国人) 2023年6月末時点において実際に運用を行っている運用会社であり、今後変更される場合があります。

* (略)

(略)

(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 (2023年1月末現在)

(略)

大株主の状況 (2023年1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 (2023年7月末現在)

(略)

大株主の状況 (2023年7月末現在)

(以下略)

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

< 訂正前 >

(略)

(ESG*投資について)

投資先ファンドの運用プロセスにおいて、環境、社会、そしてガバナンス面(企業統治)の要素が、投資対象候補銘柄のリスク要因となり得るかどうかを分析・評価しています。なお、この評価のみが投資判断を決定付けるものではなく、リスク要因を十分考慮しつつも、リスクが認められる銘柄を組み入れる可能性や、当該銘柄を継続的に保有する可能性があります。

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

(以下略)

<訂正後>

（略）

（ESG*投資について）

投資先ファンドの運用会社は、投資先ファンドの運用プロセスの一環として、財務的に重要な環境、社会、ガバナンス面（企業統治）（ESG）の要素を組み入れています（これらの要素の運用プロセスへの組み入れを「ESGインテグレーション」といいます。以下同じ）。ESGインテグレーションは、銘柄分析及び投資判断にESGの要素を体系的に統合するものです。運用プロセスの一環として、投資先ファンドの運用会社のポートフォリオ・マネジャーは、環境、社会、ガバナンス面の各要素が、投資先ファンドの投資対象の発行会社または国・地域等の発行体に与える影響を評価します。投資先ファンドの運用会社のポートフォリオ・マネジャーは、各業界の主要な投資機会とリスクを分析することで、発行会社等にかかるESGの要素のうち財務的に重要性が高い要因を特定し、当該会社等との対話に役立つ重要な問題を確認します。これらの評価は決定的なものではなく、これらの要素により悪影響を受ける可能性のある発行会社または国・地域等の発行体の有価証券に投資を行い保有することがあります。一方、投資先ファンドは、これらの要素によりプラスの影響を受ける可能性のある発行会社または国・地域等の発行体の有価証券であっても、それらを売却することや投資しないことがあります。特に、ESGインテグレーションは、投資先ファンドの投資目的を変更するものではなく、特定の業種や企業を除外したり、投資先ファンドの投資対象を制限したりするものでもありません。投資先ファンドは、特定の種類の企業もしくは投資対象を除外したい、または特定のESG目標を実現するファンドを探している投資家のために設計されているものではありません。

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

（以下略）

（2）投資対象

<訂正前>

（略）

（ホ）当ファンドが投資対象とする投資先ファンドの名称、主要投資対象、主な運用方針および運用会社の名称は、以下のとおりです。

アジア・オセアニア株式ファンド

（略）

北米株式ファンド

（略）	
運用会社	J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク（米国法人） 2022年12月末時点において実際に運用を行っている運用会社であり、今後変更される場合があります。

中南米株式ファンド

（略）	
運用会社	J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク（米国法人） 2022年12月末時点において実際に運用を行っている運用会社であり、今後変更される場合があります。

<訂正後>

（略）

（ホ）当ファンドが投資対象とする投資先ファンドの名称、主要投資対象、主な運用方針および運用会社の名称は、以下のとおりです。

アジア・オセアニア株式ファンド

(略)

北米株式ファンド

(略)	
運用会社	J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク(米国法人) 2023年6月末時点において実際に運用を行っている運用会社であり、今後変更される場合があります。

中南米株式ファンド

(略)	
運用会社	J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク(米国法人) 2023年6月末時点において実際に運用を行っている運用会社であり、今後変更される場合があります。

(3) 運用体制

<訂正前>

(イ) 当ファンドの運用体制

(略)

株式運用本部の株式運用部には12名のポートフォリオ・マネジャーが所属しています。

(略)

(注) 前記の運用体制、組織名称等は、2022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

以下の運用体制は各投資先ファンドにおけるものです。

アジア・オセアニア株式ファンド

(略)

EMAPアジア株式運用チームは、EMAPに属しています。EMAPには、EMAPアジア株式運用チームを含めた約100名が所属しています。EMAPアジア株式運用チーム内で国別スペシャリスト(24名(内委託会社10名所属))とアジア・パシフィック・ポートフォリオ・マネジャー(13名(内委託会社2名所属))が運用に携わり、それぞれの役割を補完し合っています。また、EMAPに所属するセクター・アナリスト(36名)から提供される情報も活用します。

国別スペシャリストとアジア・パシフィック・ポートフォリオ・マネジャーを兼務している場合があります。

(略)

(注) 前記の運用体制、組織名称等は、2022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)

北米株式ファンド

(略)

(注1) (略)

(注2) 前記の運用体制、組織名称等は、2022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。

中南米株式ファンド

J P M I M社のE M A P（約100名）に属する、同社のポートフォリオ・マネジャーが、当該投資先ファンドの運用を担当します。

（略）

（注1）（略）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、2022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。

<訂正後>

（イ）当ファンドの運用体制

（略）

株式運用本部の株式運用部には11名のポートフォリオ・マネジャーが所属しています。

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2023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）

（ハ）投資先ファンドの運用体制

以下の運用体制は各投資先ファンドにおけるものです。

アジア・オセアニア株式ファンド

（略）

E M A Pアジア株式運用チームは、E M A Pに属しています。E M A Pには、E M A Pアジア株式運用チームを含めた約90名が所属しています。

E M A Pアジア株式運用チーム内で国別スペシャリスト（23名（内委託会社8名所属））とアジア・パシフィック・ポートフォリオ・マネジャー（12名（内委託会社2名所属））が運用に携わり、それぞれの役割を補完し合っています。また、E M A Pに所属するセクター・アナリスト（35名）から提供される情報も活用します。

国別スペシャリストとアジア・パシフィック・ポートフォリオ・マネジャーを兼務している場合があります。

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2023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）

北米株式ファンド

（略）

（注1）（略）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、2023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。

中南米株式ファンド

J P M I M社のE M A P（約90名）に属する、同社のポートフォリオ・マネジャーが、当該投資先ファンドの運用を担当します。

（略）

（注1）（略）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、2023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。

3【投資リスク】

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

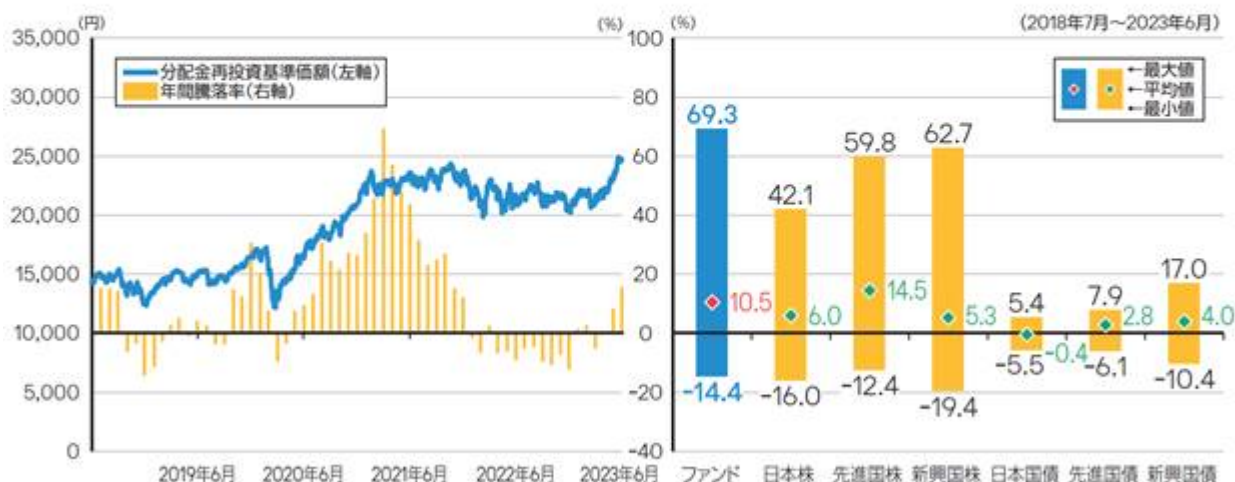
下記グラフは、ファンドの投資リスクをご理解いただくための情報の一つとしてご利用ください。

<ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移>

2018年7月～2023年6月の5年間における、ファンドの分配金再投資基準価額(白次)と、年間騰落率(毎月末時点)の推移を示したものです。

<ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較>

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



(ご注意)

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

○代表的な資産クラスを表す指数

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

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

TOPIX(東証株価指数)は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

MSCIコクサイ指数およびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が発表しています。同インデックスに関する情報の確実性および完全性を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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しております。また、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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>

(略)

(ロ) 投資先ファンドにおけるリスク管理

アジア・オセアニア株式ファンド

(略)

(2022年12月末現在)

(略)

北米株式ファンドおよび中南米株式ファンド

(略)

(2022年12月末現在)

(以下略)

<訂正後>

(略)

(ロ) 投資先ファンドにおけるリスク管理

アジア・オセアニア株式ファンド

(略)

(2023年6月末現在)

(略)

北米株式ファンドおよび中南米株式ファンド

(略)

(2023年6月末現在)

(以下略)

4【手数料等及び税金】

(3) 信託報酬等

<訂正前>

(略)

<ご参考：投資先ファンドの運用報酬>

投資先ファンド	運用報酬* (投資先ファンドの日々の純資産総額に対し)
アジア・オセアニア株式ファンド	かかりません。
北米株式ファンド	年率0.60% (消費税等がかかりません。)
中南米株式ファンド	年率0.85% (消費税等がかかりません。)

* 投資先ファンドの運用会社等が提供する、投資先ファンドの運用業務、投資先ファンドに関する情報提供業務、およびこれらに付随する業務の対価として投資先ファンドの運用会社等に支払われます。

当ファンドの信託財産全額を、前記「2 投資方針 (1) 投資方針 (ロ) 投資態度 当ファンドの投資態度」に記載の組入比率で投資先ファンドに投資したと仮定した場合には、実質的な信託報酬の負担は年率1.893% (税抜1.745%) 程度 (概算) となります。

<訂正後>

(略)

<ご参考：投資先ファンドの運用報酬>

投資先ファンド	運用報酬* (投資先ファンドの日々の純資産総額に対し)
アジア・オセアニア株式ファンド	かかりません。
北米株式ファンド	年率0.60% (消費税等はこちらかかりません。)
中南米株式ファンド	年率0.75% (消費税等はこちらかかりません。)

* 投資先ファンドの運用会社等が提供する、投資先ファンドの運用業務、投資先ファンドに関する情報提供業務、およびこれらに付随する業務の対価として投資先ファンドの運用会社等に支払われます。

当ファンドの信託財産全額を、前記「2 投資方針 (1) 投資方針 (口) 投資態度 当ファンドの投資態度」に記載の組入比率で投資先ファンドに投資したと仮定した場合には、実質的な信託報酬の負担は年率1.883% (税抜1.735%) 程度 (概算) となります。

(5) 課税上の取扱い

<訂正前>

(略)

