

【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】 2024年 8 月14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 U S コア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）

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

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

・【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2024年2月14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

米国総合債券ファンド

（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*2（米国法人）（以下「JPMIM社」という場合があります。） 2023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）

マネープール・ファンド

（略）	
運用会社	J.P.モルガン・アセット・マネジメント株式会社*2（委託会社） マネープール・マザーファンドの運用の指図の権限をJ.P.モルガン・アセット・マネジメント（UK）リミテッド*2（英国法人）に委託します（以下「運用委託先」という場合があります。） 2023年12月末時点では運用委託先が実際に運用を行っていますが、今後変更される場合があります。

*1（略）

*2（略）

（以下略）

<訂正後>

（略）

投資先ファンドの特徴

米国総合債券ファンド

（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*2（米国法人）（以下「JPMIM社」という場合があります。） 2024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)

マネープール・ファンド

(略)	
運用会社	J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社*2（委託会社） マネープール・マザーファンドの運用の指図の権限をJ Pモルガン・アセット・マネジメント（UK）リミテッド*2（英国法人）に委託します（以下「運用委託先」という場合があります。）。 2024年6月末時点では運用委託先が実際に運用を行っていますが、今後変更される場合があります。

*1（略）

*2（略）

(以下略)

(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12月末現在）

(略)

大株主の状況（2023年12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（2024年6月末現在）

(略)

大株主の状況（2024年6月末現在）

(以下略)

2【投資方針】

(2) 投資対象

<訂正前>

(略)

(参考) マザーファンドの投資対象

(略)

(ホ) マザー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。

米国総合債券ファンド

(略)	(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。

マネープール・ファンド

(略)	(略)
運用会社	J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社（委託会社） マネープール・マザーファンドの運用の指図の権限を J P モルガン・アセット・マネジメント（UK）リミテッド（英国法人）に委託します。 <u>2023年12月末時点では運用委託先が実際に運用を行っていますが、今後変更される場合があります。</u>

<訂正後>

(略)

(参考) マザーファンドの投資対象

(略)

(ホ) マザー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。

米国総合債券ファンド

(略)	(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） <u>2024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。</u>

マネープール・ファンド

(略)	(略)
運用会社	J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社（委託会社） マネープール・マザーファンドの運用の指図の権限を J P モルガン・アセット・マネジメント（UK）リミテッド（英国法人）に委託します。 <u>2024年6月末時点では運用委託先が実際に運用を行っていますが、今後変更される場合があります。</u>

(3) 運用体制

<訂正前>

(イ) マザーファンドの運用体制

(略)

(注) 前記の運用体制、組織名称等は、2023年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(略)

(ハ) 投資先ファンドの運用体制

以下は、投資先ファンドにおける運用体制です。

米国総合債券ファンド

当該投資先ファンドの運用は、J P M I M社のグローバル債券運用グループに所属する米国コア債券運用チーム（約10名（2023年9月末現在））のポートフォリオ・マネジャーが行います。

(略)

(注1) (略)

(注2) 前記の運用体制、組織名称等は、2023年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

マネープール・ファンド

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

マネープール・マザーファンドの運用は、グローバル債券運用グループのグローバル・レイツ・チーム（約20名（2023年9月末現在））に所属するJ P モルガン・アセット・マネジメント（U K）リミテッドのポートフォリオ・マネジャーが行います。

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2023年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（以下略）

<訂正後>

（イ）マザーファンドの運用体制

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2024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

以下は、投資先ファンドにおける運用体制です。

米国総合債券ファンド

当該投資先ファンドの運用は、J P M I M社のグローバル債券運用グループに所属する米国コア債券運用チーム（約10名（2024年3月末現在））のポートフォリオ・マネジャーが行います。

（略）

（注1）（略）

（注2）前記の運用体制、組織名称等は、2024年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

マネープール・ファンド

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

マネープール・マザーファンドの運用は、グローバル債券運用グループのグローバル・レイツ・チーム（約20名（2024年3月末現在））に所属するJ P モルガン・アセット・マネジメント（U K）リミテッドのポートフォリオ・マネジャーが行います。

（略）

（注）前記の運用体制、組織名称等は、2024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。

（以下略）

3【投資リスク】

（1）リスク要因

投資先ファンドのリスク

米国総合債券ファンド

市場に関する留意点

< 訂正前 >

(略)

例えば、新型コロナウイルス（COVID-19）による疾患の拡大は、世界全体の経済、市場および各企業に悪影響を与えており、投資先ファンドが投資する有価証券等に対しても同様です。新型コロナウイルスのパンデミックや将来的に起こりうる他の感染症等の流行およびパンデミックの影響により、現在から将来に渡り投資先ファンドについて、その投資対象の価値の著しい下落、その価格の乱高下、その価格算出への悪影響、その既存リスクの拡大、その純資産総額算出の中断または延期、およびその事務の一時中断が生じる可能性があります。新型コロナウイルスのパンデミックが投資先ファンドに与える全ての影響の把握はできていないのが現状です。

< 訂正後 >

(略)

例えば、新型コロナウイルス（COVID-19）による疾患の拡大は、世界全体の経済、市場および各企業に悪影響を与えており、投資先ファンドが投資する有価証券等に対しても同様です。新型コロナウイルスのパンデミックや将来的に起こりうる他の感染症等の流行およびパンデミックの影響により、現在から将来に渡り投資先ファンドについて、その投資対象の価値の著しい下落、その価格の乱高下、その価格算出への悪影響、その既存リスクの拡大、その純資産総額算出の中断または延期、およびその事務の一時中断が生じる可能性があります。新型コロナウイルスのパンデミックの期間と影響、それに関連する経済状況と市場状況、および長期にわたる不確実性は、現時点では合理的に見積もることができません。新型コロナウイルスの最終的な影響と、関連する状況が投資先ファンドにどの程度影響を与えるかは、今後の状況次第であり非常に不確実なものです。このような状況は正確に予測することが難しく、かつ頻繁に変わる可能性があります。

マネープール・ファンド

市場に関する留意点

< 訂正前 >

(略)

例えば、新型コロナウイルス（COVID-19）による疾患の拡大は、世界全体の経済、市場および各企業に悪影響を与えており、マネープール・マザーファンドが投資する有価証券等に対しても同様です。新型コロナウイルスのパンデミックや将来的に起こりうる他の感染症等の流行およびパンデミックの影響により、現在から将来に渡りマネープール・マザーファンドについて、その投資対象の価値の著しい下落、その価格の乱高下、その価格算出への悪影響、その既存リスクの拡大、その純資産総額算出の中断または延期、およびその事務の一時中断が生じる可能性があります。新型コロナウイルスのパンデミックがマネープール・マザーファンドに与える全ての影響の把握はできていないのが現状です。

< 訂正後 >

(略)

例えば、新型コロナウイルス（COVID-19）による疾患の拡大は、世界全体の経済、市場および各企業に悪影響を与えており、マネープール・マザーファンドが投資する有価証券等に対しても同様です。新型コロナウイルスのパンデミックや将来的に起こりうる他の感染症等の流行およびパンデミックの影響により、現在から将来に渡りマネープール・マザーファンドについて、その投資対象の価値の著しい下落、その価格の乱高下、その価格算出への悪影響、その既存リスクの拡大、その純資産総額算出の中断または延期、およびその事務の一時中断が生じる可能性があります。新型コロナウイルスのパンデミックの期間と影響、それに関連する経済状況と市場状況、および長期にわたる不確実性は、現時点では合理的に見積もることができません。新型コロナウイルスの最終的な影響と、関連する状況がマネープール・マザーファンドにどの程度影響を与えるかは、今後の状況次第であり非常に不確実なものです。このような状況は正確に予測することが難しく、かつ頻繁に変わる可能性があります。

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

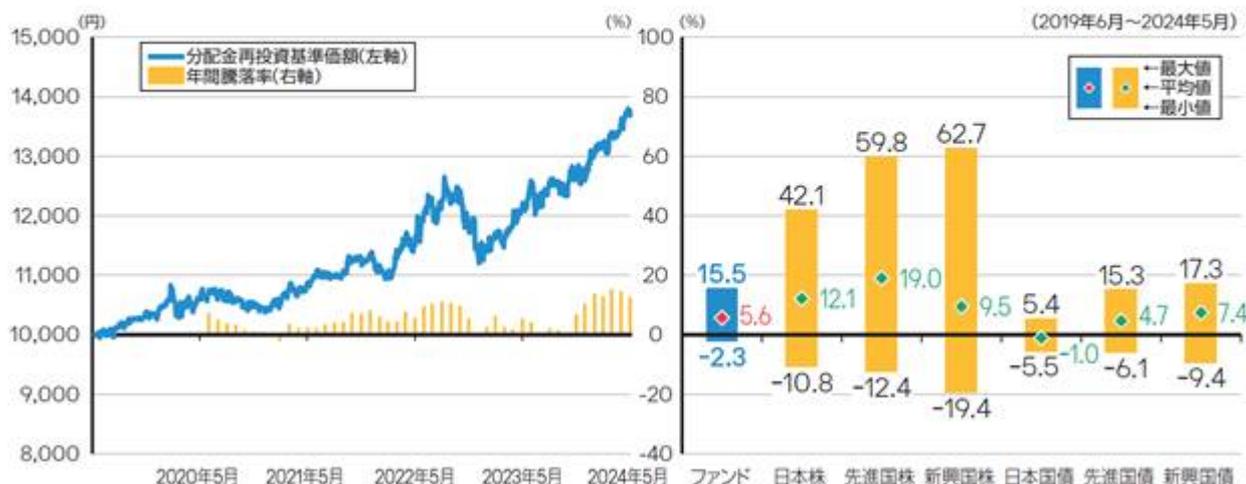
下記グラフは、ファンドの投資リスクをご理解いただくための情報の一つとしてご利用ください。

<ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移>

2019年6月～2024年5月の5年間に於ける、ファンドの分配金再投資基準価額（日次）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。ただし、ファンドは設定から6年未満で、設定日から2020年5月末までは年間騰落率が算出されないことから、それ以降の毎月末時点における年間騰落率を用いています。
- ファンド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に係る商標又は高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）

(口) 投資先ファンドにおけるリスク管理

米国総合債券ファンド

(略)

(2023年12月末現在)

(略)

マネープール・ファンド

(略)

(2023年12月末現在)

(以下略)

<訂正後>

(略)

(口) 投資先ファンドにおけるリスク管理

米国総合債券ファンド

(略)

(2024年6月末現在)

(略)

マネープール・ファンド

(略)

(2024年6月末現在)

(以下略)

4【手数料等及び税金】

(5) 課税上の取扱い

<訂正前>

(略)

なお、税法が改正された場合には、以下の内容が変更になることがあります。以下の税制は2024年1月1日現在適用されるものです。

(略)

法人、個人別の課税の取扱いについて

(a) 個人の受益者に対する課税

(略)

(二) 少額投資非課税制度について

(略)

なお、非課税口座で生じた配当所得および譲渡所得を、非課税口座以外で生じた配当所得および譲渡所得と損益通算することはできません。詳しくは販売会社にご確認ください。

上記は2024年1月1日現在のものです。税法が改正された場合等には変更される場合があります。

(b) 法人の受益者に対する課税

(略)

外国税額控除の適用となった場合には、収益分配時の税金が前記と異なる場合があります。
課税上の取扱いの詳細については、税務専門家（税務署等）に確認することをお勧めします。

<訂正後>

(略)

なお、税法が改正された場合には、以下の内容が変更になることがあります。以下の税制は2024年6月末現在適用されるものです。

(略)

法人、個人別の課税の取扱いについて

(a) 個人の受益者に対する課税

(略)

(二) 少額投資非課税制度について

(略)

なお、非課税口座で生じた配当所得および譲渡所得を、非課税口座以外で生じた配当所得および譲渡所得と損益通算することはできません。詳しくは販売会社にご確認ください。

上記は2024年6月末現在のものです。税法が改正された場合等には変更される場合があります。

(b) 法人の受益者に対する課税

(略)

外国税額控除の適用となった場合には、収益分配時の税金が前記と異なる場合があります。
課税上の取扱いの詳細については、税務専門家（税務署等）に確認することをお勧めします。

(参考情報) ファンドの総経費率

ファンドの直近の運用報告書対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率 (+)	運用管理費用の比率 ()	その他費用の比率 ()
年率1.51%	年率1.30%	年率0.21%

対象期間：2023年11月16日～2024年5月15日

総経費率は、期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した数値です。

各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

の運用管理費用には投資先ファンドの運用管理費用を含みます。

これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

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

(2024年6月3日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

親投資信託受益証券	日本	1,072,354,115	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	520,884	0.05
合計(純資産総額)		1,071,833,231	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「G I M U Sコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)」です(以下同じ)。

(参考) G I M U Sコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)

(2024年6月3日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	985,686	0.03
投資証券	ルクセンブルク	3,700,948,671	99.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	17,551,343	0.47
合計(純資産総額)		3,719,485,700	100.00

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(2024年6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 U Sコア債券マザーファンド (為替ヘッジなし)(適格機関投資家 専用)	745,000,775	1.4373	1,070,843,358	1.4394	1,072,354,115	100.05

(参考) G I M U Sコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)

(2024年6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	ルクセンブルク	投資証券	JPM US AGGR BOND X(MTH) JPY	292,958.812	11,938.35	3,497,445,638	12,633	3,700,948,671	99.50
2	日本	投資信託 受益証券	G I Mジャパン・マネーブ ール・ファンドF(適格機関投 資家専用)	996,247	0.9915	987,778	0.9894	985,686	0.03

種類別投資比率

(2024年6月3日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.05

(参考) G I M U Sコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)

(2024年6月3日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.03
投資証券	99.50

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

2024年6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	(2019年11月15日)	328	329	1.0229	1.0244
第2特定期間末	(2020年5月15日)	410	411	1.0420	1.0435
第3特定期間末	(2020年11月16日)	803	805	1.0392	1.0407
第4特定期間末	(2021年5月17日)	743	744	1.0606	1.0621
第5特定期間末	(2021年11月15日)	512	513	1.1058	1.1073
第6特定期間末	(2022年5月16日)	462	463	1.1311	1.1326
第7特定期間末	(2022年11月15日)	479	479	1.1563	1.1578
第8特定期間末	(2023年5月15日)	532	537	1.1320	1.1420
第9特定期間末	(2023年11月15日)	695	701	1.1787	1.1887
第10特定期間末	(2024年5月15日)	1,015	1,023	1.2350	1.2450
	2023年6月末日	604	-	1.1919	-
	2023年7月末日	592	-	1.1400	-
	2023年8月末日	638	-	1.1760	-
	2023年9月末日	673	-	1.1619	-
	2023年10月末日	674	-	1.1476	-
	2023年11月末日	700	-	1.1731	-
	2023年12月末日	729	-	1.1623	-
	2024年1月末日	755	-	1.1955	-
	2024年2月末日	829	-	1.2077	-
	2024年3月末日	950	-	1.2162	-
	2024年4月末日	1,007	-	1.2311	-
	2024年5月末日	1,062	-	1.2315	-
	2024年6月3日	1,071	-	1.2363	-

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

分配の推移

期	1口当たり分配金（円）
第1特定期間	0.0030
第2特定期間	0.0045
第3特定期間	0.0045
第4特定期間	0.0045
第5特定期間	0.0045
第6特定期間	0.0045
第7特定期間	0.0045
第8特定期間	0.0300
第9特定期間	0.0300
第10特定期間	0.0300

収益率の推移

期	収益率（％）
第1特定期間	2.59
第2特定期間	2.31
第3特定期間	0.16
第4特定期間	2.49
第5特定期間	4.69
第6特定期間	2.69
第7特定期間	2.63
第8特定期間	0.49
第9特定期間	6.78
第10特定期間	7.32

（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	351,295,968	29,886,039	321,409,929
第2特定期間	170,696,051	97,765,443	394,340,537
第3特定期間	428,408,150	49,127,746	773,620,941
第4特定期間	102,127,267	174,592,904	701,155,304
第5特定期間	33,289,341	270,985,938	463,458,707
第6特定期間	13,921,841	68,215,762	409,164,786
第7特定期間	65,070,657	59,961,382	414,274,061
第8特定期間	68,623,221	12,344,341	470,552,941
第9特定期間	159,079,580	39,606,519	590,026,002
第10特定期間	303,480,550	71,572,299	821,934,253

(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	2024年6月3日	設定日	2019年6月10日
純資産総額	10億円	決算回数	年6回

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	2023年9月	100
27期	2023年11月	100
28期	2024年1月	100
29期	2024年3月	100
30期	2024年5月	100
	設定来累計	1,200

* 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	投資比率 1
J P M U S アグリゲート・ボンド（Xクラス）（円建て）	99.5%
G I M ジャパン・マネーブル・ファンドF（適格機関投資家専用）	0.0%
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	0.5%
合計（純資産総額）	100.0%

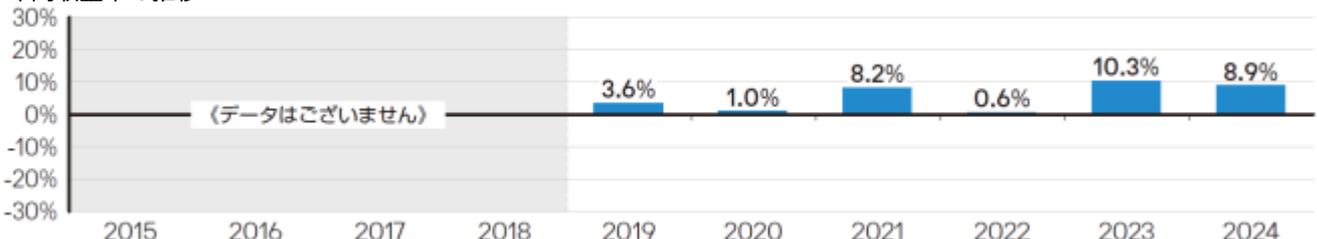
種類別構成状況

種類	投資比率 2
社債	29.6%
住宅ローン担保証券等	28.4%
国債・政府機関債等	27.3%
商業用不動産担保証券	11.9%
資産担保証券	1.1%
地方債	0.1%

組入上位銘柄

順位	銘柄名	債券種別	クーポン(%)	償還日	投資比率 ^{※2}
1	米国国債	国債・政府機関債等	4.500%	2033/11/15	1.9%
2	米国国債	国債・政府機関債等	2.750%	2027/7/31	1.8%
3	米国国債	国債・政府機関債等	1.250%	2028/4/30	1.8%
4	米国国債	国債・政府機関債等	0.500%	2026/2/28	1.1%
5	米国国債	国債・政府機関債等	2.875%	2032/5/15	1.0%
6	ジニーメイ	住宅ローン担保証券等	2.500%	2051/8/20	1.0%
7	ファニーメイ	住宅ローン担保証券等	2.500%	2054/6/1	1.0%
8	米国国債	国債・政府機関債等	2.750%	2032/8/15	1.0%
9	米国国債	国債・政府機関債等	3.625%	2043/8/15	0.9%
10	米国国債	国債・政府機関債等	2.250%	2027/11/15	0.8%