なお、税法が改正された場合には、以下の内容が変更になることがあります。以下の税制は2023年1月末現在適用されるものです。

(以下略)

<訂正後>

(略)

なお、税法が改正された場合には、以下の内容が変更になることがあります。以下の税制は2023年7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。

<更新・訂正後>

(1) 投資状況

(2023年7月3日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	ルクセンブルク	50,920,928	40.86
親投資信託受益証券	日本	71,635,208	57.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,073,737	1.66
合計(純資産総額)		124,629,873	100.00

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

親投資信託は、全て「GIMアジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド(適格機関投資家専用)」です(以下同じ)。

(参考) GIMアジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド(適格機関投資家専用)

(2023年7月3日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	1,581,885,550	31.63
	アメリカ	59,829,995	1.20
	香港	1,051,186,988	21.02
	シンガポール	51,835,427	1.04
	タイ	51,608,448	1.03
	インドネシア	222,833,482	4.46
	韓国	586,458,007	11.73
	台湾	722,860,239	14.45
	中国	172,632,620	3.45
	インド	391,151,133	7.82
	小計	4,892,281,889	97.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	109,195,120	2.18
合計(純資産総額)		5,001,477,009	100.00

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

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

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(2023年 7月 3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アジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド（適格機関投資家専用）	26,705,640	2.7052	72,246,633	2.6824	71,635,208	57.48
2	ルクセンブルク	投資証券	JPM US GROWTH FUND I JPY CLASS	567.4	65,967	37,429,675	67,576	38,342,622	30.77
3	ルクセンブルク	投資証券	JPM LATIN AMERICA EQ I JPY	862.473	14,437	12,451,522	14,584	12,578,306	10.09

(参考) G I Mアジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド（適格機関投資家専用）

(2023年 7月 3日現在)

順位	国/ 地域	投資国/ 地域	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	台湾	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	143,540	2,162.97	310,473,274	2,670.68	383,349,637	7.66
2	韓国	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	39,032	6,539.05	255,232,200	7,934.78	309,710,333	6.19
3	香港	中国	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・娯楽	38,700	5,672.92	219,542,019	6,114.70	236,639,045	4.73
4	日本	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	13,800	11,010.31	151,942,375	13,330.00	183,954,000	3.68
5	香港	香港	株式	AIA GROUP LTD	保険	105,000	1,540.66	161,769,510	1,458.60	153,153,420	3.06
6	インド	インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	42,855	2,911.20	124,759,798	3,011.47	129,056,890	2.58
7	インドネシア	インドネシア	株式	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	銀行	1,333,800	83.90	111,912,489	88.75	118,381,419	2.37
8	香港	香港	株式	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	金融サービス	20,900	6,108.73	127,672,595	5,443.48	113,768,899	2.27
9	日本	日本	株式	オリックス	その他金融業	40,700	2,139.50	87,077,650	2,654.50	108,038,150	2.16
10	日本	日本	株式	村田製作所	電気機器	12,600	7,623.16	96,051,898	8,409.00	105,953,400	2.12
11	台湾	台湾	株式	DELTA ELECTRONICS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	66,000	1,344.61	88,744,524	1,597.30	105,422,374	2.11
12	香港	中国	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	41,090	3,104.71	127,572,613	2,255.21	92,666,661	1.85
13	日本	日本	株式	キーエンス	電気機器	1,300	53,370.00	69,381,000	69,620.00	90,506,000	1.81
14	インドネシア	インドネシア	株式	BANK RAKYAT INDONESIA PERSERO TBK PT	銀行	1,710,407	48.20	82,457,011	52.62	90,005,892	1.80
15	韓国	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	6,990	8,682.10	60,687,879	12,660.47	88,496,755	1.77
16	香港	中国	株式	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES	不動産管理・開発	119,000	720.08	85,689,758	717.31	85,360,604	1.71
17	日本	日本	株式	第一三共	医薬品	16,900	4,446.14	75,139,767	4,578.00	77,368,200	1.55
18	日本	日本	株式	テルモ	精密機器	15,900	3,809.58	60,572,415	4,574.00	72,726,600	1.45
19	日本	日本	株式	信越化学工業	化学	14,500	3,384.00	49,068,000	4,964.00	71,978,000	1.44
20	韓国	韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	970	82,179.16	79,713,793	73,303.30	71,104,201	1.42
21	日本	日本	株式	ダイキン工業	機械	2,200	20,705.00	45,551,000	31,240.00	68,728,000	1.37
22	インド	インド	株式	INFOSYS LIMITED	ソフトウェア・サービス	28,569	2,668.00	76,222,363	2,363.83	67,532,402	1.35
23	日本	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	2,900	14,914.69	43,252,601	21,370.00	61,973,000	1.24
24	日本	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	10,100	4,839.00	48,873,900	5,937.00	59,963,700	1.20
25	香港	中国	株式	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	耐久消費財・アパレル	43,300	1,549.68	67,101,288	1,378.39	59,684,287	1.19
26	香港	香港	株式	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	消費者サービス	64,000	977.61	62,567,232	916.46	58,653,952	1.17

27	日本	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	17,200	2,891.50	49,733,800	3,345.00	57,534,000	1.15
28	台湾	台湾	株式	ADVANTECH CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	30,000	1,592.52	47,775,791	1,898.68	56,960,631	1.14
29	中国	中国	株式	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD-A	資本財	50,470	964.23	48,665,077	1,112.85	56,165,897	1.12
30	日本	日本	株式	ファナック	電気機器	10,800	4,556.85	49,214,084	5,145.00	55,566,000	1.11

(注1) 上記の「国/地域」は、マザーファンドが保有する有価証券の発行地または上場取引所の国/地域を表しています。なお、「投資国/地域」は、「第1ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 (イ) ファンドの目的」の記載に基づき、どこへの投資であるかを委託会社が分類し、記載したものです。そのため、有価証券の発行地と実質的な事業活動が行われている地域が異なる場合等には、上記の「国/地域」と「投資国/地域」における国/地域名が異なる場合があります。

(注2) 上記業種は、国内は東証33業種、外国はGICS24分類に基づき分類したものであり、参考情報に記載している業種別構成状況の業種とは分類が異なります(以下同じ)。

種類別および業種別投資比率

(2023年7月3日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	40.86
親投資信託受益証券	57.48

(参考) G I Mアジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド(適格機関投資家専用)

(2023年7月3日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	化学	4.41
		医薬品	1.55
		ゴム製品	1.20
		金属製品	0.78
		機械	1.88
		電気機器	11.04
		輸送用機器	0.77
		精密機器	2.56
		その他製品	0.66
		情報・通信業	0.41
		卸売業	1.02
		小売業	0.94
		保険業	1.15
		その他金融業	2.16
	サービス業	1.09	
	外国	不動産管理・開発	1.71
		素材	1.42
		資本財	2.77
		運輸	1.03
		自動車・自動車部品	0.62
耐久消費財・アパレル		2.94	
消費者サービス	5.01		
メディア・娯楽	6.92		

	食品・飲料・タバコ	2.29
	家庭用品・パーソナル用品	1.13
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.07
	銀行	7.50
	金融サービス	5.34
	保険	4.57
	ソフトウェア・サービス	1.35
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	11.10
	半導体・半導体製造装置	9.43
合計		97.82

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

2023年7月3日および同日前1年以内における各月末ならびに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額 (円) (分配落)	1口当たり 純資産額 (円) (分配付)
第1特定期間末	(2016年6月20日)	127	127	0.9344	0.9344
第2特定期間末	(2016年12月20日)	66	66	1.0896	1.0896
第3特定期間末	(2017年6月20日)	32	37	1.1070	1.2570
第4特定期間末	(2017年12月20日)	48	48	1.2312	1.2412
第5特定期間末	(2018年6月20日)	76	76	1.2279	1.2279
第6特定期間末	(2018年12月20日)	53	53	1.1025	1.1025
第7特定期間末	(2019年6月20日)	49	49	1.2374	1.2374
第8特定期間末	(2019年12月20日)	42	42	1.3461	1.3561
第9特定期間末	(2020年6月22日)	33	33	1.3443	1.3543
第10特定期間末	(2020年12月21日)	144	145	1.6794	1.6894
第11特定期間末	(2021年6月21日)	184	185	1.8341	1.8441
第12特定期間末	(2021年12月20日)	133	133	1.8126	1.8126
第13特定期間末	(2022年6月20日)	168	168	1.6559	1.6559
第14特定期間末	(2022年12月20日)	164	165	1.6530	1.6630
第15特定期間末	(2023年6月20日)	124	124	1.9407	1.9507
	2022年7月末日	171	-	1.7215	-
	2022年8月末日	175	-	1.7657	-
	2022年9月末日	164	-	1.6463	-
	2022年10月末日	166	-	1.6779	-
	2022年11月末日	170	-	1.7159	-
	2022年12月末日	161	-	1.6240	-
	2023年1月末日	169	-	1.7183	-
	2023年2月末日	168	-	1.7130	-
	2023年3月末日	167	-	1.7004	-
	2023年4月末日	167	-	1.6973	-
	2023年5月末日	180	-	1.8289	-
	2023年6月末日	123	-	1.9324	-
	2023年7月3日	124	-	1.9460	-

分配の推移

期	1口当たり分配金（円）
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0000
第3特定期間	0.1500
第4特定期間	0.0600
第5特定期間	0.0000
第6特定期間	0.0000
第7特定期間	0.0100
第8特定期間	0.0100
第9特定期間	0.0100
第10特定期間	0.0200
第11特定期間	0.0200
第12特定期間	0.0000
第13特定期間	0.0000
第14特定期間	0.0200
第15特定期間	0.0200

収益率の推移

期	収益率（％）
第1特定期間	6.56
第2特定期間	16.61
第3特定期間	15.36
第4特定期間	16.64
第5特定期間	0.27
第6特定期間	10.21
第7特定期間	13.14
第8特定期間	9.59
第9特定期間	0.61
第10特定期間	26.42
第11特定期間	10.40
第12特定期間	1.17
第13特定期間	8.65
第14特定期間	1.03
第15特定期間	18.61

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

(4) 設定及び解約の実績

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

期	設定口数（口）	解約口数（口）	残存口数（口）
第1特定期間	136,812,562	181,689	136,630,873
第2特定期間	4,798,220	80,540,643	60,888,450
第3特定期間	946,201	32,185,490	29,649,161
第4特定期間	16,828,624	7,247,426	39,230,359
第5特定期間	70,949,090	47,861,732	62,317,717
第6特定期間	1,213,918	14,599,751	48,931,884
第7特定期間	2,243,581	11,451,120	39,724,345
第8特定期間	1,071,287	9,139,785	31,655,847
第9特定期間	1,007,688	8,011,624	24,651,911
第10特定期間	63,795,108	2,582,576	85,864,443
第11特定期間	22,845,720	8,080,114	100,630,049
第12特定期間	2,527,022	29,376,609	73,780,462
第13特定期間	37,762,754	9,666,563	101,876,653
第14特定期間	387,124	2,701,853	99,561,924
第15特定期間	1,068,407	36,631,371	63,998,960