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

* 2019年の年間収益率は設定日から年末営業日、2024年の年間収益率は前年末営業日から2024年6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。

* 当ページにおける「ファンド」は、J P M U S コア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）です。

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

- 各比率はファンドの純資産総額に対する比率を記載しています。
- ファンドは各投資先ファンドを通じて投資を行うため、各投資先ファンドの投資銘柄をファンドが直接保有しているものとみなし、ファンドの純資産総額に対する投資比率として計算しています。なお、運用実績の基準日のファンドの基準価額算出に使用されているデータ（J P M U S アグリゲート・ボンド（Xクラス）（円建て）およびG I M ジャパン・マネーブル・ファンドF（適格機関投資家専用）は2024年5月最終営業日のもの）を使用しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

受付時間

<訂正前>

原則として午後3時までとします。ただし、販売会社によっては受付時間が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

<訂正後>

原則として午後3時までとします。ただし、販売会社によっては受付時間が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（2024年11月5日以降）

原則として、購入の申込みにかかる、販売会社所定の事務手続きが午後3時30分までに完了したものを当日の申込受付分とします。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳細は販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

受付時間

<訂正前>

原則として午後3時までとします。ただし、販売会社によっては受付時間が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

<訂正後>

原則として午後3時までとします。ただし、販売会社によっては受付時間が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（2024年11月5日以降）

原則として、換金の申込みにかかる、販売会社所定の事務手続きが午後3時30分までに完了したものを当日の申込受付分とします。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳細は販売会社にご確認ください。

第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10特定期間（2023年11月16日から2024年5月15日まで）の財務諸表について、PwC Japan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 USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 (2023年11月15日現在)	当期 (2024年5月15日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	702,451,828	1,024,853,100
流動資産合計	702,451,828	1,024,853,100
資産合計	702,451,828	1,024,853,100
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,900,260	8,219,342
未払受託者報酬	37,104	53,333
未払委託者報酬	927,629	1,333,401
その他未払費用	123,647	177,752
流動負債合計	6,988,640	9,783,828
負債合計	6,988,640	9,783,828
純資産の部		
元本等		
元本	1,590,026,002	1,821,934,253
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	105,437,186	193,135,019
（分配準備積立金）	48,940,741	83,940,899
元本等合計	695,463,188	1,015,069,272
純資産合計	695,463,188	1,015,069,272
負債純資産合計	702,451,828	1,024,853,100

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	前期 (自 2023年 5月16日 至 2023年11月15日)	当期 (自 2023年11月16日 至 2024年 5月15日)
営業収益		
有価証券売買等損益	43,465,412	66,553,098
営業収益合計	43,465,412	66,553,098
営業費用		
受託者報酬	102,504	136,287
委託者報酬	2,562,743	3,407,116
その他費用	2,341,588	2,454,177
営業費用合計	3,006,835	3,997,580
営業利益又は営業損失（ ）	40,458,577	62,555,518
経常利益又は経常損失（ ）	40,458,577	62,555,518
当期純利益又は当期純損失（ ）	40,458,577	62,555,518
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（ ）	9,794	668,204
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	62,104,008	105,437,186
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,216,075	60,351,500
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	26,216,075	60,351,500
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,595,647	12,825,607
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,595,647	12,825,607
分配金	1,167,555,621	1,217,715,374
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	105,437,186	193,135,019

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	当財務諸表対象期間
有価証券の評価基準および評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

前期 (2023年11月15日現在)	当期 (2024年5月15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 (2023年11月15日現在)	当期 (2024年5月15日現在)
1期首元本額	470,552,941円	590,026,002円
期中追加設定元本額	159,079,580円	303,480,550円
期中一部解約元本額	39,606,519円	71,572,299円
受益権の総数	590,026,002口	821,934,253口
1口当たりの純資産額 (1万口当たりの純資産額)	1.1787円 (11,787円)	1.2350円 (12,350円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期	当期
	(自 2023年5月16日 至 2023年11月15日)	(自 2023年11月16日 至 2024年5月15日)
1 分配金の計算過程	(自 2023年5月16日 至 2023年7月18日)	(自 2023年11月16日 至 2024年1月15日)
費用控除後の配当等収益額	2,570,006円	3,350,793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	3,171,481円
収益調整金額	47,640,884円	79,520,860円
分配準備積立金額	51,424,136円	46,568,346円
当ファンドの分配対象収益額	101,635,026円	132,611,480円
当ファンドの期末残存口数	508,939,422口	645,639,745口
1万口当たり収益分配対象額	1,996.99円	2,053.95円
1万口当たり分配金額	100.00円	100.00円
収益分配金金額	5,089,394円	6,456,397円
	(自 2023年7月19日 至 2023年9月15日)	(自 2024年1月16日 至 2024年3月15日)
費用控除後の配当等収益額	3,264,054円	3,951,464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	756,148円	4,781,897円
収益調整金額	60,670,778円	93,761,665円
分配準備積立金額	48,881,689円	44,056,158円
当ファンドの分配対象収益額	113,572,669円	146,551,184円
当ファンドの期末残存口数	576,596,752口	703,963,525口
1万口当たり収益分配対象額	1,969.70円	2,081.80円
1万口当たり分配金額	100.00円	100.00円
収益分配金金額	5,765,967円	7,039,635円
	(自 2023年9月16日 至 2023年11月15日)	(自 2024年3月16日 至 2024年5月15日)
費用控除後の配当等収益額	3,333,109円	5,406,917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	7,120,429円	41,224,762円
収益調整金額	66,070,610円	117,495,307円
分配準備積立金額	44,387,463円	45,528,562円
当ファンドの分配対象収益額	120,911,611円	209,655,548円
当ファンドの期末残存口数	590,026,002口	821,934,253口
1万口当たり収益分配対象額	2,049.25円	2,550.75円
1万口当たり分配金額	100.00円	100.00円
収益分配金金額	5,900,260円	8,219,342円
2 その他費用の内訳	監査費用 68,280円 その他 273,308円	監査費用 90,803円 その他 363,374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 U Sコア債券マザーファンド（為替ヘッジなし）（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、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 (2023年11月15日現在)	当期 (2024年5月15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 (2023年11月15日現在)	当期 (2024年5月15日現在)
	最終計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	11,696,710	48,235,962
合計	11,696,710	48,235,962

（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（2024年5月15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 U S コア債券マザーファンド (為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)	713,139,726	1,024,853,100	
合計			713,139,726	1,024,853,100	

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 U Sコア債券マザーファンド（為替ヘッジなし）（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 U Sコア債券マザーファンド（為替ヘッジなし）（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	(2023年11月15日現在)	(2024年5月15日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		60,333,665	41,693,893
投資信託受益証券		987,778	985,886
投資証券		2,335,836,948	3,508,944,979
未収配当金		-	10,018,401
流動資産合計		2,397,158,391	3,561,643,159
資産合計		2,397,158,391	3,561,643,159
負債の部			
流動負債			
未払金		24,100,000	-
未払解約金		3,925,161	3,848,580
その他未払費用		1,179,498	5,089,018
流動負債合計		29,204,659	8,937,598
負債合計		29,204,659	8,937,598
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,778,345,829	2,472,163,789
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		589,607,903	1,080,541,772
元本等合計		2,367,953,732	3,552,705,561
純資産合計		2,367,953,732	3,552,705,561
負債純資産合計		2,397,158,391	3,561,643,159

（注）「G I M U Sコア債券マザーファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）」の計算期間は、毎年11月16日から翌年11月15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
有価証券の評価基準および評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券 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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

(2023年11月15日現在)	(2024年5月15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	(2023年11月15日現在)	(2024年5月15日現在)
1期首元本額	1,495,550,365円	1,778,345,829円
期中追加設定元本額	430,606,861円	838,518,621円
期中解約元本額	147,811,397円	144,700,661円
元本の内訳（注）		
JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、年1回決算型）	1,250,781,557円	1,759,024,063円
JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）	527,564,272円	713,139,726円
合 計	1,778,345,829円	2,472,163,789円
受益権の総数	1,778,345,829口	2,472,163,789口
1口当たりの純資産額 （1万口当たりの純資産額）	1.3315円 (13,315円)	1.4371円 (14,371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、投資信託受益証券および投資証券であります。当ファンドが保有した金融商品には、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。
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

	(2023年11月15日現在)	(2024年5月15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	(2023年11月15日現在)	(2024年5月15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)
投資信託受益証券	5,380	1,892
投資証券	119,441,110	196,999,341
合計	119,435,730	196,997,449

(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)

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。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表（2024年5月15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
投資信託 受益証券	日本円	G I M ジャパン・マネープール・ファン ドF（適格機関投資家専用）		996,247	985,886	
	計	銘柄数：	1	996,247	985,886	
		組入時価比率：	0.0%		0.0%	
	小計				985,886	
投資証券	日本円	JPM US AGGR BOND X(MTH) JPY		278,288.919	3,508,944,979	
	計	銘柄数：	1	278,288.919	3,508,944,979	
		組入時価比率：	98.8%		100.0%	
	小計				3,508,944,979	
	合計				3,509,930,865	

(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。

(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

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「G I Mジャパン・マネープール・ファンドF（適格機関投資家専用）」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「投資信託受益証券」は、同証券投資信託であります。

尚、「G I Mジャパン・マネープール・ファンドF（適格機関投資家専用）」は「G I Mマネープール・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。

同証券投資信託および親投資信託の状況は以下の通りであります。

以下に記載した情報は同証券投資信託の直近計算期間末における監査済財務諸表であります。尚、当ファンドの監査対象ではありません。

1 財務諸表

G I Mジャパン・マネープール・ファンドF（適格機関投資家専用）

（1）貸借対照表

（単位：円）

区分	注記 番号	第11期 (2023年1月16日現在)	第12期 (2024年1月15日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
親投資信託受益証券		6,184,361	6,155,179
流動資産合計		6,184,361	6,155,179
資産合計		6,184,361	6,155,179
負債の部			
流動負債			
未払受託者報酬		714	696
未払委託者報酬		2,510	2,427
その他未払費用		616	598
流動負債合計		3,840	3,721
負債合計		3,840	3,721
純資産の部			
元本等			
元本	1	6,223,017	6,203,111
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	42,496	51,653
（分配準備積立金）		112,806	114,234
元本等合計		6,180,521	6,151,458
純資産合計		6,180,521	6,151,458
負債純資産合計		6,184,361	6,155,179

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位 : 円)

区分	注記 番号	第11期	第12期
		(自 2022年 1月15日 至 2023年 1月16日)	(自 2023年 1月17日 至 2024年 1月15日)
		金額	金額
営業収益			
有価証券売買等損益		34,901	1,812
営業収益合計		34,901	1,812
営業費用			
受託者報酬		1,410	1,399
委託者報酬	1	4,950	4,891
その他費用	3	1,214	1,203
営業費用合計		7,574	7,493
営業利益又は営業損失 ()		42,475	9,305
経常利益又は経常損失 ()		42,475	9,305
当期純利益又は当期純損失 ()		42,475	9,305
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 ()		-	12
期首剰余金又は期首欠損金 ()		21	42,496
剰余金増加額又は欠損金減少額		-	136
当期一部解約に伴う剰余金増加額又 は欠損金減少額		-	136
剰余金減少額又は欠損金増加額		-	-
分配金	2	-	-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		42,496	51,653

(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礎となる事項	計算期間末日の取扱い 2023年1月14日および2023年1月15日が休日のため、信託約款第29条により、第11期計算期間末日を2023年1月16日としております。また、2024年1月14日が休日のため、第12期計算期間末日を2024年1月15日としております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第11期 (2023年1月16日現在)	第12期 (2024年1月15日現在)
当計算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計算期間の翌計算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	第11期 (2023年1月16日現在)	第12期 (2024年1月15日現在)
1 期首元本額	6,223,017円	6,223,017円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	19,906円
2 元本の欠損	42,496円	51,653円
受益権の総数	6,223,017口	6,203,111口
1 口当たりの純資産額 (1 万口当たりの純資産額)	0.9932円 (9,932円)	0.9917円 (9,917円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第11期 (自 2022年 1月15日 至 2023年 1月16日)	第12期 (自 2023年 1月17日 至 2024年 1月15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0.049%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	3,482円	1,789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	205,138円	204,482円
分配準備積立金額	109,324円	112,445円
当ファンドの分配対象収益額	317,944円	318,716円
当ファンドの期末残存口数	6,223,017口	6,203,111口
1万口当たり収益分配対象額	510.91円	513.80円
1万口当たり分配金額	- 円	- 円
収益分配金金額	- 円	- 円
3 その他費用の内訳	監査費用 1,214円	監査費用 1,203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マネープール・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、金利変動リスク、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

	第11期 (2023年1月16日現在)	第12期 (2024年1月15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	第11期 (2023年1月16日現在)	第12期 (2024年1月15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	34,896	1,830
合計	34,896	1,830

(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（2024年 1 月15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 マネープール・マザーファンド (適格機関投資家専用)	6,094,841	6,155,179	
合計			6,094,841	6,155,179	

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「GIMマネープール・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。

「GIMマネープール・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	(2023年1月16日現在)	(2024年1月15日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		2,802,595	1,392,806
国債証券		3,378,928	4,759,913
未収利息		3,031	1,609
前払費用		-	872
流動資産合計		6,184,554	6,155,200
資産合計		6,184,554	6,155,200
負債の部			
流動負債			
流動負債合計		-	-
負債合計		-	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	6,121,918	6,094,841
剰余金			
剰余金又は欠損金（　）		62,636	60,359
元本等合計		6,184,554	6,155,200
純資産合計		6,184,554	6,155,200
負債純資産合計		6,184,554	6,155,200

(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
有価証券の評価基準および評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1)金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の最終相場）で評価しております。 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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

(2023年 1月16日現在)	(2024年 1月15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	(2023年 1月16日現在)	(2024年 1月15日現在)
1期首元本額	6,129,342円	6,121,918円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中解約元本額	7,424円	27,077円
元本の内訳（注）		
G I M ジャパン・マネープール・ファンド F（適格機関投資家専用）	6,121,918円	6,094,841円
合 計	6,121,918円	6,094,841円
受益権の総数	6,121,918口	6,094,841口
1口当たりの純資産額	1.0102円	1.0099円
（1万口当たりの純資産額）	(10,102円)	(10,099円)

(注) 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する注記

	当財務諸表対象期間
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容およびそのリスク	当ファンドが保有した主な金融商品は、国債証券であります。当ファンドが保有した金融商品には、金利変動リスク、信用リスク、流動性のリスクがあります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>(1)運用部門から独立したインベストメント・ダイレクターは、運用成果やリスク水準のチェック等を行います。</p> <p>(2)リスク管理部門は、投資制限遵守状況の管理等、運用状況の管理・監督を行っています。</p> <p>(3)当ファンドは、運用の一部または全部について外部委託をしております。</p> <p>運用商品部門は外部委託先が適切に運用業務を行っているか継続的にモニタリングします。運用商品部門はその結果重大な問題があると判断する場合は、リスク管理を担当する部署が主催し、リスク管理上の重要な事項について決議または審議を行う委員会に報告し、対応を協議します。また運用商品部門は、委託先の業務遂行能力に問題があると判断した場合は、同委員会に報告します。</p>

金融商品の時価等に関する事項

	(2023年1月16日現在)	(2024年1月15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	<p>(1)有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。一部の債券時価に関しては発行体の格付けや債券の償還年限を基にした国債に対する上乘せ金利、取引業者からの提示価格、流動性、将来発生しうるキャッシュフロー、その他個々の債券の特性等を考慮して価格提供会社が算出した価格を利用しております。</p> <p>(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。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)有価証券以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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	(2023年1月16日現在)	(2024年1月15日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	42,459	663
合計	42,459	663

(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。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表(2024年1月15日現在)

(イ) 株式

該当事項はありません。

(ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	第141回利付国債(5年)		1,800,000	1,802,556	
		第149回利付国債(5年)		600,000	600,156	
		第333回利付国債(10年)		500,000	500,705	
		第340回利付国債(10年)		850,000	856,341	
		第1139回国庫短期証券		500,000	500,086	
		第1192回国庫短期証券		500,000	500,069	
		計	銘柄数:	6	4,750,000	4,759,913
	組入時価比率:	77.3%		100.0%		
	小計			4,759,913		
	合計			4,759,913		

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「JPM US AGGR BOND X(MTH) 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、同投資証券であります。

同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同投資証券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、当ファンドの監査対象ではありません。

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund
純資産計算書
2023年6月30日現在

	米ドル
資産	
投資有価証券 - 取得原価	5,291,144,099
未実現利益 / (損失)	(433,205,537)
投資有価証券 - 時価	4,857,938,562
TBA証券への投資 - 時価	-
現金預金およびブローカー預託金	10,538,445
定期預金	-
証券発行未収入金	14,442,447
投資有価証券売却未収入金	1,175,365
TBA証券売却未収入金	-
未収入配当	-
未収入利息	28,854,083
未収入報酬	-
未収入報奨金	156,689
未収入オプション契約 - 公正価値	-
金融先物契約未実現利益	184,344
先渡し為替契約未実現利益	31,761,310
スワップ契約 - 公正価値	-
その他の資産	1,133
資産合計	4,945,052,378
負債	
TBA契約にかかるオープン・ショート・ポジション - 時価	-
当座借越	1,260
ブローカーに対する債権	-
証券買戻未払金	4,909,980
投資有価証券購入未払金	71,142,083
TBA証券購入未払金	-
未払利息	-
未払販売報酬	64,432
未払運用報酬	1,931,543
未払ファンド・サービス報酬	391,913
未払業續報酬	-
未払オプション契約 - 公正価値	-
金融先物契約未実現損失	5,169,911
先渡し為替契約未実現損失	562,450
スワップ契約 - 公正価値	-
その他の負債*	7,788,818
負債合計	91,962,390
純資産額合計	4,853,089,988

*その他の負債は主に取締役報酬、監査および税務関連報酬および費用、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 Aggregate Bond Fund
損益および純資産変動計算書
2023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	3,576,326,744
収益	
受取配当金、源泉徴収税控除後	4,924,781
投資有価証券からの受取利息、源泉徴収税控除後	129,626,251
スワップ契約にかかる受取利息	-
証券貸付取引収入	-
受取銀行利息	42,239
その他の収益	-
収益合計	134,593,271
費用	
運用報酬	19,412,445
ファンド・サービス報酬	3,979,725
業續報酬	-
保管、支払代行、事務および所在地代行報酬	839,648
販売委託報酬	872,742
登録および名義書換代行報酬	350,028
税務	1,243,085
銀行およびその他の支払利息	658
スワップ契約にかかる支払利息	-
その他の費用*	689,535
控除：報酬免除額	(1,479,614)
費用合計	25,908,252
投資純利益 (損失)	108,685,019
投資有価証券売却実現純利益 (損失)	(26,294,121)
TBA証券実現純利益 (損失)	(2,758,181)
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)	(4,455,103)
先渡し為替契約実現純利益 (損失)	(50,068,175)
スワップ契約実現純利益 (損失)	-
為替差実現純利益 (損失)	15,105,927
当期実現純利益 (損失)	(68,469,653)
投資有価証券未実現評価益 (損) 純増減	(124,411,193)
TBA証券未実現評価益 (損) 純増減	1,546,639
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	(4,985,567)
先渡し為替契約未実現評価益 (損) 純増減	66,258,275
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	(9,810,692)
当期末実現評価益 (損) 純増減	(71,402,538)
事業活動による純資産増減	(31,187,172)
設	
解	2,859,000,190
資本の増減による純資産増減	(1,533,474,543)
支	
払	1,325,525,647
配	(17,575,231)
当	
金	4,853,089,988
期	
末	
現	
在	
純	
資	
産	
額	

*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 Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表

2023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		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(%)						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						TotalEnergiesCapital International SA	USD	2,555,000	1,831,394	0.04	
債券						3.12% 25/05/2030			5,183,228	0.11	
オーストラリア											
BHP Billiton Finance USA Ltd. 6.43%	USD	695,000	713,171	0.01							
01/03/2026			713,171	0.01	ドイツ						
					Deutsche Bank AG 3.75%	USD	400,000	388,272	0.01		
					30/05/2024			388,272	0.01		
カナダ											
Bank of Montreal 3.7%	USD	3,000,000	2,892,480	0.06	香港						
01/06/2025					Alfa Group Ltd., 144A 3.2%	USD	1,475,000	1,123,913	0.02		
Barrick Gold Corp. 6.45%	USD	709,000	749,178	0.02	16/09/2040			1,123,913	0.02		
15/10/2026											
Brookfield Finance, Inc. 4.85%	USD	1,089,000	1,042,156	0.02							
29/03/2029					アイルランド						
					AerCap Ireland Capital DAC 4.5%	USD	5,870,000	5,849,982	0.12		
Canadian Pacific Railway Co. 2.9%	USD	346,000	331,983	0.01	15/09/2023						
01/02/2025					AerCap Ireland Capital DAC 2.815%	USD	1,385,000	1,330,381	0.03		
Canadian Pacific Railway Co. 5.7%	USD	305,000	312,277	0.01	14/08/2024						
15/03/2023					AerCap Ireland Capital DAC 1.65%	USD	210,000	197,288	0.00		
Enbridge, Inc. 5.7%	USD	2,120,000	2,142,686	0.04	29/10/2024						
08/03/2033					AerCap Ireland Capital DAC 6.5%	USD	743,000	746,546	0.02		
Fortis, Inc. 3.055%	USD	1,496,000	1,295,346	0.03	15/07/2025						
04/10/2026					AerCap Ireland Capital DAC 4.45%	USD	958,000	919,717	0.02		
Nutrien Ltd. 4.9%	USD	2,000,000	1,960,608	0.04	01/10/2025						
27/03/2028					AerCap Ireland Capital DAC 1.75%	USD	997,000	893,768	0.02		
Nutrien Ltd. 4.2%	USD	375,000	359,515	0.00	30/01/2026						
01/04/2029					AerCap Ireland Capital DAC 4.45%	USD	735,000	701,911	0.01		
Nutrien Ltd. 5%	USD	400,000	358,373	0.01	03/04/2026						
01/01/2032					AerCap Ireland Capital DAC 2.45%	USD	790,000	784,696	0.01		
Suncor Energy, Inc. 7.1%	USD	150,000	161,261	0.00	29/10/2026						
15/05/2028					AerCap Ireland Capital DAC 5.75%	USD	2,800,000	2,772,038	0.06		
Suncor Energy, Inc. 6.8%	USD	550,000	581,343	0.01	06/06/2028						
15/05/2028					AerCap Ireland Capital DAC 3%	USD	975,000	842,621	0.02		
TransCanada Pipelines Ltd. 6.3%	USD	540,000	557,443	0.01	29/10/2028						
15/10/2031					AerCap Ireland Capital DAC 3.3%	USD	920,000	749,795	0.02		
TransCanada Pipelines Ltd. 4.75%	USD	1,150,000	1,022,578	0.02	30/01/2032						
15/05/2031			13,667,222	0.28	Bank of Ireland Group plc, FIN, 144A	USD	1,132,000	976,285	0.02		
					2.025% 30/09/2027						
ケイマン諸島											
CR Hutchison International B Ltd.,	USD	1,050,000	969,838	0.02	Shire Acquisitions Investments Ireland	USD	177,000	175,840	0.00		
144A 2.75%			969,838	0.02	DAC 2.875% 23/09/2023						
01/10/2026					Shire Acquisitions Investments Ireland	USD	3,120,000	2,927,020	0.06		
					DAC 3.2% 20/09/2026			19,786,828	0.41		
チリ											
Chile Government Bond 2.55%	USD	1,372,000	1,085,629	0.02	日本						
27/01/2032			1,085,629	0.02	Mitsubishi HC Capital, Inc., 144A	USD	700,000	687,812	0.01		
					3.55% 30/01/2024						
コロンビア											
Ecopetrol SA 5.375%	USD	464,000	442,957	0.01	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	USD	3,120,000	2,525,726	0.05		
26/06/2028			442,957	0.01	2.04% 17/07/2030						
フランス											
Credit Agricole SA, 144A 4.375%	USD	2,320,000	2,235,906	0.05							
17/02/2025											
TotalEnergiesCapital International SA	USD	1,450,000	1,115,929	0.02							
3.461%											
12/07/2049											

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3.75% 18/07/2029	USD	1,280,000	1,076,764	0.02		Mexico Government Bond 2.65% 24/05/2031	USD	2,763,000	2,291,868	0.05	
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., FOM 1.58% 20/07/2027	USD	2,020,000	1,780,128	0.04		Mexico Government Bond 4.75% 08/03/2044	USD	648,000	553,653	0.01	
Nissin Financial Group, Inc., FOM 1.23% 12/05/2027	USD	2,291,000	2,010,989	0.04		Mexico Government Bond 4.35% 15/01/2047	USD	36,000	28,587	0.00	
Nissin Financial Group, Inc., FOM 5.41% 11/09/2028	USD	1,640,000	1,626,255	0.03		Mexico Government Bond 4.6% 10/02/2048	USD	1,282,000	1,048,153	0.02	
Nomura Holdings, Inc. 2.64% 16/01/2025	USD	2,072,000	1,962,000	0.04		Mexico Government Bond 4.4% 12/02/2052	USD	3,900,000	3,056,572	0.06	
Nomura Holdings, Inc. 2.67% 16/07/2020	USD	1,640,000	1,336,877	0.03		Mexico Government Bond 6.33% 04/05/2053	USD	389,000	393,613	0.01	
Santoro Mitsui Financial Group, Inc., 144A 4.43% 02/04/2024	USD	1,300,000	1,180,856	0.03		Mexico Government Bond 3.77% 24/05/2061	USD	1,811,000	1,228,108	0.03	
Santoro Mitsui Financial Group, Inc. 3.05% 20/10/2026	USD	297,000	274,498	0.01		Mexico Government Bond 5.75% 12/10/2110	USD	566,000	501,481	0.01	
Santoro Mitsui Financial Group, Inc. 5.32% 13/01/2028	USD	3,105,000	3,120,774	0.06					16,854,997	0.35	
Santoro Mitsui Financial Group, Inc. 3.04% 26/07/2029	USD	2,290,000	2,000,742	0.04		オランダ					
Santoro Mitsui Financial Group, Inc. 5.7% 13/01/2030	USD	3,105,000	3,138,974	0.07		ING Groep NV 3.95% 29/03/2027	USD	650,000	615,697	0.01	
						ING Groep NV, FOM 1.73% 01/04/2027	USD	695,000	618,948	0.01	
			22,722,365	0.47					1,234,645	0.02	
						ニュージーランド					
ルクセンブルク						ANZ New Zealand Int' l Ltd., 144A 3.45% 19/02/2024	USD	1,000,000	982,440	0.02	
DB Europe Finance II SARL 3.25% 15/11/2029	USD	2,600,000	2,110,869	0.04		ANZ New Zealand Int' l Ltd., 144A 2.5% 11/02/2030	USD	3,246,000	2,759,442	0.06	
									3,741,882	0.08	
メキシコ						パナマ					
America Movil SAB de CV 3.62% 22/04/2029	USD	1,495,000	1,284,369	0.03		Panama Government Bond 4.5% 16/04/2050	USD	425,000	327,491	0.01	
America Movil SAB de CV 4.37% 22/04/2049	USD	966,000	835,307	0.02					327,491	0.01	
Coca-Cola FEMSA SAB de CV 2.75% 22/01/2020	USD	673,000	592,135	0.01							
Coca-Cola FEMSA SAB de CV 1.85% 01/09/2022	USD	1,500,000	1,165,210	0.02		サウジアラビア					
Grupo Televisa SAB 8.5% 11/03/2022	USD	263,000	209,757	0.01		Saudi Arabian Oil Co., 144A 1.35% 24/11/2022	USD	348,000	341,628	0.01	
Grupo Televisa SAB 6.12% 31/01/2046	USD	204,000	200,794	0.00		Saudi Arabian Oil Co., 144A 1.62% 24/11/2025	USD	691,000	631,747	0.01	
Mexico City Airport Trust, 144A 5.3% 31/07/2047	USD	210,000	182,043	0.00					973,375	0.02	
Mexico Government Bond 4.15% 28/03/2027	USD	1,000,000	979,014	0.02		シンガポール					
Mexico Government Bond 3.75% 11/01/2028	USD	2,317,000	2,203,533	0.05		BOC Aviation Ltd., 144A 3.5% 18/10/2024	USD	790,000	764,815	0.01	
						Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4.7% 18/06/2023	USD	2,305,000	2,290,698	0.05	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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(%)
Mixer Investment Enterprises Pte. Ltd. 5.1% 10/06/2023	USD	4,370,000	4,405,073	0.09	Lloyds Banking Group plc 4.5% 04/11/2024	USD	2,550,000	2,471,073	0.05
			7,460,566	0.15	Lloyds Banking Group plc 4.582% 10/12/2025	USD	600,000	574,162	0.01
スペイン					Lloyds Banking Group plc 4.375% 22/03/2028	USD	633,000	600,328	0.01
Banco Santander SA 2.746% 28/06/2025	USD	3,490,000	3,193,240	0.06	Lloyds Banking Group plc, FNN 1.627% 11/09/2027	USD	2,085,000	1,844,685	0.04
Banco Santander SA 5.147% 18/08/2025	USD	600,000	589,308	0.01	Lloyds Banking Group plc, FNN 5.871% 06/09/2029	USD	5,000,000	4,953,719	0.10
Banco Santander SA 1.849% 25/09/2026	USD	2,000,000	1,789,210	0.04	LSEGA Financing plc, 144A 2% 06/04/2028	USD	3,975,000	3,415,187	0.07
Banco Santander SA, FNN 1.732% 14/09/2027	USD	800,000	694,717	0.01	Nationwide Building Society, FNN, 144A 4.362% 01/03/2024	USD	3,300,000	3,293,401	0.07
Telefonos Emisores SA 4.865% 06/03/2028	USD	980,000	825,243	0.02	NatWest Group plc 4.8% 05/04/2026	USD	1,275,000	1,239,195	0.02
			7,091,718	0.14	NatWest Group plc, FNN 4.269% 22/03/2025	USD	640,000	628,749	0.01
スイス					NatWest Group plc, FNN 7.472% 10/11/2026	USD	2,510,000	2,565,026	0.05
Credit Suisse AG 0.52% 09/08/2023	USD	1,500,000	1,409,043	0.03	NatWest Group plc, FNN 5.847% 02/03/2027	USD	1,265,000	1,249,389	0.03
Credit Suisse AG 7.95% 09/01/2025	USD	3,490,000	3,556,961	0.07	NatWest Group plc, FNN 3.075% 22/05/2028	USD	2,535,000	2,276,421	0.05
Credit Suisse AG 3.7% 21/02/2025	USD	5,951,000	5,687,613	0.12	NatWest Group plc, FNN 4.892% 18/05/2029	USD	667,000	634,533	0.01
Credit Suisse AG 1.15% 01/08/2026	USD	713,000	612,886	0.01	NatWest Group plc, FNN 3.754% 01/11/2029	USD	1,500,000	1,408,109	0.03
UBS Group AG, FNN, 144A 2.593% 11/09/2025	USD	2,057,000	1,957,107	0.04	NatWest Group plc, FNN 4.445% 08/05/2030	USD	678,000	622,100	0.01
UBS Group AG 3.75% 26/03/2025	USD	1,778,000	1,699,722	0.04	NatWest Group plc, FNN 6.016% 02/03/2034	USD	1,750,000	1,753,484	0.04
			15,093,332	0.31	NatWest Markets plc, 144A 1.6% 29/09/2026	USD	1,420,000	1,345,235	0.03
イギリス					Santander UK Group Holdings plc, FNN 6.932% 21/11/2026	USD	3,771,000	3,778,791	0.08
Barclays plc, FNN 1.007% 10/12/2024	USD	3,467,000	3,385,460	0.07	Santander UK Group Holdings plc, FNN 1.672% 14/06/2027	USD	1,495,000	1,380,134	0.03
Barclays plc, FNN 5.829% 09/09/2027	USD	1,500,000	1,480,049	0.03	Santander UK Group Holdings plc, FNN 6.534% 10/01/2029	USD	4,200,000	4,221,306	0.09
Barclays plc, FNN 2.894% 26/11/2032	USD	1,171,000	915,518	0.02	Standard Chartered plc, FNN, 144A 3.785% 11/05/2025	USD	2,000,000	1,950,031	0.04
Barclays plc, FNN 6.224% 09/09/2034	USD	3,000,000	2,971,442	0.06	Standard Chartered plc, FNN, 144A 2.819% 24/01/2026	USD	1,770,000	1,669,853	0.03
EP Capital Markets plc 3.279% 19/09/2027	USD	461,000	434,059	0.01	Standard Chartered plc, FNN, 144A 1.456% 14/01/2027	USD	3,601,000	3,191,858	0.07
Diageo Capital plc 1.37% 29/09/2025	USD	1,780,000	1,637,036	0.03	Standard Chartered plc, FNN, 144A 0% 06/01/2027	USD	2,895,000	2,896,371	0.06
HSBC Holdings plc 6.5% 15/09/2017	USD	3,140,000	3,117,145	0.06					
HSBC Holdings plc 6.1% 14/01/2042	USD	3,155,000	3,314,412	0.07					
HSBC Holdings plc, FNN 3.803% 11/03/2025	USD	6,930,000	6,795,561	0.14					
HSBC Holdings plc, FNN 7.39% 03/11/2028	USD	2,460,000	2,595,246	0.05					
HSBC Holdings plc, FNN 2.206% 17/08/2029	USD	1,605,000	1,343,220	0.03					
HSBC Holdings plc, FNN 2.357% 18/08/2031	USD	2,870,000	2,280,257	0.05					
HSBC Holdings plc, FNN 6.254% 09/03/2034	USD	1,300,000	1,324,530	0.03					

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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(%)
Standard Chartered plc, 5.144%	USD	700,000	633,657	0.01	American Tower Corp., REIT 3.1%	USD	1,231,000	795,166	0.02
15/03/2023					15/04/2020				
Vodafone Group plc 5.625%	USD	345,000	304,218	0.01	American Tower Corp., REIT 3.95%	USD	804,000	502,961	0.01
10/02/2053					15/01/2051				
			82,323,950	1.70	American Water Capital Corp. 3.45%	USD	365,000	338,990	0.01
					01/06/2029				
アメリカ					American Water Capital Corp. 6.55%	USD	125,000	140,420	0.00
AbbVie, Inc. 3.2%	USD	4,396,000	3,974,294	0.08	15/10/2027				
AbbVie, Inc. 4.5%	USD	1,624,000	1,530,256	0.03	American Water Capital Corp. 4%	USD	375,000	299,412	0.01
AbbVie, Inc. 4.05%	USD	4,929,000	4,261,498	0.09	01/12/2046				
AbbVie, Inc. 4.4%	USD	1,200,000	1,061,643	0.02	American Water Capital Corp. 3.45%	USD	2,181,000	1,616,768	0.03
AbbVie, Inc. 4.25%	USD	1,560,000	1,330,477	0.03	01/05/2030				
Aetna, Inc. 6.75%	USD	300,000	328,819	0.01	Anheuser-Busch Cos. LLC 3.65%	USD	1,500,000	1,452,067	0.03
Aetna, Inc. 4.5%	USD	147,000	125,006	0.00	01/02/2026				
Air Lease Corp. 3.315%	USD	3,021,000	2,862,963	0.06	Anheuser-Busch Cos. LLC 4.7%	USD	3,903,000	3,774,400	0.08
Air Lease Corp. 2.815%	USD	2,500,000	2,311,943	0.05	01/02/2036				
Air Lease Corp. 2.75%	USD	958,000	904,821	0.02	Anheuser-Busch Indef Finance, Inc.	USD	150,000	136,697	0.00
Air Lease Corp. 1.815%	USD	3,125,000	2,768,825	0.06	4.82% 01/02/2044				
Air Lease Corp. 5.85%	USD	1,120,000	1,115,412	0.02	Anheuser-Busch Indef Worldwide, Inc.	USD	1,000,000	922,569	0.02
Air Lease Corp. 2.25%	USD	4,540,000	3,914,044	0.08	4.37% 15/04/2038				
Air Products and Chemicals, Inc. 1.85%	USD	3,000,000	2,698,132	0.06	Anheuser-Busch Indef Worldwide, Inc.	USD	1,314,000	1,205,518	0.02
15/05/2027					4.8% 15/04/2048				
Alabama Power Co. 5.7%	USD	150,000	153,276	0.00	Anheuser-Busch Indef Worldwide, Inc.	USD	1,280,000	1,143,664	0.02
Alabama Power Co. 6.125%	USD	179,000	191,257	0.00	4.41% 06/30/2048				
15/05/2038					Arizona Public Service Co. 5.45%	USD	210,000	190,582	0.00
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.8%	USD	214,000	204,466	0.00	01/09/2041				
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.9%	USD	1,347,000	1,255,874	0.03	Arrow Electronics, Inc. 3.25%	USD	469,000	452,660	0.01
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 4.9%	USD	2,000,000	1,932,043	0.04	08/09/2024				
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 1.87%	USD	2,690,000	1,961,480	0.04	Arrow Electronics, Inc. 3.87%	USD	761,000	701,777	0.01
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 4%	USD	1,016,000	752,616	0.02	12/01/2028				
AT&T, Inc. 2.3%	USD	5,180,000	4,657,393	0.10	AT&T, Inc. 1.65%	USD	495,000	416,167	0.01
AT&T, Inc. 1.65%	USD	495,000	416,167	0.01	AT&T, Inc. 2.35%	USD	3,220,000	2,546,132	0.05
AT&T, Inc. 2.35%	USD	3,220,000	2,546,132	0.05	AT&T, Inc. 5.4%	USD	1,040,000	1,033,264	0.04
AT&T, Inc. 5.4%	USD	1,040,000	1,033,264	0.04	AT&T, Inc. 3.5%	USD	1,382,000	1,051,677	0.02
AT&T, Inc. 3.5%	USD	1,382,000	1,051,677	0.02	AT&T, Inc. 3.65%	USD	3,168,000	2,298,010	0.05
AT&T, Inc. 3.65%	USD	3,168,000	2,298,010	0.05	AT&T, Inc. 3.55%	USD	1,332,000	921,150	0.02
AT&T, Inc. 3.55%	USD	1,332,000	921,150	0.02	AT&T, Inc. 3.8%	USD	246,000	175,802	0.00
AT&T, Inc. 3.8%	USD	246,000	175,802	0.00	Atmos Energy Corp. 4.1%	USD	690,000	592,652	0.01
Atmos Energy Corp. 4.1%	USD	690,000	592,652	0.01	15/01/2043				
Atmos Energy Corp. 4.125%	USD	780,000	654,258	0.01	15/03/2049				
Atmos Energy Corp. 4.125%	USD	780,000	654,258	0.01	AutotZone, Inc. 1.65%	USD	1,740,000	1,355,049	0.03
AutotZone, Inc. 1.65%	USD	1,740,000	1,355,049	0.03	15/01/2021				
Bank of America NA 6%	USD	1,800,000	1,913,087	0.04	Bank of America NA 6%	USD	1,800,000	1,913,087	0.04
Bank of America NA 6%	USD	1,800,000	1,913,087	0.04	15/10/2026				
Berkshire Hathaway Energy Co. 6.12%	USD	1,437,000	1,495,432	0.03	01/04/2026				
Berkshire Hathaway Energy Co. 4.2%	USD	312,000	282,536	0.01	Berkshire Hathaway Finance Corp. 4.2%	USD	312,000	282,536	0.01
Berkshire Hathaway Finance Corp. 4.2%	USD	312,000	282,536	0.01	15/05/2042				