(注1) 第1特定期間の設定口数には、当初申込期間中の設定口数を含みます。

(注2) 設定口数、解約口数は、全て本邦内におけるものです。

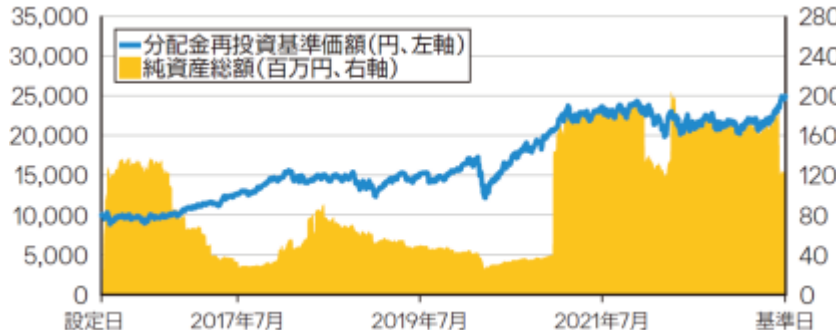
<参考情報>

最新の運用実績は、委託会社ホームページ（am.jpmorgan.com/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	2023年7月3日	設定日	2016年1月12日
純資産総額	124百万円	決算回数	年4回

日興JPM環太平洋ディスカバリー・ファンド（年4回決算型）

基準価額・純資産の推移



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

* 分配金再投資基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

期	年月	円
26期	2022年6月	0
27期	2022年9月	100
28期	2022年12月	100
29期	2023年3月	100
30期	2023年6月	100
	設定来累計	3,200

* 分配金は税引前1万口当たりの金額です。

ポートフォリオの構成状況

資産の種類	ファンド名	投資比率 1
アジア・オセアニアの株式	G I Mアジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド（適格機関投資家専用）	57.5%
北米の株式	J P モルガン・ファンズ・U S グロース・ファンド	30.8%
中南米の株式	J P モルガン・ファンズ・ラテン・アメリカ・エクイティ・ファンド	10.1%
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1.6%
合計（純資産総額）	-	100.0%

国（地域）別構成状況

投資国/地域 2	投資比率 3
アメリカ	29.0%
日本	18.2%
中国	10.1%
台湾	8.3%
韓国	6.7%
その他	24.6%

通貨別構成状況

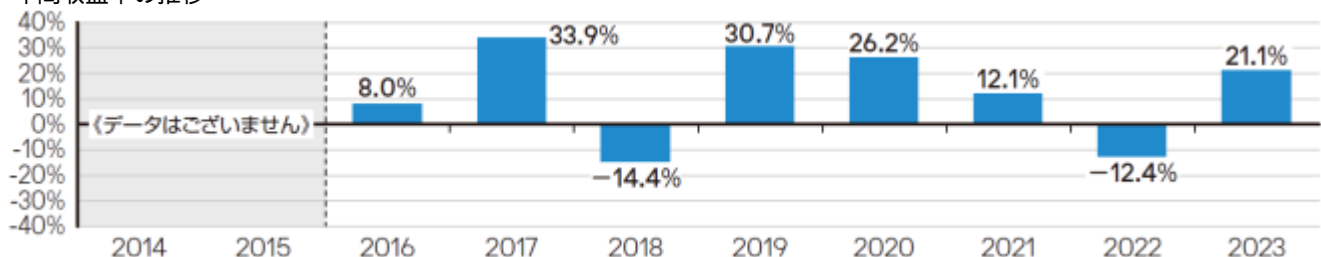
通貨	投資比率 3
米ドル	34.2%
日本円	18.2%
香港ドル	12.1%
新台幣ドル	8.3%
韓国ウォン	6.7%
その他	17.4%

業種別構成状況

業種 2	投資比率 3
情報技術	28.9%
金融	16.8%
一般消費財・サービス	14.3%
資本財・サービス	9.5%
コミュニケーション・サービス	8.7%
その他	17.7%

* 上記比率に投資先ファンドが保有する投資信託証券は含んでいません。

年間収益率の推移



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

* 2016年の年間収益率は設定日から年末営業日、2023年の年間収益率は前年末営業日から2023年7月3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。

* 当ページおよび次ページにおける「ファンド」は、日興JPM環太平洋ディスカバリー・ファンド（年4回決算型）です。

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

- 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おります。
- 国/地域はMSCI分類、業種はGICS11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、J.P.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。
- ファンドは投資先ファンドを通じて投資を行うため、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（G I Mアジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド（適格機関投資家専用）は2023年7月3日、それ以外の投資先ファンドは2023年6月最終営業日のもの）を使用しています。

組入上位銘柄

G I Mアジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド（適格機関投資家専用）

順位	銘柄名	投資国/地域 ^{*1}	通貨	業種 ^{*1}	投資比率 ^{*2}
1	台湾積体回路製造	台湾	新台幣ドル	情報技術	4.4%
2	サムスン電子	韓国	韓国ウォン	情報技術	3.6%
3	騰訊控股	中国	香港ドル	コミュニケーション・サービス	2.7%
4	ソニーグループ	日本	日本円	一般消費財・サービス	2.1%
5	友邦保険控股	香港	香港ドル	金融	1.8%
6	HDFC銀行	インド	インドルピー	金融	1.5%
7	バンク・セントラル・アジア	インドネシア	インドネシアルピア	金融	1.4%
8	香港取引所	香港	香港ドル	金融	1.3%
9	オリックス	日本	日本円	金融	1.2%
10	村田製作所	日本	日本円	情報技術	1.2%

J Pモルガン・ファンズ - USグロース・ファンド

順位	銘柄名	投資国/地域 ^{*1}	通貨	業種 ^{*1}	投資比率 ^{*2}
1	アップル	アメリカ	米ドル	情報技術	3.0%
2	マイクロソフト	アメリカ	米ドル	情報技術	3.0%
3	エヌビディア	アメリカ	米ドル	情報技術	1.7%
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	1.6%
5	アルファベット	アメリカ	米ドル	コミュニケーション・サービス	1.5%
6	メタ・プラットフォームズ	アメリカ	米ドル	コミュニケーション・サービス	1.3%
7	JPM USD リクイディティ・ファンド (Xクラス) ^{*3}	ルクセンブルク	米ドル	—	0.9%
8	テスラ	アメリカ	米ドル	一般消費財・サービス	0.8%
9	ネットフリックス	アメリカ	米ドル	コミュニケーション・サービス	0.8%
10	オラクル	アメリカ	米ドル	情報技術	0.7%

J Pモルガン・ファンズ - ラテン・アメリカ・エクイティ・ファンド

順位	銘柄名	投資国/地域 ^{*1}	通貨	業種 ^{*1}	投資比率 ^{*2}
1	ブラジル石油公社	ブラジル	米ドル	エネルギー	1.0%
2	イタウ・ユニバンコ・ホールディング	ブラジル	ブラジルリアル	金融	0.6%
3	ロカリザ・レンタカー	ブラジル	ブラジルリアル	資本財・サービス	0.5%
4	グルボ・フィナンシエロ・パノルテ	メキシコ	メキシコペソ	金融	0.5%
5	ウォルマート・デ・メヒコ	メキシコ	メキシコペソ	生活必需品	0.4%
6	ヴァーレ	ブラジル	ブラジルリアル	素材	0.4%
7	ウェグ	ブラジル	ブラジルリアル	資本財・サービス	0.4%
8	グルボ・アエロポルチュアリオ・デル・パシフィコ	メキシコ	メキシコペソ	資本財・サービス	0.3%
9	B3 SA-ブラジル・ボルサ・バルカオン	ブラジル	ブラジルリアル	金融	0.3%
10	グルボ・アエロポルタリオ・デル・スレステ	メキシコ	米ドル	資本財・サービス	0.3%

上記において、投資比率は表示単位以下を四捨五入して記載しています。

- 1 国/地域はMSCI分類、業種はGICS11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、J.P.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。
- 2 ファンドは投資先ファンドを通じて投資を行うため、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（G I Mアジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド（適格機関投資家専用）は2023年7月3日、それ以外の投資先ファンドは2023年6月最終営業日のもの）を使用しています。
- 3 流動性の高い短期金融商品を対象とするもので、現金の代替として組み入れています。

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ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15特定期間（2022年12月21日から2023年6月20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】

【日興 J P M 環太平洋ディスカバリー・ファンド（年 4 回決算型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	前期 (2022年12月20日現在)	当期 (2023年 6 月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	857,588	2,778,613
投資証券	73,172,856	49,881,197
親投資信託受益証券	92,234,739	61,306,309
未収入金	670	12,805,169
流動資産合計	166,265,853	126,771,288
資産合計	166,265,853	126,771,288
負債の部		
流動負債		
未払金	-	900,000
未払収益分配金	995,619	639,989
未払解約金	1,120	341,950
未払受託者報酬	23,244	22,863
未払委託者報酬	664,799	653,806
その他未払費用	9,268	9,113
流動負債合計	1,694,050	2,567,721
負債合計	1,694,050	2,567,721
純資産の部		
元本等		
元本	1,999,561,924	1,639,998,960
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	65,009,879	60,204,607
(分配準備積立金)	14,148,403	17,315,778
元本等合計	164,571,803	124,203,567
純資産合計	164,571,803	124,203,567
負債純資産合計	166,265,853	126,771,288

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	前期 (自 2022年 6 月21日 至 2022年12月20日)	当期 (自 2022年12月21日 至 2023年 6 月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	3,262,314	28,672,792
営業収益合計	3,262,314	28,672,792
営業費用		
受託者報酬	47,395	45,429
委託者報酬	1,355,490	1,299,164
その他費用	19,142	18,143
営業費用合計	1,422,027	1,362,736
営業利益又は営業損失()	1,840,287	27,310,056
経常利益又は経常損失()	1,840,287	27,310,056
当期純利益又は当期純損失()	1,840,287	27,310,056
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()	145,358	8,157,144
期首剰余金又は期首欠損金()	66,817,226	65,009,879
剰余金増加額又は欠損金減少額	276,682	817,984
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	276,682	817,984
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,787,901	23,150,318
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,787,901	23,150,318
分配金	1 1,991,057	1 1,625,850
期末剰余金又は期末欠損金()	65,009,879	60,204,607

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	当財務諸表対象期間
有価証券の評価基準および評価方法	<p>投資証券</p> <p>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と認められた場合は、当該金融商品取引所等における気配相場で評価しております。</p> <p>(2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3)時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>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。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