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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	投資対象	通貨	株数/額面金額	時価 (米ドル)	純資産に
				占める					占める
				割合(%)					割合(%)
Berkshire Hathaway Finance Corp. 3.85% 15/02/2052	USD	2,640,000	2,154,384	0.04	Cleveland Electric Illuminating Co. (The) 5.95% 15/12/2055	USD	425,000	419,170	0.01
Boardwalk Pipelines LP 3.4% 15/02/2031	USD	1,610,000	1,383,053	0.03	OMS Energy Corp. 2.87% 01/02/2024	USD	1,200,000	1,183,099	0.02
Boston Scientific Corp. 4.55% 01/03/2039	USD	721,000	667,192	0.01	OMS Energy Corp. 3% 15/05/2028	USD	219,000	205,050	0.00
EP Capital Markets America, Inc. 3.01% 16/01/2027	USD	1,500,000	1,410,005	0.03	OMS Energy Corp. 2.95% 15/03/2027	USD	387,000	355,706	0.01
EP Capital Markets America, Inc. 4.89% 11/09/2033	USD	1,585,000	1,543,143	0.03	OM Financial Corp. 3.95% 15/04/2024	USD	173,000	170,110	0.00
EP Capital Markets America, Inc. 2.71% 10/11/2050	USD	2,000,000	1,310,608	0.03	Columbia Pipeline Group, Inc. 5.8% 01/06/2045	USD	1,550,000	1,516,286	0.03
EP Capital Markets America, Inc. 2.92% 04/06/2051	USD	2,200,000	1,488,995	0.03	Onagra Brands, Inc. 5.2% 01/11/2028	USD	330,000	315,567	0.01
Erismor Operating Partnership LP, REIT 3.83% 01/02/2025	USD	900,000	861,015	0.02	OnosePhillips Co. 5.2% 15/05/2053	USD	1,470,000	1,481,135	0.03
Brookfield Finance LLC 3.45% 15/04/2050	USD	1,080,000	710,760	0.01	Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 5.1% 15/06/2040	USD	173,000	172,904	0.00
Brown & Brown, Inc. 2.375% 15/03/2031	USD	4,620,000	3,713,008	0.08	Constellation Brands, Inc. 4.4% 15/11/2025	USD	475,000	465,161	0.01
Bunge Ltd. Finance Corp. 2.75% 14/05/2031	USD	3,310,000	2,782,379	0.06	Constellation Brands, Inc. 4.75% 09/05/2032	USD	390,000	377,274	0.01
Burlington Northern Santa Fe LLC 3.65% 01/09/2025	USD	560,000	543,048	0.01	Constellation Brands, Inc. 4.5% 09/05/2047	USD	490,000	421,393	0.01
Burlington Northern Santa Fe LLC 7.95% 15/08/2030	USD	250,000	290,858	0.01	Constellation Brands, Inc. 5.25% 15/11/2048	USD	280,000	247,117	0.00
Burlington Northern Santa Fe LLC 6.15% 01/05/2027	USD	870,000	957,443	0.02	Consumers Energy Co. 3.25% 15/08/2046	USD	190,000	139,138	0.00
Burlington Northern Santa Fe LLC 5.75% 01/05/2040	USD	700,000	736,263	0.02	Cozening, Inc. 3.9% 15/11/2049	USD	2,044,000	1,524,195	0.03
Burlington Northern Santa Fe LLC 3.55% 15/02/2050	USD	1,387,000	1,100,842	0.02	Corporate Office Properties LP, REIT	USD	660,000	583,158	0.01
Campbell Soup Co. 2.375% 24/04/2030	USD	955,000	803,645	0.02	Corporate Office Properties LP, REIT 2.75% 15/04/2031	USD	3,203,000	2,482,977	0.05
Campbell Soup Co. 3.125% 24/04/2050	USD	470,000	320,972	0.01	Crown Castle, Inc., REIT 4% 01/03/2027	USD	228,000	216,852	0.00
Capital One Financial Corp. 3.9% 29/01/2024	USD	810,000	800,148	0.02	CYS Health Corp. 4.2% 25/03/2028	USD	285,000	274,845	0.01
Capital One Financial Corp. 4.2% 29/10/2025	USD	350,000	334,278	0.01	CYS Health Corp. 5.25% 20/01/2031	USD	720,000	714,795	0.01
Caterpillar, Inc. 6.05% 15/08/2036	USD	355,000	389,280	0.01	CYS Health Corp. 5.25% 21/03/2033	USD	2,600,000	2,575,880	0.05
CenterPoint Energy Resources Corp. 5.8% 15/01/2041	USD	250,000	255,634	0.01	CYS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	USD	4,205,000	3,843,839	0.08
Chevron Corp. 1.995% 11/05/2027	USD	1,390,000	1,260,550	0.03	Danaher Corp. 2.6% 01/10/2050	USD	932,000	822,677	0.01
Citigroup, Inc. 3.2% 21/10/2026	USD	1,293,000	1,209,596	0.02	Dell International LLC 6.02% 15/06/2026	USD	3,730,000	3,787,987	0.08
Citigroup, Inc. 6.625% 15/01/2038	USD	500,000	527,544	0.01	Dell International LLC 5.25% 01/02/2028	USD	4,661,000	4,644,140	0.10
Cleveland Electric Illuminating Co. (The) 5.2% 15/08/2024	USD	400,000	399,165	0.01	Dominion Energy, Inc. 2.85% 15/08/2026	USD	183,000	169,203	0.00
					Dominion Energy, Inc. 4.9% 01/08/2041	USD	111,000	98,850	0.00
					Dominion Energy, Inc. 5.25% 01/08/2033	USD	785,000	771,498	0.02
					DTE Electric Co. 3.7% 15/03/2045	USD	308,000	244,512	0.00
					Duke Energy Carolinas LLC 6.45% 15/10/2032	USD	100,000	107,891	0.00
					Duke Energy Corp. 2.6% 01/09/2026	USD	810,000	747,986	0.02