前期 (2022年12月20日現在)	当期 (2023年6月20日現在)
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当特定期間の翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	前期 (2022年12月20日現在)	当期 (2023年6月20日現在)
1期首元本額	101,876,653円	99,561,924円
期中追加設定元本額	387,124円	1,068,407円
期中一部解約元本額	2,701,853円	36,631,371円
受益権の総数	99,561,924口	63,998,960口
1口当たりの純資産額	1.6530円	1.9407円
(1万口当たりの純資産額)	(16,530円)	(19,407円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期	当期
	(自 2022年6月21日 至 2022年12月20日)	(自 2022年12月21日 至 2023年6月20日)
1 分配金の計算過程	(自 2022年6月21日 至 2022年9月20日)	(自 2022年12月21日 至 2023年3月20日)
費用控除後の配当等収益額	389,722円	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	57,925,130円	49,264,343円
分配準備積立金額	15,780,394円	13,919,983円
当ファンドの分配対象収益額	74,095,246円	63,184,326円
当ファンドの期末残存口数	99,543,897口	98,586,188口
1万口当たり収益分配対象額	7,443.47円	6,409.04円
1万口当たり分配金額	100.00円	100.00円
収益分配金金額	995,438円	985,861円
	(自 2022年9月21日 至 2022年12月20日)	(自 2023年3月21日 至 2023年6月20日)
費用控除後の配当等収益額	- 円	403,437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	9,205,114円
収益調整金額	50,861,476円	42,888,829円
分配準備積立金額	15,144,022円	8,347,216円
当ファンドの分配対象収益額	66,005,498円	60,844,596円
当ファンドの期末残存口数	99,561,924口	63,998,960口
1万口当たり収益分配対象額	6,629.59円	9,507.12円
1万口当たり分配金額	100.00円	100.00円
収益分配金金額	995,619円	639,989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、投資証券および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アジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド（適格機関投資家専用） 投資証券および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、投資証券および親投資信託受益証券と同様のリスクを伴います。投資証券および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、運用成果やリスク水準のチェック等を行います。 (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

	前期 (2022年12月20日現在)	当期 (2023年6月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価およびその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
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。	(1)有価証券 同左 (2)有価証券以外の金融商品 同左
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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 (2022年12月20日現在)	当期 (2023年6月20日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	5,300,682	9,993,460
親投資信託受益証券	916,664	7,632,947
合計	6,217,346	17,626,407

(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(2023年6月20日現在)

(イ) 株式

該当事項はありません。

(ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	JPM US GROWTH FUND I JPY CLASS		567.4	37,429,675	
		JPM LATIN AMERICA EQ I JPY		862.473	12,451,522	
	計	銘柄数:	2	1,429.873	49,881,197	
		組入時価比率:	40.2%		44.9%	
	小計				49,881,197	
親投資信託受益証券	日本円	G I Mアジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド(適格機関投資家専用)		22,656,532	61,306,309	
		計	銘柄数:	1	22,656,532	61,306,309
		組入時価比率:	49.4%		55.1%	
	小計				61,306,309	
	合計				111,187,506	

(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。

(注) 親投資信託受益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

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「JPM US GROWTH FUND I JPY CLASS」および「JPM LATIN AMERICA EQ I JPY」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「投資証券」は、これら投資証券であります。

これらの投資証券の状況は以下の通りであります。

以下に記載した情報は各ファンドの直近計算期間末における監査済財務諸表の抜粋であります。尚、これらは当ファンドの監査対象ではありません。

JPMorgan Funds - US Growth Fund

純資産計算書

2022年6月30日現在

	米ドル
資産	
投資有価証券取得原価	1,788,515,196
未実現利益/(損失)	(108,880,075)
時価	1,679,635,120
TBA証券への投資一時預託	—
現金預金およびブローカー預託	5,842,282
定期預金	—
証券売却未収入	6,635,174
投資有価証券売却未収入	—
TBA証券売却未収入	—
未収入配当	966,403
未収入利息	—
未収入還付税額	—
未収入報酬免除除	4,564
未収入報告報酬免除除	—
先物契約未実現利益	—
先物契約未実現利益	551,254
先物契約未実現利益	—
その他の資産	542,088
資産合計	1,694,176,885
負債	
当座借越	—
ブローカーに対する借入金	321
証券買戻未払	—
投資有価証券購入未払	2,874,876
TBA証券購入未払	—
未払利息	—
未払販売報	88,772
未払運用および顧問報酬	1,308,067
未払ファンド・サービス報酬	146,657
未払建オプシオン契約未実現損失	—
先物契約未実現損失	—
先物契約未実現損失	9,754,414
先物契約未実現損失	—
その他の負債	117,582
負債合計	14,290,689
純資産額合計	1,679,886,196

*その他の負債は主に取替債報酬、監査および財務関連報酬および費用、登録、発行、発送、印刷、法務ならびにマーケティング費用から構成されている。

JPMorgan Funds - Latin America Equity Fund

純資産計算書

2022年6月30日現在

	米ドル
資産	
投資有価証券取得原価	413,127,202
未実現利益/(損失)	(13,440,821)
時価	399,686,381
TBA証券への投資一時預託	—
現金預金およびブローカー預託	3,246,430
定期預金	—
証券売却未収入	446,653
投資有価証券売却未収入	—
TBA証券売却未収入	—
未収入配当	3,209,756
未収入利息	—
未収入還付税額	—
未収入報酬免除除	12,586
未収入報告報酬免除除	—
先物契約未実現利益	—
先物契約未実現利益	—
先物契約未実現利益	—
その他の資産	106
資産合計	406,601,911
負債	
当座借越	—
ブローカーに対する借入金	—
証券買戻未払	—
投資有価証券購入未払	450,203
TBA証券購入未払	—
未払利息	—
未払販売報	12,503
未払運用および顧問報酬	430,012
未払ファンド・サービス報酬	37,357
未払建オプシオン契約未実現損失	—
先物契約未実現損失	—
先物契約未実現損失	—
先物契約未実現損失	—
その他の負債	59,033
負債合計	989,108
純資産額合計	405,612,803

*その他の負債は主に取替債報酬、監査および財務関連報酬および費用、登録、発行、発送、印刷、法務ならびにマーケティング費用から構成されている。

JPMorgan Funds - US Growth Fund

損益および純資産変動計算書

2022年6月30日をもって終了する会計年度

	米ドル
期首現在純資産額	1,828,024,337
収益	
受取配当金、源泉徴収税控除後	10,711,912
投資有価証券からの受取利息、源泉徴収税控除後	(338)
スワップ契約にかかる受取利息	—
証券貸付取引収益	6,080
取銀引利息	701
その他の収益	—
収益合計	10,718,355

	米ドル
費用および顧問報酬	16,982,038
ファンド・サービス報酬	1,897,062
業續報酬	—
保管、支払代行、事務および所在地代行報酬	478,493
販売報酬	1,399,527
登録および名義書換代行報酬	249,443
税金	625,668
支払配当金、源泉徴収税控除後	—
銀行およびその他の支払利息	—
スワップ契約にかかる支払利息	—
その他の費用*	384,202
控除：報酬免除額	(106,752)
費用合計	21,910,681
投資純利益（損失）	(11,192,326)

投資有価証券売却実現純利益（損失）	57,359,355
TBA証券実現純利益（損失）	—
オプション契約実現純利益（損失）	—
金融先物契約実現純利益（損失）	—
先渡し為替契約実現純利益（損失）	(49,123,731)
スワップ契約実現純利益（損失）	—
為替差実現純利益（損失）	(27,587)
当期実現純利益（損失）	8,208,037
投資有価証券未実現評価益（損）純増減	(525,595,125)
TBA証券未実現評価益（損）純増減	—
オプション契約未実現評価益（損）純増減	—
金融先物契約未実現評価益（損）純増減	—
先渡し為替契約未実現評価益（損）純増減	(1,127,990)
スワップ契約未実現評価益（損）純増減	—
為替差未実現評価益（損）純増減	540,064
当期末実現評価益（損）純増減	(526,183,051)
事業活動による純資産増減	(529,167,340)

設定	1,599,766,020
解約	(1,218,700,240)
資本の増減による純資産増減	381,065,780
支払配当金	(36,581)
期末現在純資産額	1,679,886,196

*その他の費用は主に取締役報酬、監査および税務関連費用、金銭、発行、発送、印刷、法務ならびにマーケティング費用から構成されている。

JPMorgan Funds - Latin America Equity Fund

損益および純資産変動計算書

2022年6月30日をもって終了する会計年度

	米ドル
期首現在純資産額	634,190,440
収益	
受取配当金、源泉徴収税控除後	33,051,487
投資有価証券からの受取利息、源泉徴収税控除後	—
スワップ契約にかかる受取利息	—
証券貸付取引収益	—
取銀引利息	—
その他の収益	—
収益合計	33,051,487

	米ドル
費用および顧問報酬	5,632,380
ファンド・サービス報酬	515,012
業續報酬	—
保管、支払代行、事務および所在地代行報酬	444,848
販売報酬	168,453
登録および名義書換代行報酬	150,528
税金	185,597
支払配当金、源泉徴収税控除後	—
銀行およびその他の支払利息	633
スワップ契約にかかる支払利息	—
その他の費用*	164,835
控除：報酬免除額	(236,949)
費用合計	7,025,337
投資純利益（損失）	26,026,150

投資有価証券売却実現純利益（損失）	3,683,727
TBA証券実現純利益（損失）	—
オプション契約実現純利益（損失）	—
金融先物契約実現純利益（損失）	—
先渡し為替契約実現純利益（損失）	136
スワップ契約実現純利益（損失）	—
為替差実現純利益（損失）	(244,336)
当期実現純利益（損失）	3,439,527
投資有価証券未実現評価益（損）純増減	(175,190,766)
TBA証券未実現評価益（損）純増減	—
オプション契約未実現評価益（損）純増減	—
金融先物契約未実現評価益（損）純増減	—
先渡し為替契約未実現評価益（損）純増減	—
スワップ契約未実現評価益（損）純増減	—
為替差未実現評価益（損）純増減	(66,449)
当期末実現評価益（損）純増減	(175,257,215)
事業活動による純資産増減	(145,791,538)

設定	256,428,237
解約	(337,917,870)
資本の増減による純資産増減	(81,489,633)
支払配当金	(1,296,466)
期末現在純資産額	405,612,803

*その他の費用は主に取締役報酬、監査および税務関連費用、金銭、発行、発送、印刷、法務ならびにマーケティング費用から構成されている。

JPMorgan Funds - US Growth Fund

投資有価証券明細表

2022年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める	
			時価 (米ドル)	割合 (%)				時価 (米ドル)	割合 (%)
証券取引所に上場を承認されている譲渡性有価証券および短期金融市場商品					Freeport-McMoRan, Inc.	USD	741,210	21,893,892	1.30
株式					HCA Healthcare, Inc.	USD	140,858	23,511,688	1.40
カナダ					HubSpot, Inc.	USD	2,520	737,806	0.04
Shopify, Inc. 'A'	USD	3,800	119,415	0.01	International Business Machines Corp.	USD	64,760	9,045,677	0.54
			119,415	0.01	Intuit, Inc.	USD	43,790	16,582,397	0.99
アイルランド					Intuitive Surgical, Inc.	USD	58,070	11,508,893	0.69
Trane Technologies plc	USD	111,052	14,254,079	0.85	Lam Research Corp.	USD	23,500	9,775,060	0.58
			14,254,079	0.85	Lowe's Cos., Inc.	USD	280,302	44,795,371	2.67
オランダ					Marriott International, Inc. 'A'	USD	139,520	18,695,680	1.11
ASML Holding NV, NYRS	USD	34,821	11,566,214	0.69	Match Group, Inc.	USD	26,519	1,808,065	0.11
			11,566,214	0.69	McKesson Corp.	USD	148,046	48,245,971	2.87
アメリカ					MercadoLibre, Inc.	USD	950	586,905	0.04
AbbVie, Inc.	USD	427,010	64,941,816	3.87	Meta Platforms, Inc. 'A'	USD	48,040	7,678,233	0.46
ABIOMED, Inc.	USD	10,390	2,593,760	0.15	Microsoft Corp.	USD	625,250	158,283,680	9.48
Advanced Micro Devices, Inc.	USD	327,580	25,048,405	1.49	Moderna, Inc.	USD	10,140	1,395,467	0.08
Airbnb, Inc. 'A'	USD	4,010	352,238	0.02	MongoDB, Inc.	USD	12,100	3,116,900	0.19
Amylin Pharmaceuticals, Inc.	USD	6,850	993,146	0.06	Monster Beverage Corp.	USD	104,260	9,570,025	0.57
Alphabet, Inc. 'C'	USD	54,408	117,966,337	7.02	Morgan Stanley	USD	256,170	19,202,503	1.14
Amazon.com, Inc.	USD	323,480	33,476,751	1.99	MSCI, Inc.	USD	11,430	4,602,575	0.27
Angen, Inc.	USD	91,370	22,090,525	1.32	NVIDIA Corp.	USD	227,826	34,238,830	2.04
Amphenol Corp. 'A'	USD	285,300	18,100,859	1.08	Oracle Corp.	USD	537,430	36,832,765	2.19
Apple, Inc.	USD	1,214,400	163,997,307	9.76	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	USD	56,020	32,916,792	1.96
AutoZone, Inc.	USD	25,773	54,847,264	3.27	Rockwell Automation, Inc.	USD	64,691	12,684,288	0.76
Blackstone Group, Inc. (The) 'A'	USD	381,270	33,465,974	1.99	Salesforce, Inc.	USD	88,540	14,351,449	0.85
Block, Inc. 'A'	USD	9,250	553,798	0.03	Seagen, Inc.	USD	80,187	14,220,363	0.85
Capital One Financial Corp.	USD	67,780	6,898,987	0.41	Sherwin-Williams Co. (The)	USD	65,090	14,308,084	0.85
Carvana Co.	USD	12,640	276,816	0.02	Snap, Inc. 'A'	USD	28,050	365,632	0.02
Charles Schwab Corp. (The)	USD	519,330	31,034,542	1.89	SVB Financial Group	USD	54,204	20,523,532	1.22
Chipotle Mexican Grill, Inc.	USD	9,590	12,339,117	0.73	Synopsys, Inc.	USD	75,130	22,685,504	1.35
Coca-Cola Co. (The)	USD	895,590	50,321,179	3.00	Tapestry, Inc.	USD	296,970	8,906,130	0.53
Cognizant Technology Solutions Corp. 'A'	USD	257,940	17,306,484	1.03	Target Corp.	USD	87,781	12,079,543	0.72
ConocoPhillips	USD	374,440	33,898,053	2.02	Tesla, Inc.	USD	96,790	65,195,808	3.88
CVS Health Corp.	USD	307,380	28,557,139	1.70	Texas Instruments, Inc.	USD	185,408	15,946,122	0.95
Deere & Co.	USD	158,588	46,776,324	2.78	Thermo Fisher Scientific, Inc.	USD	12,810	6,820,941	0.41
Dexcom, Inc.	USD	97,148	7,303,038	0.43	Trade Desk, Inc. (The) 'A'	USD	15,600	633,204	0.04
Eli Lilly & Co.	USD	95,320	30,770,726	1.83	United Parcel Service, Inc. 'B'	USD	159,422	28,430,522	1.69
Enphase Energy, Inc.	USD	16,546	3,050,348	0.18	UnitedHealth Group, Inc.	USD	37,660	19,325,229	1.15
Equifax, Inc.	USD	50,587	10,421,163	0.62	Verisk Analytics, Inc.	USD	113,805	19,351,402	1.15
Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	USD	44,536	11,136,895	0.66	Wayfair, Inc. 'A'	USD	4,450	197,936	0.01
Etsy, Inc.	USD	16,250	1,157,894	0.07	Workday, Inc. 'A'	USD	18,040	2,512,701	0.15
Exact Sciences Corp.	USD	43,781	1,094,763	0.10					
					株式合計			1,626,514,013	96.82
					証券取引所に上場を承認されている			1,652,453,721	98.37
					譲渡性有価証券および短期金融市場商品合計				98.37

JPMorgan Funds - US Growth Fund

投資有価証券明細表(続き)

2022年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価(米ドル)	純資産に 占める 割合(%)	2022年6月30日現在の 投資有価証券の地域別内訳	純資産に 占める割合(%)
UCITSと認められたユニットまたは他の集団投資事業					アメリカ	96.82
集団投資スキーム - UCITS					ルクセンブルク	1.62
ルクセンブルク					アイルランド	0.85
JPMorgan US Liquidity DMO Fund - JPM US Liquidity DMO F (dist.) †	USD	27,181,399	27,181,399	1.62	オランダ	0.69
					カナダ	0.01
			27,181,399	1.62	投資有価証券合計	99.99
集団投資スキーム - UCITS合計			27,181,399	1.62	現金およびその他資産/(負債)	0.01
UCITSと認められたユニットまたは他の集団投資事業合計			27,181,399	1.62	合計	100.00
投資有価証券合計			1,679,635,120	99.99		
現金			5,841,961	0.35		
その他の資産/(負債)			(5,590,885)	0.34		
純資産合計			1,679,886,196	100.00		

† 利害関係人のファンド

JPMorgan Funds - US Growth Fund
 投資有価証券明細表(続き)
 2022年6月30日現在
 先渡為替契約明細表

買建通貨	買建額	売建通貨	売建額	満期日	カウンター パーティー	未実現損益 (米ドル)	純資産に 占める割合(%)
JPY	90,632,470	USD	666,576	05/07/2022	BNP Paribas	375	—
JPY	21,347,404	USD	157,067	03/08/2022	BNP Paribas	308	—
JPY	37,200,000	USD	273,711	03/08/2022	RBC	531	—
USD	117,963	EUR	112,226	01/07/2022	State Street	1,061	—
USD	2,050,923	EUR	1,934,215	05/07/2022	Barclays	35,983	—
USD	4,850,304	EUR	4,614,015	05/07/2022	BNP Paribas	43,721	—
USD	4,809,436	EUR	4,487,265	05/07/2022	RBC	134,892	0.01
USD	21,615,047	EUR	20,580,292	05/07/2022	State Street	175,830	0.01
USD	2,684,342	EUR	2,505,665	05/07/2022	Toronto-Dominion Bank	74,102	0.01
USD	65,336	EUR	62,646	06/07/2022	State Street	71	—
USD	1,140	EUR	1,080	03/08/2022	Barclays	12	—
USD	2,225	EUR	2,098	03/08/2022	Standard Chartered	36	—
USD	10,766	EUR	10,231	03/08/2022	State Street	87	—
USD	1,572,659	JPY	210,794,195	05/07/2022	Barclays	21,455	—
USD	960,483	JPY	131,512,787	05/07/2022	BNP Paribas	12,699	—
USD	598,260	JPY	80,366,858	05/07/2022	HSBC	6,852	—
USD	397,358	JPY	53,060,699	05/07/2022	Merrill Lynch	6,743	—
USD	626,672	JPY	80,276,674	05/07/2022	RBC	35,934	—
USD	135,626	JPY	18,321,057	03/08/2022	BNP Paribas	562	—
先渡為替契約未実現利益合計						551,254	0.03
EUR	215,872,340	USD	231,306,392	05/07/2022	Barclays	(6,424,550)	(0.38)
EUR	2,791,599	USD	2,996,280	05/07/2022	BNP Paribas	(88,173)	(0.01)
EUR	6,989,772	USD	7,398,723	05/07/2022	Citibank	(117,231)	(0.01)
EUR	7,612,638	USD	8,180,421	05/07/2022	RBC	(250,068)	(0.02)
EUR	2,807,244	USD	2,996,575	05/07/2022	Standard Chartered	(71,170)	—
EUR	6,895,497	USD	7,429,570	05/07/2022	State Street	(246,287)	(0.02)
EUR	209,835,990	USD	219,551,051	03/08/2022	BNP Paribas	(523,203)	(0.03)
EUR	8,961,165	USD	9,489,254	03/08/2022	Citibank	(135,545)	(0.01)
EUR	3,124	USD	3,270	03/08/2022	RBC	(8)	—
EUR	69,043	USD	72,986	03/08/2022	Standard Chartered	(919)	—
EUR	423,369	USD	447,015	03/08/2022	State Street	(5,101)	—
JPY	3,648,987,507	USD	28,603,032	05/07/2022	Barclays	(1,750,651)	(0.10)
JPY	116,168,703	USD	905,289	05/07/2022	BNP Paribas	(50,420)	—
JPY	94,661,374	USD	744,599	05/07/2022	Merrill Lynch	(47,999)	—
JPY	25,000,000	USD	185,411	05/07/2022	RBC	(2,440)	—
JPY	88,544,312	USD	676,776	05/07/2022	State Street	(25,191)	—
JPY	87,652,031	USD	648,499	03/08/2022	BNP Paribas	(2,322)	—
JPY	21,145,324	USD	156,999	03/08/2022	HSBC	(1,113)	—
JPY	45,144,455	USD	333,184	03/08/2022	Merrill Lynch	(375)	—
USD	6,786,866	EUR	6,512,682	03/08/2022	BNP Paribas	(11,104)	—
USD	273,190	JPY	37,200,000	01/07/2022	RBC	(544)	—
先渡為替契約未実現損失合計						(9,754,414)	(0.58)
先渡為替契約未実現純損失						(9,203,160)	(0.55)