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Duke Energy Indiana LLC 6.12% 15/10/2035	USD	150,000	156,241	0.00		Entergy Louisiana LLC 3.05% 01/06/2031	USD	314,000	271,290	0.01	
Duke Energy Indiana LLC 3.75% 15/05/2046	USD	350,000	269,708	0.01		Entergy Louisiana LLC 4% 15/03/2003	USD	330,000	298,663	0.01	
Duke Energy Ohio, Inc. 3.7% 15/06/2046	USD	265,000	199,896	0.00		Entergy Louisiana LLC 2.9% 15/03/2051	USD	1,040,000	680,452	0.01	
Duke Energy Progress LLC 4.1% 15/05/2042	USD	189,000	158,103	0.00		Entergy Mississippi LLC 3.85% 01/06/2049	USD	1,640,000	1,262,044	0.03	
Duke Energy Progress LLC 3.7% 15/10/2046	USD	431,000	333,594	0.01		Enterprise Products Operating LLC 7.55% 15/04/2038	USD	847,000	971,450	0.02	
Duke Energy Progress LLC 2.9% 15/08/2051	USD	1,255,000	828,996	0.02		Enterprise Products Operating LLC 3.2% 15/02/2052	USD	3,000,000	2,893,743	0.04	
DuPont de Nemours, Inc. 4.493% 15/11/2025	USD	2,000,000	1,957,834	0.04		Enterprise Products Operating LLC 5.75% 01/01/2025	USD	1,245,000	1,233,937	0.03	
DuPont de Nemours, Inc. 5.319% 15/11/2038	USD	2,230,000	2,193,714	0.05		BOM Midstream Partners LP 5.2% 15/07/2028	USD	1,250,000	1,182,011	0.02	
Eaton Corp. 7.625% 01/04/2024	USD	490,000	495,113	0.01		Essex Portfolio LP, REIT 2.65% 15/03/2032	USD	4,000,000	3,210,224	0.07	
Eaton Corp. 4.15% 15/03/2033	USD	146,000	138,217	0.00		Energy Metro, Inc. 4.2% 15/03/2040	USD	670,000	555,265	0.01	
Eaton Corp. 5.8% 15/03/2037	USD	100,000	101,075	0.00		Energys, Inc. 2.9% 15/09/2029	USD	1,775,000	1,547,774	0.03	
Edison International 1.5% 15/11/2024	USD	2,880,000	2,784,163	0.06		Exxon Mobil Corp. 2.99% 16/08/2009	USD	1,615,000	1,273,245	0.03	
Edison International 3.2% 15/11/2028	USD	2,225,000	2,163,443	0.04		Exxon Mobil Corp. 3.09% 16/08/2009	USD	2,010,000	1,458,936	0.03	
EIDP, Inc. 4.5% 15/05/2026	USD	2,684,000	2,631,991	0.05		Fidelity National Information Services, Inc. 4.2% 15/08/2046	USD	2,380,000	1,872,125	0.04	
Elevance Health, Inc. 3.35% 01/12/2024	USD	1,355,000	1,310,428	0.03		Fiserv, Inc. 3.2% 01/07/2026	USD	690,000	647,145	0.01	
Elevance Health, Inc. 4.101% 01/03/2028	USD	885,000	849,360	0.02		Fiserv, Inc. 4.4% 01/07/2049	USD	660,000	552,333	0.01	
Elevance Health, Inc. 4.625% 15/05/2042	USD	344,000	307,379	0.01		Florida Power & Light Co. 5.4% 01/09/2035	USD	700,000	700,601	0.01	
Elevance Health, Inc. 4.375% 01/12/2047	USD	201,000	173,245	0.00		Florida Power & Light Co. 5.2% 01/04/2053	USD	1,540,000	1,582,008	0.03	
Eli Lilly & Co. 4.9% 21/02/2063	USD	1,720,000	1,738,694	0.04		General Motors Financial Co., Inc. 1.2% 15/10/2024	USD	960,000	902,222	0.02	
Energy Transfer LP 3.2% 15/06/2034	USD	3,997,000	3,930,080	0.08		General Motors Financial Co., Inc. 1.2% 07/04/2025	USD	565,000	544,880	0.01	
Energy Transfer LP 4.75% 15/01/2036	USD	1,821,000	1,779,262	0.04		General Motors Financial Co., Inc. 1.2% 08/01/2026	USD	4,269,000	3,808,668	0.08	
Energy Transfer LP 3.2% 15/07/2036	USD	122,000	115,904	0.00		General Motors Financial Co., Inc. 5% 09/04/2027	USD	1,900,000	1,847,489	0.04	
Energy Transfer LP 4.4% 15/09/2027	USD	850,000	813,156	0.02		General Motors Financial Co., Inc. 5.2% 23/06/2028	USD	7,850,000	7,796,642	0.16	
Energy Transfer LP 4.95% 15/05/2038	USD	430,000	415,739	0.01		General Motors Financial Co., Inc. 2.35% 08/01/2031	USD	1,197,000	935,071	0.02	
Energy Transfer LP 4.15% 15/09/2029	USD	1,088,000	982,016	0.02		General Motors Financial Co., Inc. 2.3% 10/06/2031	USD	2,615,000	2,078,849	0.04	
Energy Transfer LP 6.2% 15/02/2042	USD	800,000	752,429	0.02		Global Payments, Inc. 4.8% 01/04/2026	USD	1,880,000	1,835,197	0.04	
Energy Transfer LP 6% 15/06/2048	USD	650,000	609,576	0.01		Global Payments, Inc. 3.2% 15/08/2029	USD	4,145,000	3,600,303	0.07	
Eni USA, Inc. 7.2% 15/11/2027	USD	1,030,000	1,101,477	0.02		Global Payments, Inc. 5.3% 15/08/2029	USD	710,000	690,950	0.01	
Entergy Corp. 2.95% 01/09/2038	USD	220,000	203,124	0.00							
Entergy Louisiana LLC 4.05% 01/09/2023	USD	239,000	238,251	0.00							
Entergy Louisiana LLC 2.4% 01/10/2026	USD	532,000	486,983	0.01							
Entergy Louisiana LLC 3.12% 01/09/2027	USD	320,000	295,215	0.01							
Entergy Louisiana LLC 3.25% 01/04/2028	USD	188,000	172,856	0.00							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Global Payments, Inc. 2.9% 15/05/2030	USD	488,000	412,674	0.01		Kroger Co. (The) 4.45% 01/02/2047	USD	1,220,000	1,049,634	0.02	
Global Payments, Inc. 2.9% 15/11/2031	USD	937,000	760,755	0.02		Lear Corp. 2.6% 15/01/2032	USD	865,000	670,872	0.01	
Global Sacks Group, Inc. (The) 4.25% 21/10/2025	USD	467,000	440,189	0.01		Lennar Corp. 4.5% 30/04/2024	USD	1,220,000	1,209,798	0.02	
Global Sacks Group, Inc. (The) 3.85% 26/01/2027	USD	1,830,000	1,738,769	0.04		Life Storage LP, REIT 4% 15/06/2029	USD	1,373,000	1,346,118	0.03	
Gulf Power Co. 3.3% 30/06/2027	USD	670,000	632,159	0.01		Life Storage LP, REIT 2.2% 15/10/2030	USD	2,940,000	2,351,266	0.05	
Haleon US Capital LLC 3.375% 24/03/2029	USD	1,970,000	1,788,788	0.04		Love's Cos., Inc. 1.7% 15/10/2030	USD	3,000,000	2,394,060	0.05	
Halliburton Co. 4.75% 01/08/2043	USD	430,000	374,149	0.01		Love's Cos., Inc. 5.7% 01/07/2023	USD	745,000	753,724	0.02	
Hanover Insurance Group, Inc. (The) 2.9% 01/09/2030	USD	1,420,000	1,116,960	0.02		LYB International Finance III LLC 1.2% 01/10/2025	USD	766,000	692,670	0.01	
Hartford Financial Services Group, Inc. (The) 6.1% 01/10/2041	USD	600,000	599,725	0.01		LYB International Finance III LLC 2.425% 01/04/2021	USD	2,705,000	1,855,036	0.04	
Hartford Financial Services Group, Inc. (The) 4.3% 15/04/2040	USD	500,000	406,725	0.01		Magellan Midstream Partners LP 3.2% 15/02/2025	USD	171,000	162,648	0.00	
HCA, Inc. 5.375% 01/02/2025	USD	1,880,000	1,882,637	0.04		Marathon Oil Corp. 6.2% 15/05/2022	USD	241,000	248,705	0.00	
HCA, Inc. 5.25% 15/06/2026	USD	3,300,000	3,259,856	0.07		Marke Group, Inc. 5% 05/04/2046	USD	1,000,000	867,340	0.02	
HCA, Inc. 5.625% 01/09/2028	USD	7,000,000	6,984,584	0.14		Martin Marietta Materials, Inc. 3.4% 01/09/2027	USD	666,000	626,563	0.01	
HCA, Inc. 4.125% 15/06/2029	USD	380,000	350,515	0.01		Masco Corp. 2% 01/10/2030	USD	840,000	662,209	0.01	
HCA, Inc. 5.5% 01/06/2033	USD	2,000,000	1,966,069	0.04		Masco Corp. 6.5% 15/08/2032	USD	1,000,000	1,029,348	0.02	
HCA, Inc. 5.125% 15/06/2039	USD	3,095,000	2,853,878	0.06		McDonald's Corp. 4.7% 09/12/2035	USD	547,000	527,381	0.01	
HCA, Inc. 5.5% 15/06/2047	USD	190,000	176,044	0.00		McDonald's Corp. 6.2% 15/10/2037	USD	179,000	196,340	0.00	
HCA, Inc. 3.5% 15/07/2051	USD	170,000	115,930	0.00		McKesson Corp. 5.1% 15/07/2033	USD	1,540,000	1,543,621	0.03	
Healthcare Realty Holdings LP, REIT 3.3% 15/02/2030	USD	1,161,000	992,823	0.02		Mid Holdings, Inc. 2.3% 15/01/2021	USD	2,210,000	1,735,346	0.04	
Healthcare Realty Holdings LP, REIT 2% 15/03/2031	USD	1,540,000	1,180,158	0.02		Merek & Co., Inc. 5% 17/05/2053	USD	1,760,000	1,763,183	0.04	
Healthpeak CP, LLC, REIT 3.4% 01/02/2025	USD	14,000	13,455	0.00		Merek & Co., Inc. 5.15% 17/05/2053	USD	1,370,000	1,383,217	0.03	
Healthpeak CP, LLC, REIT 3.5% 15/07/2029	USD	1,394,000	1,196,210	0.02		MetLife, Inc. 6.5% 15/12/2032	USD	616,000	672,357	0.01	
HF Sinclair Corp. 2.625% 01/10/2023	USD	2,385,000	2,345,601	0.05		Mid-America Apartments LP, REIT 4% 15/11/2025	USD	930,000	899,815	0.02	
HF Sinclair Corp. 5.875% 01/04/2026	USD	1,960,000	1,961,416	0.04		Mid-America Apartments LP, REIT 1.7% 15/02/2021	USD	1,470,000	1,158,888	0.02	
Home Depot, Inc. (The) 4.95% 15/09/2052	USD	1,639,000	1,614,194	0.03		Molson Coors Beverage Co. 4.2% 15/07/2046	USD	930,000	757,680	0.02	
Illinois Tool Works, Inc. 2.65% 15/11/2026	USD	900,000	842,678	0.02		Morgan Stanley 1.875% 29/04/2024	USD	2,697,000	2,657,578	0.05	
International Flavors & Fragrances, Inc. 3% 28/09/2048	USD	462,000	379,019	0.01		Morgan Stanley 1.875% 21/01/2026	USD	270,000	260,307	0.01	
Jersey Central Power & Light Co. 6.1% 01/06/2037	USD	320,000	330,063	0.01		Morgan Stanley 1.625% 20/01/2027	USD	681,000	646,109	0.01	
Kellogg Co. 5.25% 01/03/2033	USD	2,219,000	2,223,290	0.05		Morgan Stanley 4.3% 27/01/2045	USD	1,125,000	971,392	0.02	
Kinder Morgan Energy Partners LP 4.2% 01/05/2034	USD	5,000,000	4,933,328	0.10		Morgan Stanley, FRN 1.794% 13/02/2032	USD	2,080,000	1,608,767	0.03	
Kroger Co. (The) 2.2% 01/05/2036	USD	3,500,000	2,887,109	0.06		MPLX LP 4.875% 01/12/2024	USD	1,284,000	1,285,740	0.03	
Kroger Co. (The) 5.4% 15/07/2040	USD	114,000	109,257	0.00		MPLX LP 4.8% 15/02/2029	USD	362,000	348,691	0.01	
						Nevada Power Co. 3.7% 01/05/2029	USD	1,600,000	1,482,049	0.03	
						Nevada Power Co. 6.65% 01/04/2036	USD	200,000	216,223	0.00	
						Nevada Power Co. 5.375% 15/09/2040	USD	365,000	348,006	0.01	
						NiSource, Inc. 2.95% 01/09/2029	USD	615,000	537,985	0.01	
						NiSource, Inc. 1.7% 15/02/2031	USD	1,830,000	1,426,902	0.03	
						NiSource, Inc. 5.8% 01/02/2042	USD	628,000	604,228	0.01	
						NNN REIT, Inc., REIT 4% 15/11/2025	USD	583,000	554,039	0.01	
						NNN REIT, Inc., REIT 3.6% 15/12/2026	USD	1,000,000	929,992	0.02	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Occidental Petroleum Corp. 5% 15/02/2027	USD	2,000,000	1,800,826	0.04		Realty Income Corp., REIT 3.815% 15/04/2025	USD	255,000	247,429	0.00	
Ohio Edison Co. 6.875% 15/07/2036	USD	350,000	394,096	0.01		Realty Income Corp., REIT 4.85% 15/03/2030	USD	2,160,000	2,087,406	0.04	
ONE Gas, Inc. 2% 15/05/2030	USD	2,060,000	1,705,084	0.03		Realty Income Corp., REIT 3.25% 15/01/2021	USD	1,490,000	1,291,493	0.03	
ONEOK Partners LP 6.6% 01/10/2036	USD	910,000	932,653	0.02		Reliance Steel & Aluminum Co. 2.15% 15/08/2030	USD	3,330,000	2,788,327	0.06	
ONEOK, Inc. 2.2% 15/09/2025	USD	2,750,000	2,544,606	0.05		Republic Services, Inc. 5% 01/04/2034	USD	980,000	973,085	0.02	
Oracle Corp. 4.9% 06/02/2053	USD	2,450,000	2,364,023	0.05		Resolution Funding Corp Discount Notes Zero Cpn 0% 15/04/2030	USD	200,000	149,461	0.00	
Oracle Corp. 3.6% 01/04/2040	USD	1,800,000	1,383,106	0.03		Resolution Funding Corp. 0% 15/01/2030	USD	4,000,000	3,808,825	0.06	
Oracle Corp. 4% 15/07/2046	USD	1,070,000	813,105	0.02		Safelord Oil Holdings LLC, REIT 2.8% 15/06/2021	USD	5,000,000	3,876,287	0.08	
Oracle Corp. 5.55% 06/02/2053	USD	1,730,000	1,657,514	0.03		San Diego Gas & Electric Co. 6.125% 15/09/2037	USD	150,000	153,177	0.00	
Oracle Corp. 4.375% 15/06/2055	USD	940,000	745,308	0.02		San Diego Gas & Electric Co. 3.95% 15/11/2041	USD	218,000	172,309	0.00	
Pacific Gas and Electric Co. 1.7% 15/11/2021	USD	1,390,000	1,366,168	0.03		Sempra Energy 5.4% 01/08/2026	USD	2,220,000	2,208,100	0.05	
Pacific Gas and Electric Co. 2.95% 01/02/2026	USD	4,765,000	4,365,555	0.09		Sherwin-Williams Co. (The) 4.55% 01/08/2045	USD	1,821,000	1,536,612	0.03	
Pacific Gas and Electric Co. 3.75% 15/08/2042	USD	451,000	309,977	0.01		Simon Property Group LP, REIT 1.25% 12/09/2049	USD	1,518,000	1,012,687	0.02	
Pacific Gas and Electric Co. 4.7% 15/03/2045	USD	770,000	545,541	0.01		SITE Centers Corp., REIT 3.625% 01/02/2025	USD	345,000	324,754	0.01	
Pacific Gas and Electric Co. 4% 01/12/2046	USD	1,500,000	1,000,234	0.02		Southern California Edison Co. 3.6% 01/03/2028	USD	800,000	746,580	0.02	
Pacific Gas and Electric Co. 6.75% 15/01/2051	USD	1,000,000	977,304	0.02		Southern California Edison Co. 6% 15/01/2034	USD	150,000	154,980	0.00	
PacificCorp 4.15% 15/02/2050	USD	1,600,000	1,225,965	0.03		Southern California Edison Co. 5.9% 15/01/2036	USD	530,000	524,838	0.01	
PacificCorp 5.5% 15/05/2054	USD	90,000	90,948	0.00		Southern California Edison Co. 4.0% 15/03/2042	USD	900,000	722,980	0.01	
Packaging Corp. of America 4.05% 15/12/2049	USD	1,585,000	1,238,054	0.03		Southern California Edison Co. 5.875% 01/12/2053	USD	2,797,000	2,823,027	0.06	
Parkeo-Hannifin Corp. 4.1% 01/03/2047	USD	416,000	352,100	0.01		Southern California Gas Co. 2.55% 01/02/2030	USD	2,260,000	1,939,807	0.04	
Phillips 66 4.875% 15/11/2044	USD	85,000	77,330	0.00		Southern Co. Gas Capital Corp. 2.45% 01/10/2023	USD	153,000	151,731	0.00	
Pioneer Natural Resources Co. 1.5% 15/08/2030	USD	2,580,000	2,087,551	0.04		Southern Co. Gas Capital Corp. 5.875% 15/03/2041	USD	550,000	550,924	0.01	
PNC Bank NA 3.25% 01/06/2025	USD	750,000	714,917	0.01		Southern Co. Gas Capital Corp. 4.4% 01/06/2043	USD	167,000	137,426	0.00	
PPL Electric Utilities Corp. 5.2% 15/05/2053	USD	1,785,000	1,792,453	0.04		Southern Co. Gas Capital Corp. 3.95% 01/10/2046	USD	188,000	144,150	0.00	
Precision Castparts Corp. 4.2% 15/06/2025	USD	350,000	227,982	0.00		Southern Natural Gas Co. LLC 8% 01/02/2032	USD	624,000	715,664	0.01	
Precision Castparts Corp. 4.375% 15/06/2045	USD	350,000	222,073	0.00							
Progress Energy, Inc. 7% 30/10/2031	USD	300,000	327,969	0.01							
Prologis LP, REIT 2.12% 15/10/2030	USD	525,000	292,292	0.01							
Public Storage, REIT 1.9% 09/11/2028	USD	1,394,000	1,094,527	0.02							
Public Storage, REIT 2.2% 09/11/2031	USD	1,062,000	865,803	0.02							
Quanta Services, Inc. 2.35% 15/01/2032	USD	2,295,000	1,801,900	0.04							
Quest Diagnostics, Inc. 3.5% 30/03/2025	USD	4,000,000	3,856,846	0.08							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Southern Power Co. 5.15% 15/09/2041	USD	871,000	810,226	0.02		US Treasury 0.875% 30/06/2026	USD	27,356,000	24,639,100	0.51	
Southwest Gas Corp. 3.8% 29/09/2046	USD	442,000	318,481	0.01		US Treasury 0.875% 30/09/2026	USD	1,793,700	1,603,960	0.03	
Targa Resources Corp. 4.2% 01/02/2033	USD	590,000	520,185	0.01		US Treasury 1.75% 31/12/2026	USD	18,861,000	17,265,561	0.36	
Tennessee Valley Authority 5.83% 01/04/2036	USD	2,548,000	2,887,112	0.06		US Treasury 2.25% 15/02/2027	USD	1,460,000	1,357,002	0.03	
Tennessee Valley Authority 4.625% 15/09/2040	USD	433,000	415,687	0.01		US Treasury 0.5% 30/04/2027	USD	42,000,000	36,378,398	0.75	
Tennessee Valley Authority 4.25% 15/09/2045	USD	438,000	389,670	0.01		US Treasury 2.75% 31/07/2027	USD	146,658,000	138,167,877	2.85	
Thermo Fisher Scientific, Inc. 2.8% 15/10/2041	USD	805,000	593,455	0.01		US Treasury 3.125% 31/08/2027	USD	13,825,000	13,213,596	0.27	
T-Mobile USA, Inc. 1.75% 15/04/2027	USD	2,000,000	1,880,944	0.04		US Treasury 2.25% 15/11/2027	USD	40,000,000	36,815,635	0.76	
T-Mobile USA, Inc. 3.87% 15/04/2030	USD	8,485,000	7,807,954	0.16		US Treasury 3.875% 30/11/2027	USD	15,000,000	14,777,061	0.30	
Toledo Edison Co. (The) 6.15% 15/05/2037	USD	600,000	623,406	0.01		US Treasury 3.875% 31/12/2027	USD	30,000,000	29,555,859	0.61	
Trust Financial Corp. 4% 01/06/2025	USD	498,000	394,115	0.01		US Treasury 1.25% 31/03/2028	USD	20,065,000	17,542,375	0.36	
UDR, Inc., REIT 2.9% 01/09/2036	USD	376,000	253,490	0.01		US Treasury 1.25% 30/04/2028	USD	67,170,000	58,604,513	1.21	
UDR, Inc., REIT 3.5% 15/01/2028	USD	1,380,000	1,261,326	0.03		US Treasury 2.875% 15/05/2028	USD	7,360,400	6,938,183	0.14	
UDR, Inc., REIT 3% 15/08/2031	USD	460,000	388,223	0.01		US Treasury 1.25% 30/06/2028	USD	24,971,500	21,714,475	0.45	
UDR, Inc., REIT 2.1% 01/08/2032	USD	1,520,000	1,152,710	0.02		US Treasury 2.75% 31/05/2029	USD	775,000	720,659	0.01	
Union Carbide Corp. 7.7% 01/10/2096	USD	650,000	765,047	0.02		US Treasury 3.25% 30/06/2029	USD	23,000,000	21,974,883	0.45	
Union Electric Co. 2.9% 15/06/2027	USD	715,000	665,419	0.01		US Treasury 2.625% 31/07/2029	USD	12,835,000	11,181,817	0.23	
Union Pacific Corp. 3.9% 15/09/2039	USD	900,000	723,670	0.01		US Treasury 3.125% 31/08/2029	USD	13,645,000	12,944,095	0.27	
UnitedHealth Group, Inc. 5.25% 15/02/2028	USD	2,000,000	2,038,229	0.04		US Treasury 4% 31/10/2029	USD	19,645,000	19,565,960	0.40	
UnitedHealth Group, Inc. 4.625% 15/07/2035	USD	396,000	385,813	0.01		US Treasury 1.75% 15/11/2029	USD	2,410,000	2,189,974	0.04	
UnitedHealth Group, Inc. 3.5% 15/08/2039	USD	1,495,000	1,246,470	0.03		US Treasury 3.875% 30/11/2029	USD	20,000,000	19,788,281	0.41	
UnitedHealth Group, Inc. 5.875% 15/02/2031	USD	1,095,000	1,202,576	0.02		US Treasury 1.5% 15/02/2030	USD	27,330,000	23,370,353	0.48	
UnitedHealth Group, Inc. 5.05% 15/04/2033	USD	2,890,000	2,844,006	0.06		US Treasury 0.625% 15/08/2030	USD	2,715,000	2,158,902	0.04	
US Treasury 1.375% 31/08/2023	USD	4,000,000	3,975,088	0.08		US Treasury 1.625% 15/05/2031	USD	12,825,000	10,877,955	0.22	
US Treasury 1.625% 31/10/2023	USD	5,000,000	4,939,923	0.10		US Treasury 1.25% 15/08/2031	USD	11,390,000	9,326,230	0.19	
US Treasury 2.125% 29/02/2024	USD	17,730,000	17,351,717	0.36		US Treasury 1.75% 15/11/2031	USD	11,322,000	9,313,230	0.19	
US Treasury 2.5% 15/05/2024	USD	369,000	359,704	0.01		US Treasury 1.875% 15/02/2032	USD	41,900,000	35,799,949	0.74	
US Treasury 2% 30/06/2024	USD	1,068,000	1,032,338	0.02		US Treasury 2.875% 15/05/2032	USD	53,995,000	49,934,829	1.03	
US Treasury 1.75% 31/12/2024	USD	22,454,000	21,342,702	0.44		US Treasury 2.75% 15/08/2032	USD	51,170,000	46,779,574	0.96	
US Treasury 4.25% 31/12/2024	USD	20,000,000	19,718,359	0.41		US Treasury 3.5% 15/02/2033	USD	21,880,000	21,252,659	0.44	
US Treasury 2.125% 15/05/2025	USD	50,695,000	48,139,457	0.99		US Treasury 4.375% 15/02/2038	USD	1,830,000	1,936,905	0.04	
US Treasury 2% 15/08/2025	USD	10,000,000	9,482,617	0.19		US Treasury 3.5% 15/02/2039	USD	1,449,500	1,381,923	0.03	
US Treasury 0.375% 31/01/2026	USD	15,800,000	14,179,574	0.29		US Treasury 4.25% 15/05/2039	USD	6,800,000	7,072,531	0.15	
US Treasury 1.625% 15/02/2026	USD	639,100	592,164	0.01		US Treasury 4.375% 15/11/2039	USD	35,000,000	36,859,375	0.76	
US Treasury 0.5% 28/02/2026	USD	56,600,000	50,827,242	1.05		US Treasury 1.125% 15/05/2040	USD	11,045,000	7,186,336	0.15	
US Treasury 2.5% 28/02/2026	USD	1,565,000	1,482,990	0.03		US Treasury 3.875% 15/08/2040	USD	1,250,000	1,232,861	0.03	
US Treasury 0.75% 30/04/2026	USD	980,000	882,134	0.02		US Treasury 4.25% 15/11/2040	USD	6,500,000	6,714,885	0.14	
						US Treasury 1.875% 15/02/2041	USD	33,400,000	24,889,098	0.50	
						US Treasury 4.75% 15/02/2041	USD	3,000,000	3,291,680	0.07	
						US Treasury 2.25% 15/05/2041	USD	4,800,000	3,670,687	0.08	
						US Treasury 1.75% 15/08/2041	USD	54,895,000	38,286,046	0.79	
						US Treasury 2.125% 15/11/2041	USD	2,305,000	1,674,637	0.03	
						US Treasury 2.375% 15/02/2042	USD	30,660,000	23,689,042	0.49	
						US Treasury 3.25% 15/05/2042	USD	12,000,000	10,628,203	0.22	
						US Treasury 3.375% 15/08/2042	USD	12,000,000	10,811,016	0.22	
						US Treasury 2.75% 15/11/2042	USD	188,765,000	83,857,731	1.71	
						US Treasury 3.125% 15/02/2043	USD	7,800,000	6,750,809	0.14	
						US Treasury 3.875% 15/05/2043	USD	695,000	672,738	0.01	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Macquarie Group Ltd., FPN, 144A 5.03% 15/01/2030	USD	4,000,000	3,914,638	0.08		Brookfield Finance, Inc. 3.9% 25/01/2028	USD	432,000	391,063	0.01	
National Australia Bank Ltd., 144A 2.33% 21/03/2030	USD	1,660,000	1,297,890	0.03		Brookfield Finance, Inc. 4.7% 20/09/2047	USD	69,000	57,448	0.00	
National Australia Bank Ltd., FPN, 144A 1.93% 02/09/2034	USD	1,795,000	1,539,097	0.03		Canadian Imperial Bank of Commerce 3.1% 02/04/2024	USD	500,000	498,786	0.01	
National Australia Bank Ltd. 3.5% 09/06/2025	USD	4,930,000	4,765,693	0.10		CGI, Inc. 2.3% 14/09/2031	USD	3,025,000	2,366,050	0.05	
Newcrest Finance Pty. Ltd., 144A 3.25% 17/05/2030	USD	955,000	844,759	0.02		Element Fleet Management Corp., 144A 6.21% 26/06/2035	USD	6,745,000	6,722,122	0.14	
Scotrex Group Trust 1, BEIT, 144A 3.5% 12/02/2025	USD	1,700,000	1,631,058	0.03		Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 144A 5.7% 14/03/2028	USD	1,900,000	1,897,977	0.04	
Scotrex Group Trust 2, BEIT, FPN, 144A 4.7% 26/09/2030	USD	4,055,000	3,635,307	0.08		Nutrien Ltd. 4% 15/12/2026	USD	850,000	815,494	0.02	
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd., 144A 3.37% 30/04/2025	USD	1,200,000	1,149,502	0.02		Nutrien Ltd. 4.12% 15/03/2035	USD	500,000	437,673	0.01	
Westpac Banking Corp. 3.13% 18/11/2041	USD	1,789,000	1,205,143	0.03		Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust, 144A 3.87% 20/03/2027	USD	804,000	742,011	0.01	
Westpac Banking Corp., FPN 4.32% 21/11/2031	USD	3,920,000	3,630,676	0.07		Province of Quebec Canada 8.32% 30/01/2026	USD	270,000	277,406	0.00	
						Schlumberger Finance Canada Ltd. 1.4% 17/09/2025	USD	2,950,000	2,714,422	0.06	
			31,497,412	0.65				26,644,949	0.74		
バミューダ						ケイマン諸島					
Triton Container International Ltd., 144A 1.1% 07/09/2024	USD	2,005,000	1,899,457	0.04		Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 5.25% 15/05/2024	USD	2,915,000	2,862,260	0.06	
			1,899,457	0.04		Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 2.87% 19/02/2025	USD	3,209,000	2,994,963	0.06	
カナダ						アバロン					
Air Canada Pass-Through Trust 'K', 144A 3.0% 15/09/2028	USD	4,073,736	3,770,021	0.08		Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 5.5% 15/01/2026	USD	10,316,000	9,992,753	0.21	
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2019-1 'K', 144A 4.02% 15/11/2026	USD	546,904	519,559	0.01		Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 2.12% 20/02/2026	USD	1,380,000	1,225,480	0.03	
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2019-1 'K', 144A 3.55% 15/07/2031	USD	1,930,157	1,664,760	0.03		Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 4.25% 15/04/2026	USD	1,830,000	1,707,866	0.03	
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2019-2 'M', 144A 3.3% 15/07/2031	USD	630,302	564,229	0.01		Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 4.37% 01/05/2026	USD	605,000	564,883	0.01	
Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 3.42% 11/05/2041	USD	1,190,000	853,903	0.02		Avalon Holdings Funding Ltd., 144A 2.52% 18/11/2027	USD	13,361,000	11,272,797	0.23	
Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 3.5% 25/01/2030	USD	2,525,000	1,823,263	0.04		BBDO Funding Trust, Series 2017-1A 'A2', 144A 4.48% 20/09/2047	USD	1,607,467	1,449,384	0.03	
Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 3.82% 11/05/2031	USD	1,325,000	904,332	0.02		Park Aerospace Holdings Ltd., 144A 5.5% 15/02/2024	USD	368,000	363,886	0.01	
Bank of Montreal 3.3% 05/02/2034	USD	1,200,000	1,181,050	0.02		Reneq, Series 2017-1A 'A', 144A 3.6% 20/09/2032	USD	770,791	669,887	0.01	
Bank of Montreal 1.85% 01/05/2025	USD	1,950,000	1,821,448	0.04				33,694,179	0.68		
Bank of Montreal 5.3% 01/06/2026	USD	2,700,000	2,692,512	0.05		デンマーク					
Bank of Montreal, FPN 3.803% 15/12/2032	USD	433,000	380,963	0.01		Danske Bank A/S, FPN, 144A 6.46% 09/01/2026	USD	4,090,000	4,081,618	0.08	
Bank of Nova Scotia (The) 4.85% 01/02/2020	USD	3,064,000	2,956,794	0.06				4,081,618	0.08		