JPMorgan Funds - Latin America Equity Fund

投資有価証券明細表

2022年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	純資産に占める		投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に占める		
			時価 (米ドル)	割合 (%)					時価 (米ドル)	割合 (%)	
証券取引所に上場を承認されている譲渡性有価証券および短期金融市場商品					コロンビア						
株式					Ecopetrol SA	COP	5,660,518	3,122,794	0.77		
ベミュューダ								3,122,794	0.77		
Credicorp Ltd.	USD	99,899	11,858,511	2.92							
			11,858,511	2.92	ルクセンブルク						
					Globant SA	USD	55,014	9,458,832	2.33		
								9,458,832	2.33		
ブラジル											
Ambev SA	BRL	1,491,532	3,826,152	0.94							
Atacadão SA	BRL	1,130,147	3,540,248	0.87	メキシコ						
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	BRL	6,593,699	13,675,941	3.37	America Movil SAB de CV, ADR 'L'	USD	549,702	11,046,262	2.73		
Banco Bradesco SA, ADR Preference	USD	5,580,053	18,107,272	4.46	Becle SAB de CV	MXN	946,765	2,062,266	0.51		
Banco BTG Pactual SA	BRL	1,098,232	4,598,529	1.13	Bolsa Mexicana de Valores SAB de CV	MXN	4,256,780	7,620,715	1.88		
Banco do Brasil SA	BRL	706,954	4,382,041	1.08	Corp. Inmobiliaria Vesta SAB de CV	MXN	2,596,230	4,823,812	1.19		
Blau Farmaceutica SA	BRL	691,757	3,190,202	0.79	Genoma Lab Internacional SAB de CV	MXN	1,198,275	1,209,499	0.30		
Bradespar SA Preference	BRL	1,289,106	6,329,084	1.56	'g'						
Caixa Seguridade Participacoes SA	BRL	2,318,422	3,074,075	0.76	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV	MXN	415,116	2,710,982	0.67		
Centrais Eletricas Brasileiras SA	BRL	554,244	4,805,544	1.19	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV 'b'	MXN	877,209	12,422,854	3.06		
EDP - Energias do Brasil SA	BRL	1,771,663	6,885,198	1.69	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV, ADR	USD	71,596	14,266,219	3.52		
Gerdau SA, ADR Preference	USD	409,076	1,744,709	0.43	Grupo Financiero Banorte SAB de CV 'v'	MXN	3,225,824	17,794,949	4.39		
Itau Unibanco Holding SA Preference	BRL	5,330,157	23,059,228	5.69	Grupo Mexico SAB de CV	MXN	1,671,962	7,048,574	1.74		
Itausa SA Preference	BRL	4,960,035	7,964,723	1.96	Grupo Televisa SAB	MXN	1,268,074	2,117,157	0.52		
Localiza Rent a Car SA	BRL	1,375,335	13,678,992	3.37	ISA Administradora Industrial S de RL de CV, IRIIT	MXN	990,862	1,285,828	0.31		
Lojas Renner SA	BRL	2,360,017	9,895,367	2.44	Qualitas Controladora SAB de CV	MXN	639,993	2,880,674	0.71		
LPS Brasil Consultoria de Investis SA	BRL	496,116	341,310	0.06	Regional SAB de CV	MXN	1,700,964	8,019,614	1.98		
Petrobras Brasileiro SA, ADR Preference	USD	3,134,803	33,551,900	8.27	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	MXN	5,552,802	18,790,267	4.63		
Petrobras Brasileiro SA Preference	BRL	397,342	2,100,968	0.52				114,099,582	28.13		
Porto Seguro SA	BRL	738,391	3,490,167	0.86	パナマ						
Raia Drogasil SA	BRL	2,054,253	7,447,933	1.84	Copa Holdings SA 'A'	USD	103,185	6,232,374	1.54		
Rede D' Or Sao Luis SA, Reg. S	BRL	194,746	1,061,243	0.26	Intercep Financial Services, Inc.	USD	108,489	2,452,956	0.60		
Rumo SA	BRL	1,170,318	3,574,740	0.88				8,685,316	2.14		
TOTVS SA	BRL	562,656	2,433,617	0.60	アメリカ						
Transmissora Alamosa de Energia Eletrica SA	BRL	164,189	1,199,365	0.30	MercadoLibre, Inc.	USD	8,842	5,462,543	1.35		
Vale SA	BRL	2,378,430	35,043,231	8.64				5,462,543	1.35		
WEG SA	BRL	2,535,339	12,522,487	3.09	英ヴァージン諸島						
Wilson Sons Holdings Brasil SA	BRL	1,491,210	2,212,870	0.55	Aeros Doreados Holdings, Inc. 'A'	USD	328,952	2,138,833	0.53		
			232,617,136	57.35				2,138,833	0.53		
ケイマン諸島											
XP, Inc.	BRL	96,125	1,668,998	0.41	株式合計						
XP, Inc. 'A'	USD	98,567	1,711,123	0.42				396,030,650	97.86		
			3,389,121	0.83	証券取引所に上場を承認されている譲渡性有価証券および短期金融市場商品合計						
								396,030,650	97.86		
チリ											
Banco Santander Chile, ADR	USD	377,732	6,106,038	1.51							
			6,106,038	1.51							

JPMorgan Funds - Latin America Equity Fund

投資有価証券明細表(続き)

2022年6月30日現在

投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に占める割合 (%)	2022年6月30日現在の投資有価証券の地域別内訳	純資産に占める割合 (%)
UCITSと認められたユニットまたは他の集団投資事業					ブラジル	57.35
集団投資スキーム - UCITS					メキシコ	28.13
ルクセンブルク					ルクセンブルク	3.01
JPMorgan USD Liquidity DMMF Fund - JPM USD Liquidity DMMF J (dist.) †	USD	2,755,731	2,755,731	0.68	バミューダ	2.92
					パナマ	2.14
			2,755,731	0.68	チリ	1.51
集団投資スキーム - UCITS合計			2,755,731	0.68	アメリカ	1.35
UCITSと認められたユニットまたは他の集団投資事業合計			2,755,731	0.68	ケイマン諸島	0.83
投資有価証券合計			399,686,981	98.54	コロンビア	0.77
現金			3,246,430	0.80	英ヴァージン諸島	0.53
その他の資産 / (負債)			2,679,992	0.66	投資有価証券合計	98.54
純資産合計			405,612,803	100.00	現金およびその他の資産 / (負債)	1.46
					合計	100.00

† 利害関係人のファンド

JPMorgan Funds - US Growth I

直近計算期間におけるTER(総費用率)

2022年6月30日現在

0.75%

(注) TER(総費用率)は、運用にかかる費用の合計をファンドの純資産の日次平均に対する比率で表したものです。

運用にかかる費用の合計には、運用および顧問報酬、保管報酬、税金、その他費用が含まれております。

当座貸越利息と実績報酬は計算対象から除いております。

(注) 1万口当たりの費用明細が取得できないため、TER(総費用率)を表示しています。

JPMorgan Funds - Latin America Equity I

直近計算期間におけるTER(総費用率)

2022年6月30日現在

1.01%

（参考）

当ファンドは「G I Mアジア・オセアニア・ディスカバリー・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アジア・オセアニア・ディスカバリー・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	(2022年12月20日現在)	(2023年6月20日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		96,696,262	96,995,644
金銭信託		49,258,485	29,606,182
株式		4,711,120,139	5,001,263,526
未収入金		-	28,220,234
未収配当金		1,935,206	19,117,227
流動資産合計		4,859,010,092	5,175,202,813
資産合計		4,859,010,092	5,175,202,813
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	87,347
未払金		-	29,196,576
未払解約金		4,967	34,780,856
流動負債合計		4,967	64,064,779
負債合計		4,967	64,064,779
純資産の部			
元本等			
元本	1	2,046,113,659	1,888,912,393
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		2,812,891,466	3,222,225,641
元本等合計		4,859,005,125	5,111,138,034
純資産合計		4,859,005,125	5,111,138,034
負債純資産合計		4,859,010,092	5,175,202,813

（注）「G I Mアジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド（適格機関投資家専用）」の計算期間は、毎年12月21日から翌年12月20日まで（計算期間終了日が休業日の場合は、その翌営業日まで）であり、当ファンドの特定期間と異なります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	当財務諸表対象期間
1. 有価証券の評価基準および評価方法	<p>株式 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として認められた場合は、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礎となる事項	<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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

(2022年12月20日現在)	(2023年6月20日現在)
当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区分	(2022年12月20日現在)	(2023年6月20日現在)
1期首元本額	2,126,834,770円	2,046,113,659円
期中追加設定元本額	1,957,205円	1,444,138円
期中解約元本額	82,678,316円	158,645,404円
元本の内訳（注）		
日興JPM環太平洋ディスカバリー・ファンド	2,007,273,073円	1,866,255,861円
日興JPM環太平洋ディスカバリー・ファンド（年4回決算型）	38,840,586円	22,656,532円
合計	2,046,113,659円	1,888,912,393円
受益権の総数	2,046,113,659口	1,888,912,393口
1口当たりの純資産額 （1万口当たりの純資産額）	2.3747円 (23,747円)	2.7059円 (27,059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、運用成果やリスク水準のチェック等を行います。 (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

	(2022年12月20日現在)	(2023年6月20日現在)
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	同左
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 該当事項はありません。 (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。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)有価証券およびデリバティブ取引以外の金融商品 同左
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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(2022年12月20日現在)	(2023年6月20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	579,645,770	421,460,933
合計	579,645,770	421,460,933

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

区分	種類	(2022年12月20日現在)				(2023年6月20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	-	-	-	-	26,827,546	-	26,914,893	87,347
合計		-	-	-	-	26,827,546	-	26,914,893	87,347

(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(2023年6月20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	
日本円	アサヒグループホールディングス	5,600	5,591.00	31,309,600		
	信越化学工業	14,500	4,803.00	69,643,500		
	日本酸素ホールディングス	14,000	3,138.00	43,932,000		
	日本ペイントホールディングス	42,700	1,206.50	51,517,550		
	タカラバイオ	17,400	1,660.00	28,884,000		
	ユニ・チャーム	4,500	5,348.00	24,066,000		
	第一三共	15,100	4,737.00	71,528,700		
	ブリヂストン	10,100	5,915.00	59,741,500		
	三和ホールディングス	20,400	1,827.00	37,270,800		
	三浦工業	6,700	3,685.00	24,689,500		
	ダイキン工業	2,200	29,345.00	64,559,000		
	日立製作所	6,000	8,747.00	52,482,000		
	ソニーグループ	13,800	13,735.00	189,543,000		
	キーエンス	1,300	69,820.00	90,766,000		
	ファナック	10,800	5,205.00	56,214,000		
	村田製作所	12,600	8,394.00	105,764,400		
	東京エレクトロン	3,300	20,000.00	66,000,000		
	デンソー	4,000	9,396.00	37,584,000		
	テルモ	15,900	4,719.00	75,032,100		
	HOYA	3,900	17,300.00	67,470,000		
	任天堂	5,000	6,242.00	31,210,000		
	スクウェア・エニックス・ホールディングス	3,100	7,540.00	23,374,000		
	伊藤忠商事	11,000	5,712.00	62,832,000		
	ニトリホールディングス	2,900	16,600.00	48,140,000		
	東京海上ホールディングス	17,200	3,226.00	55,487,200		
	オリックス	40,700	2,485.00	101,139,500		
	リクルートホールディングス	11,900	4,755.00	56,584,500		
小計	銘柄数:	27		1,626,764,850		
	組入時価比率:	31.8%		32.6%		
アメリカドル	KANZHUN LTD-ADR	19,492	17.23	335,847.16		
	SEA LIMITED-ADR	2,079	62.08	129,064.32		
小計	銘柄数:	2		464,911.48		
				(66,124,359)		
	組入時価比率:	1.3%		1.3%		
香港ドル	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	16,500	84.75	1,398,375.00		
	HAIER SMART HOME CO LTD-H	85,600	24.40	2,088,640.00		
	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	43,300	78.15	3,383,895.00		
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	64,000	52.50	3,360,000.00		
	MEITUAN-CLASS B	41,090	137.00	5,629,330.00		
	TRIPCOM GROUP LTD	10,350	281.40	2,912,490.00		
	YUM CHINA HOLDINGS INC	5,800	464.40	2,693,520.00		
	TENCENT HOLDINGS LIMITED	38,700	357.20	13,823,640.00		
	WUXI BIOLOGICS(CAYMAN) INC	77,000	46.70	3,595,900.00		
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	20,900	313.20	6,545,880.00		
	AIA GROUP LTD	105,000	82.10	8,620,500.00		
	PRUDENTIAL PLC	17,150	112.40	1,927,660.00		
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES	119,000	39.90	4,748,100.00		
	小計	銘柄数:	13		60,727,930.00	
					(1,105,248,326)	
	組入時価比率:	21.6%		22.1%		
シンガポールドル	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	50,500	9.54	481,770.00		
小計	銘柄数:	1		481,770.00		
				(51,106,161)		

	組入時価比率：	1.0%		1.0%
タイバーツ	AIRPORTS OF THAILAND PUBLIC COMPANY-NVDR	174,400	71.50	12,469,600.00
小計	銘柄数：	1		12,469,600.00
				(51,000,664)
	組入時価比率：	1.0%		1.0%
インドネシアルピア	PT UNILEVER INDONESIA TBK	349,600	4,380.00	1,531,248,000.00
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSERO TBK PT	1,710,407	5,525.00	9,449,998,675.00
	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	1,333,800	9,000.00	12,004,200,000.00
小計	銘柄数：	3		22,985,446,675.00
				(218,361,743)
	組入時価比率：	4.3%		4.4%
韓国ウォン	LG CHEM LTD	970	752,000.00	729,440,000.00
	AFREECATV CO LTD	2,401	77,500.00	186,077,500.00
	NC SOFT CORPORATION	932	302,000.00	281,464,000.00
	ORION CORP OF REPUBLIC OF KOREA	1,937	122,500.00	237,282,500.00
	LG H AND H CO LTD	834	514,000.00	428,676,000.00
	HUGEL INC	336	101,600.00	34,137,600.00
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	39,032	71,200.00	2,779,078,400.00
	SK HYNIX INC	6,990	114,800.00	802,452,000.00
小計	銘柄数：	8		5,478,608,000.00
				(607,577,627)
	組入時価比率：	11.9%		12.1%
新台湾ドル	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	21,000	496.00	10,416,000.00
	CHAILLEASE HOLDING CO LTD	48,836	207.00	10,109,052.00
	ADVANTECH CO LTD	30,000	419.50	12,585,000.00
	DELTA ELECTRONICS INC	66,000	375.50	24,783,000.00
	LARGAN PRECISION COMPANY LIMITED	5,000	2,150.00	10,750,000.00
	WIWYNN CORPORATION	5,000	1,215.00	6,075,000.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	143,540	583.00	83,683,820.00
小計	銘柄数：	7		158,401,872.00
				(730,137,588)
	組入時価比率：	14.3%		14.6%
インドルピー	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	43,200	364.50	15,746,400.00
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,803	9,532.00	17,186,196.00
	HDFC BANK LTD	42,855	1,604.15	68,745,848.25
	KOTAK MAHINDRA BANK LIMITED	11,497	1,824.55	20,976,851.35
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	11,052	2,654.80	29,340,849.60
	HDFC LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	36,092	626.55	22,613,442.60
	INFOSYS LIMITED	28,569	1,294.00	36,968,286.00
小計	銘柄数：	7		211,577,873.80
				(370,261,279)
	組入時価比率：	7.2%		7.4%
オフショア元	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD-A	50,470	52.70	2,659,769.00
	ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIAL-A	67,800	21.08	1,429,224.00
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD COMPA-A	52,080	50.41	2,625,352.80
	KWEI CHOW MOUTAI CO LTD-A	1,200	1,744.00	2,092,800.00
小計	銘柄数：	4		8,807,145.80
				(174,680,929)
	組入時価比率：	3.4%		3.5%
合計				5,001,263,526
				(3,374,498,676)

(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

該当事項はありません。

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】

(2023年7月3日現在)

種類	金額	単位
資産総額	124,736,098	円
負債総額	106,225	円
純資産総額(-)	124,629,873	円
発行済口数	64,043,549	口
1口当たり純資産額(/)	1.9460	円

(参考) G I Mアジア・オセアニア・ディスカバリー・マザーファンド(適格機関投資家専用)

(2023年7月3日現在)

種類	金額	単位
資産総額	5,017,074,273	円
負債総額	15,597,264	円
純資産総額(-)	5,001,477,009	円
発行済口数	1,864,521,947	口
1口当たり純資産額(/)	2.6824	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（2023年1月末現在）

（略）

（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、2023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。

< 訂正後 >

資本金の額（2023年7月末現在）

（略）

（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、2023年7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】

届出書「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況」について、以下の内容に更新・訂正されます。

< 更新・訂正後 >

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

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

委託会社が設定・運用している投資信託は、2023年7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	54	761,139
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	73	4,716,296
総合計	127	5,477,435
親投資信託	47	-

(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33期事業年度（2022年4月1日から2023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せん。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第32期 (2022年 3 月31日)	第33期 (2023年 3 月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	18,159,513	17,854,232
前払費用	14,017	10,057
未収入金	18,237	1,077
未収委託者報酬	1,938,156	1,906,906
未収収益	956,791	1,148,869
関係会社短期貸付金	1,000,000	100,000
その他	14,727	280
流動資産合計	22,101,444	21,021,423
固定資産		
有形固定資産		
器具備品	21,892	-
器具備品減価償却累計額	16,377	-
有形固定資産計	5,514	-
投資その他の資産		
関係会社株式	60,000	60,000
投資有価証券	2,343,640	548,702
敷金保証金	76,522	33,657
前払年金費用	189,042	212,429
繰延税金資産	891,939	877,589
その他	5,500	5,500
投資その他の資産合計	3,566,646	1,737,878
固定資産合計	3,572,160	1,737,878
資産合計	25,673,604	22,759,301

(単位：千円)

	第32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	172,706	172,530
未払金	3,043,065	1,496,536
未払手数料	900,327	859,337
その他未払金	2,142,738	637,198
未払費用	154,360	159,983
未払法人税等	582,160	331,240
賞与引当金	924,994	867,476
役員賞与引当金	54,793	53,851
流動負債合計	4,932,080	3,081,619
固定負債		
長期未払金	259,178	234,648
賞与引当金	743,912	729,216
役員賞与引当金	128,761	114,927
固定負債合計	1,131,851	1,078,793
負債合計	6,063,932	4,160,412
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,218,000	2,218,000
資本剰余金		
資本準備金	1,000,000	1,000,000
資本剰余金合計	1,000,000	1,000,000
利益剰余金		
利益準備金	33,676	33,676
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	16,475,344	15,347,039
利益剰余金合計	16,509,020	15,380,716
株主資本合計	19,727,020	18,598,716
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	117,348	173
評価・換算差額等合計	117,348	173
純資産合計	19,609,672	18,598,889
負債・純資産合計	25,673,604	22,759,301

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	11,638,721	10,324,813
運用受託報酬	7,817,385	7,542,468
業務受託報酬	2,379,908	2,566,610
その他営業収益	132,493	240,482
営業収益合計	21,968,508	20,674,375
営業費用		
支払手数料	5,885,809	5,189,809
広告宣伝費	105,330	146,804
調査費	1,887,761	1,909,927
委託調査費	1,597,303	1,562,850
調査費	273,818	333,567
図書費	16,638	13,508
委託計算費	263,612	256,679
営業雑経費	182,365	161,211
通信費	8,534	12,491
印刷費	138,892	109,847
協会費	34,938	38,873
営業費用合計	8,324,879	7,664,433
一般管理費		
給料	5,437,200	5,188,544
役員報酬及び賞与	325,451	321,404
給料・手当	2,845,134	3,037,732
賞与	1,166,857	1,012,802
賞与引当金繰入額	1,021,409	750,056
役員賞与引当金繰入額	78,348	66,548
福利厚生費	373,895	376,603
交際費	12,247	7,936
寄付金	10,608	10,261
旅費交通費	3,585	96,976
租税公課	152,691	135,661
不動産関連費用	1,074,147	1,097,659
退職給付費用	179,059	202,450
退職金	48,776	133,286
消耗器具備品費	10,588	19,816
事務委託費	214,091	183,364
関係会社等配賦経費	2,065,052	2,394,646
減価償却費	3,532	294
諸経費	89,441	79,798
一般管理費合計	9,674,918	9,927,302
営業利益	3,968,710	3,082,640

(単位：千円)

	第32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	24	25
投資有価証券売却益	0	33
受取利息	5,171	2,269
その他営業外収益	11,371	29,202
営業外収益合計	16,567	31,530
営業外費用		
投資有価証券売却損	-	284,331
為替差損	128,721	179,805
その他営業外費用	-	187
営業外費用合計	128,721	464,324
経常利益	3,856,556	2,649,846
税引前当期純利益	3,856,556	2,649,846
法人税、住民税及び事業税	1,474,283	1,015,667
法人税等調整額	447,028	37,516
法人税等合計	1,027,254	978,151
当期純利益	2,829,301	1,671,695

(3) 【株主資本等変動計算書】

第32期（自2021年4月1日 至2022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	16,546,042	16,579,718	19,797,718
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	-	2,900,000	2,900,000	2,900,000
当期純利益	-	-	-	-	2,829,301	2,829,301	2,829,301
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	70,698	70,698	70,698
当期末残高	2,218,000	1,000,000	1,000,000	33,676	16,475,344	16,509,020	19,727,020

	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	202	202	19,797,921
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	2,900,000
当期純利益	-	-	2,829,301
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	117,550	117,550	117,550
当期変動額合計	117,550	117,550	188,249
当期末残高	117,348	117,348	19,609,672

第33期（自2022年4月1日 至2023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	16,475,344	16,509,020	19,727,020
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	-	2,800,000	2,800,000	2,800,000
当期純利益	-	-	-	-	1,671,695	1,671,695	1,671,695
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	1,128,304	1,128,304	1,128,304
当期末残高	2,218,000	1,000,000	1,000,000	33,676	15,347,039	15,380,716	18,598,716

	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	117,348	117,348	19,609,672
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	2,800,000
当期純利益	-	-	1,671,695
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	117,521	117,521	117,521
当期変動額合計	117,521	117,521	1,010,782
当期末残高	173	173	18,598,889

注記事項

（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

市場価格のない株式等以外のもの

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。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員に対する賞与の支給に備えるため、当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．固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

器具備品 5年

4．収益及び費用の計上基準

当社は、投資運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬、業務受託報酬およびその他営業収益を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

委託者報酬：当該報酬は投資信託の信託約款に基づき日々の純資産価額を基礎として算定し、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

運用受託報酬：当該報酬は対象顧客との投資一任契約等に基づき純資産価額を基礎として算定し、対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

業務受託報酬およびその他営業収益：グループ会社から受領する収益は、当社のグループ会社との契約で定められた算式に基づき月次で算定し、当該報酬は当社がグループ会社にオフショアファンド関連のサービス等を提供する期間にわたり収益として認識しております。