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)		
フィンランド						Tota Energies Capital International SA 2.98% 25/06/2041	USD	2,750,000	2,079,215	0.04		
Nordea Bank Abp, 1444 3.0% 06/06/2025	USD	6,300,000	6,031,467	0.13					55,982,583	1.15		
Nordea Bank Abp, 1444 5.375% 22/09/2027	USD	3,587,000	3,540,615	0.07								
			9,572,082	0.20		ドイツ						
						Deutsche Bank AG, FRN 2.222% 18/09/2024	USD	3,955,000	3,906,819	0.08		
						Deutsche Bank AG, FRN 2.128% 24/11/2026	USD	1,940,000	1,721,306	0.04		
						Deutsche Bank AG, FRN 6.72% 18/01/2029	USD	1,050,000	1,050,655	0.02		
						Deutsche Telekom AG, 1444 3.625% 21/01/2030	USD	799,000	600,986	0.01		
									7,279,766	0.15		
フランス						香港						
Air Liquide Finance SA, 1444 2.25% 27/06/2021	USD	578,000	573,368	0.01		ATA Group Ltd., 1444 3.6% 09/04/2029	USD	595,000	550,697	0.01		
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1444 4.91% 26/01/2026	USD	2,350,000	2,207,170	0.04					550,697	0.01		
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1444 1.60% 04/10/2026	USD	2,045,000	2,511,840	0.05								
BNP Paribas SA, FRN, 1444 2.21% 03/06/2026	USD	1,422,000	1,315,559	0.03								
BNP Paribas SA, FRN, 1444 1.32% 12/01/2021	USD	848,000	752,361	0.02								
BNP Paribas SA, FRN, 1444 3.22% 12/06/2021	USD	2,500,000	2,464,423	0.05								
BNP Paribas SA, FRN, 1444 2.19% 15/09/2021	USD	3,415,000	2,836,433	0.06		アイルランド						
BNP Paribas SA, FRN, 1444 3.12% 20/01/2021	USD	1,438,000	1,177,753	0.02		AIB Group plc, FRN, 1444 4.28% 10/04/2025	USD	4,650,000	4,544,049	0.09		
BPCE SA, 1444 4.62% 11/07/2024	USD	1,100,000	1,072,284	0.02		Bank of Ireland Group plc, FRN, 1444 6.25% 16/09/2026	USD	2,366,000	2,350,152	0.05		
BPCE SA, 1444 1% 20/01/2026	USD	3,415,000	3,039,938	0.06					6,894,201	0.14		
BPCE SA, FRN, 1444 1.852% 06/10/2026	USD	1,734,000	1,556,091	0.03								
BPCE SA, FRN, 1444 5.975% 18/01/2027	USD	8,100,000	8,033,599	0.17		イスラエル						
BPCE SA, FRN, 1444 2.277% 20/01/2032	USD	2,495,000	1,923,914	0.04		Israel Government Bond 5.5% 18/09/2033	USD	1,600,000	1,041,909	0.04		
BPCE SA, FRN, 1444 3.116% 19/10/2032	USD	2,890,000	2,222,280	0.05					1,041,909	0.04		
Credit Agricole SA, 1444 3.811% 11/01/2041	USD	1,355,000	890,679	0.02		イタリア						
Credit Agricole SA, FRN, 1444 1.24% 26/01/2027	USD	6,207,000	5,499,224	0.11		Eni SpA, 1444 4% 12/09/2023	USD	320,000	318,668	0.01		
Societe Generale SA, 1444 4.351% 12/06/2025	USD	5,000,000	4,834,888	0.10		UniCredit SpA, FRN, 1444 2.58% 22/09/2026	USD	2,800,000	2,528,825	0.05		
Societe Generale SA, 1444 5% 22/01/2030	USD	384,000	304,520	0.01		UniCredit SpA, FRN, 1444 1.98% 03/08/2027	USD	510,000	446,119	0.01		
Societe Generale SA, FRN, 1444 1.48% 14/12/2026	USD	9,442,000	8,298,404	0.17		UniCredit SpA, FRN, 1444 5.861% 19/08/2032	USD	1,400,000	1,272,658	0.03		
Societe Generale SA, FRN, 1444 1.79% 09/06/2027	USD	885,000	756,489	0.02		UniCredit SpA, FRN, 1444 7.29% 02/04/2034	USD	710,000	667,327	0.01		
Societe Generale SA, FRN, 1444 2.88% 09/06/2032	USD	2,085,000	1,632,151	0.03					5,233,597	0.11		
						日本						
						Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., FRN 5.24% 19/04/2029	USD	1,055,000	1,037,594	0.02		