成功報酬：成功報酬は対象となるファンドまたは口座の運用益に対する一定割合、もしくは特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は契約上支払われることが確定した時点で収益として認識しております。

（会計方針の変更に関する注記）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号2021年6月17日）を当期首から適用しております。これによる当期の財務諸表に与える影響はありません。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当事業年度の財務諸表等の作成にあたって行った会計上の見積りが当事業年度の翌事業年度の財務諸表等に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表関係）

関係会社に対する資産及び負債

第32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
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）

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。

	第32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
関係会社からの受取利息	5,171千円	2,269千円

（株主資本等変動計算書関係）

第32期（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

1．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	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	56,265	-	-	56,265
合計	56,265	-	-	56,265

2．配当に関する事項

配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
2021年6月24日 定時株主総会	普通株式	2,900,000	51,541	2021年3月31日	2021年6月28日

第33期（自2022年4月1日 至2023年3月31日）

1．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	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	56,265	-	-	56,265
合計	56,265	-	-	56,265

2．配当に関する事項

配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり配当額 （円）	基準日	効力発生日
2022年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,800,000	49,764	2022年3月31日	2022年6月28日

（リース取引関係）

第32期 （自2021年4月1日 至2022年3月31日）		第33期 （自2022年4月1日 至2023年3月31日）	
オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料は以下のとおりであります。		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	2,087千円	1年以内	1,859千円
1年超	7,133千円	1年超	4,493千円
合計	9,221千円	合計	6,352千円

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）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。

（2）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。

投資有価証券のうち、上述のシードキャピタルは、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。

（3）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

(1) 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、「市場価格のない株式等」は次表には含めておりません（（注2）参照）。

第32期（2022年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券	2,034,881	2,034,881	-
資産計	2,034,881	2,034,881	-
長期未払金	259,178	259,178	-
負債計	259,178	259,178	-

（注1）時価と貸借対照表計上額との差額の表への記載を省略しているものとその理由

資産

「現金及び預金」「未収委託者報酬」「未収収益」「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が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しています。

負債

「未払手数料」「その他未払金」「未払費用」

これらは短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しています。

（注2）市場価格のない株式等

下記の関係会社株式及び投資有価証券（合同会社出資金）については、市場価格のない株式等と認められるため、上表に含めておりません。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
関係会社株式	60,000
投資有価証券（合同会社出資金）	308,759

第33期（2023年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
長期未払金	234,648	234,648	-
負債計	234,648	234,648	-

（注1）時価と貸借対照表計上額との差額の表への記載を省略しているものとその理由

資産

「現金及び預金」「未収委託者報酬」「未収収益」「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が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しています。

負債

「未払手数料」「その他未払金」「未払費用」

これらは短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しています。

（注2）市場価格のない株式等

下記の関係会社株式及び投資有価証券（合同会社出資金）については、市場価格のない株式等と認められるため、上表に含めておりません。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
関係会社株式	60,000
投資有価証券（合同会社出資金）	544,463

（2）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もあります。

（3）金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接又は間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価をもって貸借対照表計上額とする金融商品以外の金融商品

第32期（2022年3月31日）

（単位：千円）

	レベル1	レベル2	レベル3	合計
長期未払金	-	259,178	-	259,178
負債計	-	259,178	-	259,178

第33期（2023年3月31日）

（単位：千円）

	レベル1	レベル2	レベル3	合計
長期未払金	-	234,648	-	234,648
負債計	-	234,648	-	234,648

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

「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信用リスクを加味した利率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。これに伴い、レベル2の時価に分類しております。

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32期(2022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	18,159,513	-	-	-
未収委託者報酬	1,938,156	-	-	-
未収収益	956,791	-	-	-
関係会社短期貸付金	1,000,000	-	-	-
合計	22,054,462	-	-	-

第33期(2023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	17,854,232	-	-	-
未収委託者報酬	1,906,906	-	-	-
未収収益	1,148,869	-	-	-
関係会社短期貸付金	100,000	-	-	-
合計	21,010,008	-	-	-

（有価証券関係）

1．関係会社株式

関係会社株式（第32期の貸借対照表計上額は60,000千円、第33期の貸借対照表計上額は60,000千円）については市場価格のない株式等と認められるため、記載しておりません。

2．その他有価証券

第32期（2022年3月31日）

投資有価証券（合同会社出資金）（貸借対照表計上額 308,759千円）については市場価格のない株式等と認められるため、次表には記載しておりません。

（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	5,415	5,010	405
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他投資信託	2,029,466	2,199,010	169,543
合計		2,034,881	2,204,020	169,138

第33期（2023年3月31日）

投資有価証券（合同会社出資金）（貸借対照表計上額 544,463千円）については市場価格のない株式等と認められるため、次表には記載しておりません。

（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	2,405	2,000	405
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	1,833	1,989	155
合計		4,239	3,989	250

3．当事業年度中に売却したその他有価証券

第32期（自2021年4月1日 至2022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	-

第33期（自2022年4月1日 至2023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	2,200,000	33	284,331

（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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
	(千円)	(千円)
退職給付債務の期首残高	1,464,414	1,561,511
勤務費用	161,163	156,871
利息費用	7,322	7,808
数理計算上の差異の発生額	13,354	786
退職給付の支払額	84,742	172,850
退職給付債務の期末残高	1,561,511	1,552,554

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
	(千円)	(千円)
年金資産の期首残高	1,776,761	1,780,406
期待運用収益	5,330	5,341
数理計算上の差異の発生額	78,815	33,342
事業主からの拠出額	161,872	166,877
退職給付の支払額	84,742	172,850
年金資産の期末残高	1,780,406	1,813,116

(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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
	(千円)	(千円)
積立型制度の退職給付債務	1,561,511	1,552,554
年金資産	1,780,406	1,813,116
	218,895	260,562
未認識数理計算上の差異	29,853	48,133
未認識過去勤務費用	-	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	189,042	212,429
前払年金費用	189,042	212,429
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	189,042	212,429

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
	(千円)	(千円)
勤務費用	161,163	156,871
利息費用	7,322	7,808
期待運用収益	5,330	5,341
数理計算上の差異の費用処理額	39,380	15,657
過去勤務債務の費用処理額	-	-
その他(注1)	1,758	5,425
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)	125,533	149,106

(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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
債券	30%	29%
現金及び預金	70%	71%
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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
主要な数理計算上の計算基礎		
割引率	0.5%	0.5%
長期期待運用収益率	0.3%	0.3%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第32期事業年度53,526千円、第33期事業年度53,343千円であります。

（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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
繰延税金資産	(千円)	(千円)
賞与引当金	494,974	473,755
未払費用	92,420	119,056
未払事業税	43,648	25,819
長期前払費用	108,639	119,205
減価償却超過額	156,941	204,658
その他有価証券評価差額金	51,790	-
その他	6,965	5,772
繰延税金資産小計	955,380	948,268
評価性引当額	5,556	5,556
繰延税金資産合計	949,824	942,712
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	57,884	65,122
繰延税金資産又は繰延税金負債()の純額	891,939	877,589

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32期 (2022年3月31日)	第33期 (2023年3月31日)
法定実効税率	30.62%	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	5.45%	6.20%
評価性引当額	9.56%	0.00%
住民税等均等割	0.09%	0.09%
過年度法人税等	0.03%	0.01%
その他	0.00%	0.00%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.63%	36.90%

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであり、顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、以下のとおりであります。

第32期（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

（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
残高報酬	11,638,721	7,767,763	2,379,908	132,493	21,918,886
成功報酬	-	49,621	-	-	49,621
合計	11,638,721	7,817,385	2,379,908	132,493	21,968,508

第33期（自2022年4月1日 至2023年3月31日）

（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
残高報酬	10,324,813	7,511,402	2,566,610	240,482	20,643,309
成功報酬	-	31,066	-	-	31,066
合計	10,324,813	7,542,468	2,566,610	240,482	20,674,375

（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32期（自2021年4月1日 至2022年3月31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	11,638,721	7,817,385	2,379,908	132,493	21,968,508

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
12,737,897	3,941,639	2,874,061	2,414,909	21,968,508

（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	3,923,766	資産運用業
JPMorgan Asset Management (Asia Pacific) Limited	2,802,256	資産運用業

第33期（自2022年4月1日 至2023年3月31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	10,324,813	7,542,468	2,566,610	240,482	20,674,375

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
11,669,935	3,217,990	5,786,449	20,674,375

(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	3,196,350	資産運用業

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

第32期（自2021年4月1日 至2022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	214,618 百万米ドル	持株会社	被所有 間接 100%	人件費の立替	-	-	未払金	419,815

（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）	5,000,000	関係会社 短期貸付金	1,000,000
							資金の回収	5,700,000		
							受取利息	5,171	未収収益	10
							配当の受取	-	-	-

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

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

兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
最終的な親会社が同一である会社	JPMorgan Asset Management (UK) Limited	英国 ロンドン	24百万 ポンド	投資運用業	なし	投資の助言または投資一任	運用受託報酬	3,567,211	未収収益	291,744
							調査費	1,133,637	未払金	1,448,636
最終的な親会社が同一である会社	JPMorgan Asset Management (Asia Pacific) Limited	香港 セントラル	2,790百万 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	2,794,833	未収収益	123,299

（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33期（自2022年4月1日 至2023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	215,530 百万米ドル	持株会社	被所有 間接 100%	人件費の立替	-	-	未払金	438,743

(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）	1,600,000	関係会社 短期貸付金	100,000
							資金の回収	2,500,000		
							受取利息	2,269	未収収益	1
							配当の受取	-	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
最終的な親会社 が同一である 会社	JPMorgan Asset Management (UK) Limited	英国 ロンドン	24百万 ポンド	投資運用業	なし	投資の助言または投資一任	運用受託報酬	2,818,164	未収収益	239,199
							調査費	1,228,359	未払費用	71,549

(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32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
1株当たり純資産額	348,523.46円	330,558.77円
1株当たり当期純利益	50,285.28円	29,711.10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32期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
損益計算書上の当期純利益	2,829,301千円	1,671,695千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	2,829,301千円	1,671,695千円
普通株式の期中平均株式数	56,265株	56,265株

(重要な後発事象に関する注記)

該当ありません。

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】

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

<更新・訂正後>

(1) 受託会社

名 称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2023年3月末現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名 称 : 株式会社日本カストディ銀行

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

	名 称	資本金の額 (2023年3月末現在)	事業の内容
1	株式会社SBI証券	48,323百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
2	楽天証券株式会社	19,495百万円 (2022年11月1日現在)	同 上
3	SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	同 上

独立監査人の監査報告書

2023年8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
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興 JPM 環太平洋ディスカバリー・ファンド（年4回決算型）の2022年12月21日から2023年6月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興 JPM 環太平洋ディスカバリー・ファンド（年4回決算型）の2023年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書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

2023年6月5日

J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会御中

P w Cあらた有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 鶴田光夫
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているJ Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第33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。

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2023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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
 - ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
 - ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
- 監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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. 上記の監査報告書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。