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., FDN 5.44% 22/02/2024	USD	1,870,000	1,858,863	0.04		Sumitomo Financieringsmaatschappij N.V., 144A 2.33% 15/10/2026	USD	500,000	459,824	0.01	
Ninbo Financial Group, Inc., FDN 2.555% 11/09/2025	USD	3,000,000	2,866,214	0.06		Sumitomo Financieringsmaatschappij N.V., 144A 4.45% 27/05/2045	USD	250,000	229,175	0.01	
Ninbo Financial Group, Inc., FDN 2.238% 15/05/2026	USD	1,675,000	1,553,470	0.03					14,887,586	0.31	
Ninbo Financial Group, Inc., FDN 2.869% 11/09/2020	USD	1,872,000	1,583,483	0.03		ニュージーランド Bank of New Zealand, 144A 3.5% 20/02/2024	USD	620,000	609,832	0.01	
Ninbo Financial Group, Inc., FDN 5.728% 11/05/2021	USD	3,210,000	3,196,565	0.07					609,832	0.01	
ORIX Corp. 3.7% 18/07/2027	USD	500,000	470,707	0.01		ノルウェー Aker BP ASA, 144A 3% 15/07/2026	USD	701,000	630,347	0.01	
Santama Life Insurance Co., FDN, 144A 4% 14/09/2027	USD	1,000,000	923,712	0.02		DNB Bank ASA, FDN, 144A 5.896% 09/10/2026	USD	4,200,000	4,185,914	0.09	
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 5% 26/11/2028	USD	2,065,000	2,045,948	0.04					4,796,261	0.10	
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.025% 09/07/2040	USD	3,175,000	2,385,766	0.05							
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.175% 09/07/2030	USD	1,480,000	1,037,738	0.02		パナマ Banco Nacional de Panama, 144A 2.5% 11/09/2030	USD	3,850,000	2,483,512	0.05	
			18,960,060	0.39					2,483,512	0.05	
ジャージー Galaxy Pipeline Assets Biko Ltd., 144A 2.94% 20/09/2040	USD	2,279,640	1,834,763	0.04		国際機関 NXP BV 2.5% 11/06/2031	USD	2,975,000	2,419,305	0.05	
			1,834,763	0.04		NXP BV 3.25% 11/06/2041	USD	3,860,000	2,211,366	0.05	
ルクセンブルク nVent Finance SARL 4.55% 15/04/2028	USD	900,000	841,826	0.02		NXP BV 3.25% 30/11/2051	USD	1,565,000	1,833,907	0.02	
Swiss Re Finance Luxembourg SA, FDN, 144A 5% 02/04/2049	USD	1,000,000	950,881	0.02		スウェーデン Svenska Handelsbanken AB, 144A 5.5% 15/06/2028	USD	2,000,000	1,959,049	0.04	
			1,792,797	0.04					1,959,049	0.04	
オランダ ABN AMRO Bank NV, FDN, 144A 2.41% 13/12/2029	USD	2,200,000	1,841,607	0.04		スイス UBS Group AG, 144A 4.282% 09/01/2028	USD	594,000	547,538	0.01	
Airbus SE, 144A 3.95% 10/04/2047	USD	210,000	176,840	0.00		UBS Group AG, FDN, 144A 2.193% 05/06/2026	USD	1,870,000	984,400	0.02	
Coöperatieve Rabobank UA, FDN, 144A 5.964% 28/02/2029	USD	6,500,000	6,407,315	0.13		UBS Group AG, FDN, 144A 1.305% 02/02/2027	USD	2,000,000	1,741,250	0.04	
Coöperatieve Rabobank UA 4.315% 04/06/2025	USD	501,000	483,778	0.01		UBS Group AG, FDN, 144A 3.091% 14/05/2032	USD	1,860,000	1,494,845	0.03	
Coöperatieve Rabobank UA 3.75% 21/07/2026	USD	1,257,000	1,170,654	0.02					4,788,033	0.10	
EDF Finance BV, 144A 3.625% 15/07/2024	USD	2,740,000	2,669,575	0.06		イギリス AstraZeneca plc 6.45% 15/09/2027	USD	520,000	594,189	0.01	
Enel Finance International NV, 144A 3.5% 06/04/2028	USD	745,000	681,302	0.01		AstraZeneca plc 4% 18/09/2042	USD	430,000	379,414	0.01	
Sumitomo Financieringsmaatschappij N.V., 144A 1.12% 15/09/2024	USD	700,000	687,526	0.02		AstraZeneca plc 2.125% 06/06/2050	USD	1,210,000	744,702	0.01	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)	割合(%)					割合(%)	割合(%)
Royalal Home plc 1.2% 02/09/2025	USD	1,057,000	953,188	0.02		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR1 'K', 1444 3.67%	USD	12,267,363	11,838,883	0.24	
Vodafone Group plc 4.875% 19/06/2049	USD	2,550,000	2,340,140	0.05		American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFR1 'A', 1444 3.46%	USD	6,098,486	5,834,646	0.12	
			4,911,633	0.10							
アメリカ											
F-Eleven, Inc., 1444 1.8% 10/02/2021	USD	1,230,000	971,039	0.02		American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFR2 'K', 1444 3.73%	USD	1,365,781	1,309,835	0.03	
F-Eleven, Inc., 1444 2.5% 10/02/2041	USD	1,250,000	836,084	0.02							
AbbVie, Inc. 4.95% 15/03/2035	USD	500,000	473,008	0.01							
Activision Blizzard, Inc. 1.15% 15/09/2030	USD	1,062,000	845,175	0.02		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR3 'B', 1444 4.20%	USD	750,000	727,465	0.02	
Advocate Health & Hospitals Corp. 2.21% 15/06/2030	USD	1,300,000	1,089,240	0.02		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR2 'C', 1444 4.70%	USD	3,000,000	2,881,657	0.06	
AEP Transmission Co. LLC 4% 01/12/2046	USD	467,000	389,835	0.01		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR3 'C', 1444 4.70%	USD	1,300,000	1,269,481	0.03	
AEP Transmission Co. LLC 3.8% 15/06/2049	USD	615,000	480,679	0.01							
AIG SunAmerica Global Financing I, 1444 6.9% 15/03/2032	USD	650,000	693,000	0.01		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR3 'C', 1444 4.96%	USD	500,000	486,486	0.01	
Air Lease Corp. 2.875% 01/07/2033	USD	925,000	925,000	0.02							
Alexander Funding Trust, 1444 1.94% 15/11/2033	USD	2,000,000	1,956,432	0.04		American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFR2 'C', 1444 4.69%	USD	1,893,000	1,833,735	0.04	
Alternative Loan Trust, Series 2005-940 '1A1' 5.5% 25/11/2036	USD	80,789	77,120	0.00							
Alternative Loan Trust, Series 2005-2028 '1A4' 5.5% 25/08/2035	USD	84,143	72,378	0.00		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR2 'B', 1444 5.04% 17/12/2036	USD	523,000	509,405	0.01	
Alternative Loan Trust, Series 2004-203 '1A9' 5.15% 25/03/2034	USD	348,720	245,820	0.01							
Alternative Loan Trust, Series 2004-2028 '1A1' 6% 25/01/2035	USD	20,206	17,951	0.00		American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFR2 'D', 1444 5.03%	USD	4,103,000	3,995,990	0.08	
Alternative Loan Trust, III, FIM, Series 2005-2023 '1A3' 6% 25/07/2035	USD	390,929	15,210	0.00							
Amazon.com, Inc. 1.875% 22/09/2037	USD	1,000,000	906,901	0.02		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR2 'E', 1444 6.23%	USD	6,100,000	6,023,366	0.12	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2014-1 'A' 3.7% 01/04/2038	USD	1,379,207	1,230,942	0.03							
American Airlines Pass-Through Trust 'A' 1.6% 22/03/2029	USD	5,988,204	5,524,118	0.11		American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR3 'E', 1444 6.41%	USD	7,475,000	7,386,180	0.15	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-2 'A' 1.2% 15/12/2029	USD	5,994,200	5,394,780	0.11		American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFR1 'E', 1444 5.63%	USD	7,664,000	7,497,031	0.15	
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-1 'A' 1% 15/04/2030	USD	737,038	655,964	0.01							
American Electric Power Co., Inc. 5.625% 01/03/2033	USD	2,140,000	2,158,719	0.04		American Homes 4 Rent Trust, Series 2015-SFR2 'E', 1444 6.07% 17/10/2032	USD	2,800,000	2,736,990	0.06	
American Express Co., FIM 4.99% 01/05/2026	USD	4,200,000	4,148,294	0.09		American Municipal Power, Inc. 'B' 7.49% 15/02/2030	USD	715,000	684,753	0.02	
American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR2 'A', 1444 3.78% 17/10/2036	USD	9,715,004	9,425,226	0.19		Augen, Inc. 1.65% 15/08/2028	USD	1,190,000	1,014,228	0.02	
						Augen, Inc. 5.25% 02/03/2033	USD	2,915,000	2,907,061	0.06	
						Augen, Inc. 3.15% 21/02/2040	USD	825,000	473,842	0.01	
						Augen, Inc. 5.6% 02/03/2043	USD	3,000,000	2,988,469	0.06	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Angen, Inc. 4.863% 15/06/2051	USD	2,350,000	2,076,395	0.04		Bank of America Corp., FNN 1.658%	USD	2,510,000	2,257,344	0.05	
Angen, Inc. 5.65% 02/03/2053	USD	1,550,000	1,551,913	0.03		11/03/2027					
Analog Devices, Inc. 2.3% 01/10/2041	USD	1,854,000	1,367,660	0.03		Bank of America Corp., FNN 1.134%	USD	705,000	628,344	0.01	
Apple, Inc. 3.45% 09/02/2045	USD	792,000	663,157	0.01		22/07/2027					
Apple, Inc. 3.85% 04/08/2046	USD	879,000	764,188	0.02		Bank of America Corp., FNN 3.165%	USD	3,600,000	3,371,592	0.07	
Apple, Inc. 4.85% 10/05/2053	USD	6,675,000	6,793,171	0.14		24/04/2028					
Ascension Health 2.52% 15/11/2029	USD	1,770,000	1,521,515	0.03		Bank of America Corp., FNN 4.116%	USD	2,700,000	2,590,890	0.05	
Assurant, Inc. 4.2% 27/09/2023	USD	150,000	148,982	0.00		27/04/2028					
Athene Global Funding, 144A 2.75% 25/06/2024	USD	1,885,000	1,812,761	0.04		Bank of America Corp., FNN 3.419%	USD	66,000	60,495	0.00	
Athene Global Funding, 144A 2.5% 14/01/2025	USD	767,000	716,740	0.02		Bank of America Corp., FNN 3.91%	USD	409,000	382,044	0.01	
Athene Global Funding, 144A 1.45% 03/01/2026	USD	2,770,000	2,430,630	0.05		Bank of America Corp., FNN 5.202%	USD	3,640,000	3,596,990	0.07	
Athene Global Funding, 144A 2.95% 12/11/2026	USD	5,285,000	4,687,031	0.10		25/04/2029					
Axian Capital Group LLC, 144A 5.5% 15/12/2024	USD	2,094,000	2,049,794	0.04		Bank of America Corp., FNN 2.047%	USD	1,091,000	929,495	0.02	
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2019-24 'A', 144A 4% 20/03/2025	USD	7,000,000	6,933,383	0.14		Bank of America Corp., FNN 2.592%	USD	3,045,000	2,549,803	0.05	
Baltimore Gas and Electric Co. 3.5% 15/08/2046	USD	385,000	289,302	0.01		Bank of America Corp., FNN 1.898%	USD	1,675,000	1,328,466	0.03	
Baltimore Gas and Electric Co. 3.2% 15/09/2049	USD	885,000	637,239	0.01		Bank of America Corp., FNN 2.647%	USD	2,635,000	2,173,423	0.05	
Baltimore Gas and Electric Co. 2.5% 15/06/2050	USD	1,000,000	664,157	0.01		22/04/2022					
Baltimore Gas and Electric Co. 5.4% 01/06/2053	USD	3,020,000	3,034,233	0.06		Bank of America Corp., FNN 2.512%	USD	1,190,000	964,334	0.02	
BAML Commercial Mortgage Securities Trust, FNN 'A', 144A 4.04% 03/08/2028	USD	5,275,000	4,631,364	0.10		20/10/2022					
BAML Commercial Mortgage Securities Trust 'B', 144A 3.43% 14/04/2023	USD	9,676,000	8,851,962	0.18		Bank of America Corp., FNN 5.288%	USD	4,000,000	3,952,026	0.08	
Bank of America Funding Trust, Series 2004-2 '10B' 5.75% 20/09/2004	USD	18,874	18,547	0.00		Bank of America Corp., FNN 2.616%	USD	6,636,000	4,594,746	0.10	
Bank of America Funding Trust, Series 2005-6 '2A' 5.2% 25/10/2005	USD	68,806	58,088	0.00		19/06/2041					
Bank of America Funding Trust, PO, Series 2004-2 '3AP' 6% 20/09/2004	USD	7,033	5,048	0.00		Bank of New York Mellon Corp. (The), FNN 3.43% 13/06/2025	USD	5,000,000	4,877,345	0.10	
Bank of America Funding Trust, PO, Series 2005-1 '3AP' 6% 25/11/2005	USD	9,024	8,836	0.00		BBUS Trust, Series 2002-SHOW 'A', 144A 3.43% 05/11/2006	USD	3,850,000	3,603,133	0.07	
Bank of America Corp., FNN 3.45% 15/02/2025	USD	500,000	490,136	0.01		Bear Stearns ARM Trust, FNN, Series 2004-2 '14A' 3.89% 25/05/2004	USD	16,486	15,258	0.00	
Bank of America Corp., FNN 3.36% 23/01/2026	USD	1,000,000	958,170	0.02		Bear Stearns ARM Trust, FNN, Series 2003-7 '3A' 4.57% 25/10/2003	USD	3,208	2,972	0.00	
Bank of America Corp., FNN 5.04% 20/01/2021	USD	2,564,000	2,524,642	0.05		Bear Stearns ARM Trust, FNN, Series 2003-4 '3A' 4.40% 25/01/2003	USD	26,505	25,193	0.00	
						Bear Stearns ARM Trust, FNN, Series 2006-1 'A1' 6.8% 25/02/2006	USD	30,857	29,650	0.00	
						Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust, 10, FNN, Series 2005-FWBS 'X1', 144A 6.71% 11/06/2041	USD	1,620	2	0.00	
						Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust, 10, FNN, Series 2001-T36 'X1', 144A 1.16% 12/01/2045	USD	40,896	88	0.00	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Blackstone Secured Lending Fund 3.63% 14/01/2022	USD	1,860,000	1,857,954	0.04		Capital One Financial Corp., FRN 2.618% 02/11/2022	USD	1,265,000	1,049,399	0.02	
Boe Secours Mercy Health, Inc. 3.205% 02/06/2020	USD	1,980,000	1,363,574	0.03		Charter Communications Operating LLC 4.904% 11/07/2025	USD	2,000,000	1,960,097	0.04	
Boston Gas Co., 144A 4.487% 15/02/2042	USD	149,000	123,831	0.00		Charter Communications Operating LLC 3.75% 15/02/2028	USD	1,146,000	1,050,290	0.02	
Bristol-Myers Squibb Co. 4.125% 15/06/2022	USD	936,000	847,296	0.02		Charter Communications Operating LLC 6.304% 11/10/2025	USD	275,000	267,532	0.01	
Bristol-Myers Squibb Co. 4.55% 20/02/2042	USD	777,000	719,107	0.02		Charter Communications Operating LLC 5.315% 01/04/2028	USD	400,000	339,441	0.01	
British Airways Pass-Through Trust, Series 2013-1 'A', 144A 4.125% 20/03/2023	USD	1,366,218	1,126,934	0.02		Charter Communications Operating LLC 3.5% 01/06/2041	USD	1,345,000	901,479	0.02	
British Airways Pass-Through Trust, Series 2013-1 'M', 144A 3.8% 20/03/2023	USD	543,649	500,456	0.01		Charter Communications Operating LLC 4.8% 01/01/2029	USD	2,585,000	1,934,915	0.04	
British Airways Pass-Through Trust, Series 2013-1 'M', 144A 3.3% 15/06/2024	USD	1,049,826	916,237	0.02		Charter Communications Operating LLC 3.7% 01/04/2031	USD	2,570,000	1,611,108	0.03	
Brimor Operating Partnership LP, BEIT 2.5% 16/06/2021	USD	785,000	592,589	0.01		Charter Communications Operating LLC 6.824% 11/10/2025	USD	350,000	327,737	0.01	
Broadcom, Inc., 144A 2.45% 15/02/2031	USD	4,373,000	3,546,650	0.07		Chase Funding Trust, Series 2003-4 'M5' 4.875% 25/05/2023	USD	92,190	87,127	0.00	
Broadcom, Inc., 144A 3.137% 15/11/2035	USD	3,709,000	2,821,647	0.06		Chase Funding Trust, Series 2003-6 'M7' 4.848% 25/11/2024	USD	52,526	50,593	0.00	
Broadcom, Inc., 144A 3.187% 15/11/2036	USD	77,000	57,818	0.00		Chase Mortgage Finance Trust, FRN, Series 2001-01 'M3' 4.215% 25/02/2027	USD	141,959	138,620	0.00	
Brooklyn Union Gas Co. (The), 144A 3.855% 04/02/2029	USD	785,000	714,933	0.02		Chase Mortgage Finance Trust, FRN, Series 2001-01 'M4' 4.185% 25/02/2027	USD	13,393	12,634	0.00	
Brooklyn Union Gas Co. (The), 144A 4.213% 15/02/2048	USD	780,000	579,776	0.01		Chase Mortgage Finance Trust, FRN, Series 2001-02 'M1' 4.135% 25/02/2025	USD	51,760	50,193	0.00	
Buckeye Partners LP 5.83% 15/11/2043	USD	450,000	334,373	0.01		Chase Mortgage Finance Trust, FRN, Series 2001-01 'M1' 4.305% 25/02/2027	USD	7,307	7,214	0.00	
CBF Trust, Series 2017-GN 'A', 144A 3.375% 11/06/2029	USD	14,000,000	12,557,320	0.26		Chase Mortgage Finance Trust, FRN, Series 2001-01 'M1' 4.295% 25/02/2027	USD	10,728	10,234	0.00	
Cameron LNG LLC, 144A 3.302% 15/01/2035	USD	2,200,000	1,820,446	0.04		Chevron Phillips Chemical Co. LLC, 144A 5.125% 01/04/2025	USD	1,955,000	1,940,282	0.04	
Camillo 1-A-1 Issuer LLC, Series 2018-SFR1 'A', 144A 5.25% 05/06/2028	USD	4,154,707	4,070,757	0.08		Chevron USA, Inc. 2.9% 15/11/2024	USD	400,000	392,840	0.01	
Camillo LLC, Series 2016-SFR1 'B' 05/12/2021	USD	4,093,419	4,000,396	0.08		Children's Health System of Texas 2.511% 15/08/2050	USD	2,430,000	1,495,788	0.03	
Capital One Financial Corp., FRN 4.168% 09/05/2025	USD	8,910,000	8,682,923	0.18		Children's Hospital Corp. (The) 3.585% 01/02/2050	USD	1,387,000	883,492	0.02	
Capital One Financial Corp., FRN 4.935% 14/07/2026	USD	2,860,000	2,770,226	0.06		Children's National Medical Center 2.928% 15/07/2050	USD	1,500,000	1,025,190	0.02	
Capital One Financial Corp., FRN 6.212% 02/06/2029	USD	2,480,000	2,456,169	0.05		CHL Mortgage Pass Through Trust 4.5% 25/06/2049	USD	2,089	2,081	0.00	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
GIL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-5 '0A' 5.5% 25/06/2024	USD	64,946	63,847	0.00		Citigroup, Inc., FRN 2.83% 09/11/2032	USD	1,740,000	1,397,361	0.03	
GIL Mortgage Pass-Through Trust, FRN, Series 2004-1 '2A1' 4.998% 25/06/2024	USD	13,517	13,640	0.00		Citigroup, Inc., FRN 3.057% 25/01/2033	USD	569,000	473,667	0.01	
GIL Mortgage Pass-Through Trust, FRN, Series 2005-22 '2A1' 3.504% 25/11/2025	USD	105,378	83,668	0.00		Citigroup, Inc., FRN 6.174% 25/05/2034	USD	2,279,000	2,292,109	0.05	
GIL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-1 '0B' 5.5% 25/06/2024	USD	93,342	89,181	0.00		Citigroup, Inc., FRN 3.878% 24/01/2039	USD	200,000	166,691	0.00	
GIL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-1 '0A' 5.7% 25/06/2024	USD	46,671	44,454	0.00		City of Los Angeles Department of Airports 6.582% 15/05/2029	USD	260,000	287,889	0.01	
Cigna Group (The) 4.5% 25/02/2026	USD	1,366,000	1,340,071	0.03		Cleveland Electric Illuminating Co. (The), 1944 1.5% 01/04/2028	USD	857,000	785,575	0.02	
Cigna Group (The) 4.8% 15/07/2046	USD	156,000	141,229	0.00		Comcast Cable Communications LLC 8.5% 01/05/2027	USD	394,000	438,448	0.01	
Cincinnati Financial Corp. 6.92% 15/05/2028	USD	290,000	309,621	0.01		Comcast Corp. 3.55% 01/05/2028	USD	3,386,000	3,194,812	0.07	
Cincinnati Financial Corp. 6.125% 01/11/2024	USD	1,000,000	1,050,271	0.02		Comcast Corp. 4.25% 15/01/2033	USD	2,133,000	2,019,379	0.04	
Citicorp Mortgage Securities Trust, Series 2006-4 '02' 6% 25/08/2026	USD	38,270	33,988	0.00		Comcast Corp. 4.2% 15/08/2034	USD	676,000	626,361	0.01	
Citicorp Mortgage Securities Trust '2A2' 5% 25/04/2049	USD	2,873	2,738	0.00		Comcast Corp. 3.2% 15/07/2026	USD	850,000	694,770	0.01	
Citicorp Mortgage Securities, Inc., Series 2004-1 '05' 5.2% 25/05/2024	USD	140,839	133,865	0.00		Comcast Corp. 3.9% 01/03/2028	USD	2,000,000	1,729,590	0.04	
Citigroup Global Markets Mortgage Securities VII, Inc., FRN, Series 2002-07B1 'A' 4.24% 15/09/2023	USD	12,973	12,913	0.00		Comcast Corp. 3.25% 01/11/2039	USD	1,260,000	991,476	0.02	
Citigroup Global Markets Mortgage Securities VII, Inc., PO, Series 2002-07C1 '01' 0% 25/06/2022	USD	51	46	0.00		Comcast Corp. 3.75% 01/04/2040	USD	2,155,000	1,801,257	0.04	
Citigroup Mortgage Loan Trust, FRN, Series 2004-03D1 'A3' 4.27% 25/08/2024	USD	8,007	7,663	0.00		Comcast Corp. 2.83% 01/11/2051	USD	1,439,000	955,563	0.02	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-2 '2A11' 5.5% 25/05/2025	USD	47,026	45,651	0.00		Comcast Corp. 5.35% 15/05/2053	USD	4,005,000	4,014,401	0.08	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2003-1 '2A5' 5.2% 25/10/2023	USD	4,454	4,073	0.00		COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2018-HOME 'A', 1444 1.81% 10/04/2023	USD	13,840,000	12,439,619	0.26	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2003-1 '2A4' 5.2% 25/09/2023	USD	13,101	12,231	0.00		COMM Mortgage Trust, Series 2015-CR25 'A' 3.12% 10/08/2048	USD	1,250,000	1,187,082	0.02	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2000-0P3 'A3' 5% 25/09/2023	USD	397	388	0.00		CommonSpirit Health 1.547% 01/10/2025	USD	1,385,000	1,259,893	0.03	
Citigroup, Inc., FRN 3.887% 10/01/2028	USD	4,700,000	4,446,793	0.09		CommonSpirit Health 2.782% 01/10/2030	USD	1,385,000	1,159,049	0.02	
Citigroup, Inc., FRN 3.668% 24/07/2028	USD	4,305,000	4,021,607	0.08		CommonSpirit Health 3.91% 01/10/2050	USD	1,365,000	1,047,967	0.02	
Citigroup, Inc., FRN 1.52% 27/10/2028	USD	750,000	695,097	0.01		Commonwealth Edison Co. 5.875% 01/02/2033	USD	1,000,000	1,032,681	0.02	
Citigroup, Inc., FRN 4.075% 23/04/2029	USD	2,226,000	2,095,945	0.04		Constellation Brands, Inc. 3.6% 15/02/2028	USD	1,500,000	1,483,414	0.03	
						Constellation Energy Generation LLC 3.25% 01/05/2025	USD	1,230,000	1,169,933	0.02	
						Constellation Energy Generation LLC 5.8% 01/03/2023	USD	2,417,000	2,468,069	0.05	
						Constellation Energy Generation LLC 6.25% 01/10/2029	USD	1,000,000	1,031,233	0.02	
						Constellation Energy Generation LLC 5.75% 01/10/2041	USD	114,000	110,920	0.00	
						Continental Airlines Pass-Through Trust, Series 2012-2 'A' 4% 29/04/2026	USD	3,788,196	3,684,306	0.08	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Corebridge Financial, Inc. 3.85% 05/04/2029	USD	985,000	896,603	0.02		CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, PI, Series 2005-10 'A' 0% 25/11/2035	USD	15,733	10,178	0.00	
Cottage Health Obligated Group 3.304% 01/11/2049	USD	1,220,000	896,699	0.02		CSMC 0A LLC 'A2', 144A 3.953% 15/09/2037	USD	13,175,000	11,388,246	0.24	
Cox Communications, Inc., 144A 3.35% 15/09/2035	USD	503,000	470,818	0.01		CSMC 0A LLC, Series 2014-05A 'B', 144A 4.373% 15/09/2037	USD	6,000,000	4,366,716	0.09	
Cox Communications, Inc., 144A 3.3% 15/08/2027	USD	162,000	150,648	0.00		CSX Corp. 6% 01/10/2036	USD	500,000	525,886	0.01	
Cox Communications, Inc., 144A 3.55% 01/10/2030	USD	1,485,000	924,890	0.02		CSX Corp. 4.3% 15/05/2044	USD	165,000	141,135	0.00	
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 5% 25/09/2042	USD	7,791	5,306	0.00		CSX Corp. 4.75% 15/11/2048	USD	910,000	837,372	0.02	
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., Series 2003-21 '14' 5.35% 25/09/2033	USD	38,871	36,978	0.00		CSX Corp. 3.35% 15/09/2049	USD	230,000	188,895	0.00	
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., RM, Series 2004-02 '24' 4.15% 25/09/2034	USD	11,501	11,292	0.00		CSX Pass-Through Trust, 144A 5.25% 11/01/2027	USD	85,746	83,957	0.00	
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., RM, Series 2003-21 'A' 0% 25/09/2033	USD	8,904	6,161	0.00		CSX Pass-Through Trust, 144A 7.50% 10/01/2032	USD	861,170	898,004	0.02	
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., PO, Series 2004-3 'A' 0% 25/09/2034	USD	11,120	6,949	0.00		CSX Pass-Through Trust, 144A 5.77% 10/01/2033	USD	471,650	461,666	0.01	
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., RM, Series 2003-1 '10B' 6.65% 25/02/2031	USD	21,899	21,375	0.00		CSX Pass-Through Trust, 144A 5.92% 10/01/2034	USD	479,139	466,013	0.01	
CRF America Finance, Inc., 144A 3.4% 09/05/2027	USD	398,000	278,722	0.01		CSX Pass-Through Trust, Series 2009, 144A 8.35% 10/01/2031	USD	229,729	240,328	0.01	
CRF America, Inc., 144A 3.875% 18/05/2025	USD	1,700,000	1,637,180	0.03		CSX Pass-Through Trust, Series 2014, 144A 4.16% 11/08/2036	USD	351,657	315,399	0.01	
CRF America, Inc., 144A 5.125% 18/05/2045	USD	300,000	179,157	0.00		Delmarva Power & Light Co. 4% 01/06/2042	USD	141,000	112,379	0.00	
Crown Castle Towers LLC, 144A 3.663% 15/05/2045	USD	900,000	854,088	0.02		Delmarva Power & Light Co. 4.15% 15/05/2045	USD	1,000,000	829,036	0.02	
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-6 '1A' 5.3% 25/12/2034	USD	76,704	74,477	0.00		Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust, Series 2004-1 '14B' 5.24% 25/12/2033	USD	1,100	1,058	0.00	
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-4 '2A' 5.3% 25/06/2034	USD	41,112	39,812	0.00		Devon Energy Corp. 5.2% 15/09/2024	USD	1,300,000	1,289,948	0.03	
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2003-21 '1A' 5.35% 25/11/2033	USD	2,452	2,402	0.00		Discovery Communications LLC 5.2% 20/09/2047	USD	1,280,000	1,040,553	0.02	
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2003-21 '1A' 5.35% 25/11/2033	USD	8,019	5,767	0.00		Discovery Communications LLC 4% 15/09/2055	USD	257,000	168,392	0.00	
						Duke Energy Carolinas LLC 5.4% 15/01/2054	USD	1,135,000	1,147,616	0.02	
						Duquesne Light Holdings, Inc., 144A 3.61% 01/08/2027	USD	1,350,000	1,212,670	0.03	
						Duquesne Light Holdings, Inc., 144A 2.53% 01/10/2030	USD	2,320,000	1,850,589	0.04	
						Eastern Gas Transmission & Storage, Inc. 4.6% 15/12/2044	USD	900,000	755,367	0.02	
						Eastern Gas Transmission & Storage, Inc. 3.9% 15/11/2049	USD	1,119,000	821,043	0.02	
						Emera US Finance LP 4.75% 15/06/2048	USD	1,200,000	967,648	0.02	
						Energy Transfer LP 5.5% 01/06/2027	USD	254,000	252,461	0.01	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Equinix, Inc., BEIT 1.4% 15/09/2026	USD	2,120,000	1,892,596	0.04		PRMNC, Series KM6 'AM' 3.126% 25/05/2027	USD	1,600,000	1,515,419	0.03	
Equinix, Inc., BEIT 2.9% 8/11/2026	USD	2,850,000	2,613,714	0.05		PRMNC, Series 3928 'D' 4% 15/09/2041	USD	2,112,489	1,919,532	0.04	
ERAC USA Finance LLC, 144A 7% 15/10/2037	USD	510,000	501,017	0.01		PRMNC, Series 4900 'D' 3% 25/07/2049	USD	1,734,611	1,540,312	0.03	
ERAC USA Finance LLC, 144A 5.615% 15/03/2041	USD	96,000	95,609	0.00		PRMNC, FRN, Series 284 'F1' 5.657% 15/01/2042	USD	781,800	763,492	0.02	
Ereton Corp. 5.3% 15/03/2033	USD	1,500,000	1,491,011	0.03		PRMNC, FRN, Series 270 'F1' 5.807% 15/08/2042	USD	240,790	234,456	0.01	
F&G Global Funding, 144A 1.75% 30/06/2026	USD	1,575,000	1,395,112	0.03		PRMNC, IO, FRN, Series 3201 'H1' 1.543% 15/08/2026	USD	194,680	15,501	0.00	
Fells Point Funding Trust, 144A 3.04% 31/01/2027	USD	4,370,000	4,016,471	0.08		PRMNC, Series 24 'J' 6.28% 25/11/2023	USD	372	371	0.00	
FHLBNC 4% 01/07/2048	USD	4,061,250	3,869,430	0.08		PRMNC, Series 29 'L' 7.5% 25/04/2028	USD	5,416,437	4,196,655	0.09	
FHLBNC, IO, Series 233 '11' 5% 15/09/2035	USD	25,684	4,906	0.00		PRMNC, Series 29 'L' 7.5% 25/04/2028	USD	2,811	2,802	0.00	
FHLBNC, IO, Series 233 '13' 5% 15/09/2035	USD	66,455	11,538	0.00		PRMNC, Series 29 'L' 7.5% 25/04/2028	USD	3,576,148	2,953,584	0.06	
FHLBNC, Series T-54 '2A' 6.5% 25/02/2043	USD	14,416	15,000	0.00		PRMNC, IO, FRN, Series 229 'S20' 2.93% 15/08/2026	USD	115,943	14,238	0.00	
FHLBNC, FRN, Series T-76 '2A' 3.02% 25/10/2027	USD	239,881	204,767	0.00		PRMNC, Series 2763 '2A' 6% 15/03/2034	USD	2,653,393	2,694,455	0.06	
FHLBNC, Series 262 '35' 3.5% 15/07/2042	USD	1,346,429	1,163,074	0.02		PRMNC, Series 2965 '2B' 5.5% 15/03/2035	USD	1,883,564	1,861,648	0.02	
FHLBNC, FRN, Series T-41 '3A' 4.32% 25/01/2022	USD	9,218	8,687	0.00		PRMNC, Series 2779 '2C' 6% 15/04/2034	USD	1,630,064	1,661,675	0.03	
FHLBNC, Series T-54 '3A' 7% 25/02/2043	USD	18,346	19,183	0.00		PRMNC, Series 2691 '2D' 5.5% 15/09/2033	USD	857,162	862,146	0.02	
FHLBNC, FRN, Series 8048 'A2' 3.284% 25/06/2025	USD	3,000,000	2,895,883	0.06		PRMNC, FRN 1A1082 5.79% 01/07/2036	USD	16,835	17,183	0.00	
PRMNC, Series KM54 'A2' 2.745% 25/01/2026	USD	4,000,000	3,785,984	0.08		PRMNC, FRN 1A1085 6.016% 01/08/2036	USD	27,293	27,628	0.00	
PRMNC, Series KM6 'A2' 3.242% 25/04/2021	USD	2,983,000	2,831,828	0.06		PRMNC, FRN 1A1096 6.315% 01/10/2036	USD	40,910	41,613	0.00	
PRMNC, Series KM88 'A2' 3.89% 25/01/2029	USD	1,156,000	1,105,996	0.02		PRMNC, FRN 1A1097 6.569% 01/10/2036	USD	47,979	48,132	0.00	
PRMNC, FRN 'A2' 3.72% 25/09/2032	USD	7,960,000	7,483,151	0.15		PRMNC, FRN 1B1665 4.819% 01/04/2034	USD	6,232	6,055	0.00	
PRMNC, FRN 'A2' 3.2% 25/10/2022	USD	9,600,000	9,088,442	0.19		PRMNC, FRN 1G2557 4.353% 01/08/2036	USD	65,483	66,385	0.00	
PRMNC, Series K152 'A2' 3.08% 25/01/2023	USD	3,761,000	3,417,320	0.07		PRMNC, FRN 1J1399 4.375% 01/12/2036	USD	3,645	3,577	0.00	
PRMNC, FRN 'A2' 3.82% 25/01/2020	USD	10,000,000	9,474,376	0.20		PRMNC, FRN 1J1418 3.94% 01/12/2026	USD	17,632	17,234	0.00	
PRMNC, Series KJ26 'A2' 2.698% 25/07/2021	USD	8,456,872	7,994,392	0.16		PRMNC, FRN 1J1516 4.074% 01/02/2037	USD	18,631	18,692	0.00	
PRMNC, Series T-42 'A5' 7.5% 25/02/2042	USD	181,342	183,194	0.00		PRMNC, FRN 1J2945 4% 01/11/2037	USD	9,311	9,140	0.00	
PRMNC, Series T-56 'A5' 5.212% 25/05/2042	USD	540,886	520,776	0.01		PRMNC, FRN 1K0046 4.48% 01/10/2036	USD	33,851	33,261	0.00	
PRMNC, FRN, Series WFX 'A2' 3.244% 25/04/2028	USD	2,228,000	2,067,695	0.04		PRMNC, FRN 1L1286 5.2% 01/05/2026	USD	19,509	19,493	0.00	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
FHLMC, FRN 1N0206 5.995% 01/08/2036	USD	10,062	10,187	0.00		FHLMC 063546 5% 01/11/2043	USD	42,088	41,736	0.00	
FHLMC, FRN 1N0353 6.307% 01/02/2037	USD	29,548	29,828	0.00		FHLMC 069030 4.5% 01/01/2046	USD	1,793,537	1,787,446	0.04	
FHLMC, FRN 1N1463 4.803% 01/05/2037	USD	5,616	5,449	0.00		FHLMC 090673 4% 01/01/2043	USD	305,638	292,996	0.01	
FHLMC, FRN 1Q0007 6.015% 01/12/2035	USD	10,141	10,133	0.00		FHLMC 090690 3.5% 01/06/2042	USD	845,891	785,755	0.02	
FHLMC, FRN 1Q0737 3.993% 01/11/2036	USD	27,346	26,987	0.00		FHLMC 090975 4% 01/06/2042	USD	783,057	750,672	0.02	
FHLMC, FRN 1Q0739 6.018% 01/03/2037	USD	46,044	46,777	0.00		FHLMC 091253 4% 01/04/2043	USD	1,961,878	1,875,881	0.04	
FHLMC, FRN 782760 4.304% 01/11/2036	USD	26,379	26,874	0.00		FHLMC 091305 3.5% 01/04/2043	USD	389,957	362,573	0.01	
FHLMC, FRN 782870 4.287% 01/09/2034	USD	84,645	84,340	0.00		FHLMC 091484 4% 01/05/2043	USD	2,115,594	2,022,858	0.04	
FHLMC, FRN 782979 4.375% 01/01/2035	USD	109,449	110,579	0.00		FHLMC 093007 3.5% 01/07/2045	USD	623,917	585,536	0.01	
FHLMC, FRN 782980 4.375% 01/01/2035	USD	53,400	52,545	0.00		FHLMC 093024 3.5% 01/08/2045	USD	424,318	399,009	0.01	
FHLMC, FRN 847621 4.457% 01/05/2033	USD	28,309	28,080	0.00		FHLMC 093089 3.5% 01/12/2035	USD	382,589	361,843	0.01	
FHLMC, FRN 848365 4.033% 01/07/2036	USD	116,294	116,031	0.00		FHLMC 093090 3.5% 01/11/2045	USD	476,006	446,750	0.01	
FHLMC, FRN 848431 4.352% 01/02/2036	USD	58,906	58,981	0.00		FHLMC 093143 3.5% 01/04/2046	USD	517,851	485,959	0.01	
FHLMC, FRN 848899 4.02% 01/07/2040	USD	34,355	34,863	0.00		FHLMC 093154 3.5% 01/05/2046	USD	57,530	53,489	0.00	
FHLMC, FRN 972200 4.155% 01/03/2036	USD	15,018	14,603	0.00		FHLMC 099051 3.5% 01/06/2043	USD	1,015,832	943,579	0.02	
FHLMC A61376 6.5% 01/07/2032	USD	51,942	53,255	0.00		FHLMC 099134 4% 01/01/2046	USD	1,091,139	1,043,406	0.02	
FHLMC A88871 7% 01/01/2031	USD	46,489	47,027	0.00		FHLMC 099515 4% 01/03/2049	USD	296,389	282,031	0.01	
FHLMC B90491 7.5% 01/01/2032	USD	41,175	41,835	0.00		FHLMC 240024 5.5% 01/04/2036	USD	22,532	22,665	0.00	
FHLMC C75791 5.5% 01/01/2033	USD	12,083	12,129	0.00		FHLMC REMICS, Series 3422 'A' 0.25% 15/01/2038	USD	153,258	1,312	0.00	
FHLMC C90985 6.5% 01/08/2026	USD	6,892	6,941	0.00		FHLMC REMICS, PO, Series 3807 'A0' 06/15/04/2036	USD	20,511	16,870	0.00	
FHLMC G01448 7% 01/08/2032	USD	3,889	3,983	0.00		FHLMC REMICS, Series 3181 'A2' 6.5% 15/07/2036	USD	116,878	120,970	0.00	
FHLMC G03436 6.5% 01/09/2036	USD	57,603	60,247	0.00		FHLMC REMICS, Series 3453 'B' 5.5% 15/09/2038	USD	9,343	9,255	0.00	
FHLMC G04077 6.5% 01/03/2038	USD	44,460	46,739	0.00		FHLMC REMICS, Series 2951 'B' 4% 15/11/2041	USD	50,792	48,275	0.00	
FHLMC G04952 7.5% 01/01/2038	USD	33,340	34,168	0.00		FHLMC REMICS, Series 2894 'B4' 4% 15/06/2031	USD	1,939	1,901	0.00	
FHLMC G05671 5.5% 01/08/2038	USD	69,307	71,199	0.00		FHLMC REMICS, Series 3143 'B2' 5.5% 15/02/2036	USD	80,651	81,086	0.00	
FHLMC G08493 4.5% 01/05/2041	USD	896,109	894,126	0.02		FHLMC REMICS, PO, Series 3807 'B0' 06/15/04/2036	USD	15,383	12,958	0.00	
FHLMC G31099 4% 01/01/2038	USD	2,938,676	2,860,582	0.06		FHLMC REMICS, PO, Series 3821 'B0' 06/15/01/2040	USD	37,887	31,654	0.00	
FHLMC G60214 5% 01/07/2035	USD	3,717,037	3,741,747	0.08		FHLMC REMICS, FRN, Series 3638 'B5' 04/27/06/15/02/2040	USD	89,748	84,501	0.00	
FHLMC L10224 6% 01/12/2034	USD	102,232	102,158	0.00		FHLMC REMICS, Series 3501 'C1' 5.5% 15/01/2039	USD	124,245	125,156	0.00	
FHLMC Q48657 3.5% 01/08/2046	USD	1,989,197	1,823,208	0.04		FHLMC REMICS, PO, FRN, Series 3268 'C5' 1.032% 15/01/2031	USD	18,973	1,452	0.00	
FHLMC Q49329 4.5% 01/07/2047	USD	417,374	411,677	0.01		FHLMC REMICS, Series 3824 'C3' 4.5% 15/06/2035	USD	91,301	90,197	0.00	
FHLMC Q52834 4% 01/12/2047	USD	2,055,945	1,950,894	0.04		FHLMC REMICS, PO, Series 3219 'D1' 0% 15/04/2036	USD	19,433	3,656	0.00	
FHLMC RD0011 2.5% 01/12/2049	USD	4,441,141	3,909,302	0.08		FHLMC REMICS, FRN, Series 3051 'D0' 5.55% 15/10/2025	USD	4,014	3,769	0.00	

JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表（続き）

2023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		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(%)						割合(%)	
FILAC BEMICS, Series 3104 '00' 7.5% 15/11/2016	USD	108,676	115,441	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3171 '00' ON 15/06/2016	USD	12,874	11,401	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 3117 '00' ON 15/02/2016	USD	9,150	7,714	0.00		FILAC BEMICS, Series 3166 '00' 4% 15/12/2011	USD	552,839	530,030	0.01	
FILAC BEMICS, PO, Series 3133 '00' ON 15/05/2016	USD	46,883	39,230	0.00		FILAC BEMICS, Series 3400 '00' 6.5% 15/02/2012	USD	4,076	4,178	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 4280 '00' ON 15/12/2013	USD	419,953	312,940	0.01		FILAC BEMICS, PO, Series 3124 0% 15/03/2016	USD	2,312	2,000	0.00	
FILAC BEMICS, Series 3104 '02' 7.5% 15/12/2016	USD	94,070	100,528	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3128 0% 15/04/2016	USD	10,560	8,820	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2388 '02' 8.5% 15/06/2011	USD	9,473	10,165	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3151 0% 15/05/2016	USD	47,084	37,902	0.00	
FILAC BEMICS, FRI, Series 3349 '00' 6.30% 15/07/2019	USD	6,608	6,596	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3280 0% 15/02/2016	USD	44,470	36,166	0.00	
FILAC BEMICS, FRI, Series 2388 '00' 5.70% 15/01/2019	USD	11,350	11,355	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3407 0% 15/05/2017	USD	112,876	91,260	0.00	
FILAC BEMICS, FRI, Series 4048 '00' 4.02% 15/07/2017	USD	523,712	510,394	0.01		FILAC BEMICS, PO, Series 3611 0% 15/07/2014	USD	12,386	10,519	0.00	
FILAC BEMICS, FRI, Series 3275 '00' 5.94% 15/02/2017	USD	5,822	5,690	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3621 0% 15/01/2010	USD	82,646	49,653	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2544 '00' 6% 15/12/2012	USD	16,486	16,797	0.00		FILAC BEMICS, Series 3047 '00' 5.5% 15/10/2015	USD	77,488	76,788	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2483 '00' 4.5% 15/08/2012	USD	299,192	294,447	0.01		FILAC BEMICS, Series 3094 '00' 5.5% 15/11/2015	USD	179,371	180,342	0.00	
FILAC BEMICS, II, Series 3714 '00' 5% 15/08/2010	USD	57,680	3,985	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3117 '00' ON 15/02/2016	USD	23,549	20,051	0.00	
FILAC BEMICS, Series 1621 '00' 6.4% 15/11/2013	USD	3,085	3,085	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3122 '00' ON 15/03/2016	USD	24,386	20,796	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 3316 '00' ON 15/05/2017	USD	6,443	5,002	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3117 '00' ON 15/02/2016	USD	10,942	9,143	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 3350 '00' ON 15/09/2012	USD	241,650	207,795	0.00		FILAC BEMICS, Series 2720 '00' 5% 15/12/2013	USD	869	865	0.00	
FILAC BEMICS, Series 1578 '00' 6.5% 15/09/2013	USD	138	138	0.00		FILAC BEMICS, Series 2165 '00' 6% 15/06/2009	USD	74,202	74,423	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2220 '00' 6.5% 15/12/2013	USD	581	580	0.00		FILAC BEMICS, Series 2110 '00' 6% 15/01/2009	USD	17,000	17,032	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 3228 '00' ON 15/03/2017	USD	34,557	28,628	0.00		FILAC BEMICS, Series 2075 '00' 6.5% 15/08/2018	USD	4,105	4,148	0.00	
FILAC BEMICS, IO, FRI, Series 3912 '00' ON 15/01/2010	USD	151,309	6,192	0.00		FILAC BEMICS, IO, FRI, Series 1424 '01' 1.692% 15/04/2010	USD	48,116	4,336	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2494 '00' 6.5% 15/07/2012	USD	8,190	8,309	0.00		FILAC BEMICS, Series 3614 '00' 4% 15/12/2014	USD	180,417	177,792	0.00	
FILAC BEMICS, Series 3461 '00' 6% 15/06/2018	USD	17,463	17,867	0.00		FILAC BEMICS, Series 2172 '00' 7% 15/07/2009	USD	29,705	30,668	0.00	
FILAC BEMICS, Series 2575 '00' 6% 15/02/2013	USD	21,404	21,798	0.00		FILAC BEMICS, FRI, Series 3812 '00' 5.5% 15/05/2011	USD	112,862	108,127	0.00	
FILAC BEMICS, PO, Series 3132 '00' ON 15/03/2016	USD	97,170	81,885	0.00		FILAC BEMICS, PO, Series 3671 '00' ON 15/12/2016	USD	183,033	82,782	0.00	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
FILMCO BONDS, FPN, Series 2871 'S' 5.39% 15/09/2033	USD	7,800	7,966	0.00		FILMCO BONDS, FPN, Series 3032 'W' 5.3% 15/09/2041	USD	116,667	118,257	0.00	
FILMCO BONDS, FPN, Series 2967 'S' 5.734% 15/04/2025	USD	3,723	3,376	0.00		FILMCO BONDS, Series 3578 'W' 5.3% 15/06/2036	USD	85,300	86,138	0.00	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3194 'SA' 1.992% 15/07/2036	USD	5,156	608	0.00		FILMCO BONDS, FPN, Series 3085 'W' 5.907% 15/06/2035	USD	123,046	124,341	0.00	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3387 'SA' 1.312% 15/11/2037	USD	82,504	5,632	0.00		FILMCO BONDS, FPN, Series 2990 'W' 3.852% 15/06/2035	USD	670	660	0.00	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3511 'SA' 0.892% 15/02/2039	USD	48,456	2,784	0.00		FILMCO BONDS, Series 1883 'Z' 6.5% 15/07/2036	USD	930	938	0.00	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3831 'W' 5.48% 15/06/2030	USD	12,986	13,464	0.00		FILMCO BONDS, Series 2061 'Z' 6.5% 15/06/2038	USD	2,299	2,328	0.00	
FILMCO BONDS, FPN, Series 2739 'W' 3.412% 15/10/2030	USD	222,153	207,084	0.00		FILMCO BONDS, Series 3005 'Z' 5.83% 15/09/2035	USD	317,027	321,209	0.01	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3494 'C' 0.892% 15/01/2038	USD	143,747	9,087	0.00		FILMCO BONDS, Series 2220 'Z' 6% 15/09/2036	USD	6,158	6,087	0.00	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3748 'C' 0.892% 15/10/2040	USD	106,582	9,120	0.00		FILMCO BONDS, Series 1961 'Z' 6% 15/06/2038	USD	272,435	273,985	0.01	
FILMCO BONDS, FPN, Series 2725 'C' 1.824% 15/11/2030	USD	3,737	3,674	0.00		FILMCO BONDS, Series 1907 'W' 6.5% 15/01/2027	USD	12,117	12,230	0.00	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3455 'SE' 1.092% 15/06/2038	USD	160,557	16,652	0.00		FILMCO BONDS, Series 2394 'W' 6.5% 15/06/2031	USD	16,046	16,330	0.00	
FILMCO BONDS, FPN, Series 4021 'SE' 1.492% 15/02/2044	USD	2,164,248	272,298	0.01		FILMCO BONDS, Series 2259 'W' 7% 15/10/2030	USD	4,363	4,517	0.00	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3084 'S' 2.99% 15/11/2035	USD	50,483	53,396	0.00		Fifth Third Bancorp, FPN 4.772% 28/07/2030	USD	5,880,000	4,658,760	0.10	
FILMCO BONDS, FPN, Series 2416 'S' 5.78% 17/02/2032	USD	753	715	0.00		Fifth Third Bank NA 3.8% 15/03/2038	USD	200,000	183,705	0.00	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3481 'S' 0.742% 15/03/2038	USD	39,321	2,754	0.00		Flex Intermediate Boldo LLC, 1444 3.26% 30/06/2031	USD	2,255,000	1,791,046	0.04	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3385 'S' 0.892% 15/11/2037	USD	13,788	755	0.00		Flex Intermediate Boldo LLC, 1444 4.31% 30/12/2039	USD	1,145,000	823,827	0.02	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3029 'S' 5.42% 15/09/2035	USD	50,606	54,767	0.00		FPMMA 4.56% 01/05/2028	USD	9,070,000	9,065,169	0.19	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3212 'S' 1.992% 15/10/2036	USD	33,419	2,551	0.00		FPMMA 3.51% 01/07/2029	USD	11,880,000	10,446,185	0.22	
FILMCO BONDS, FPN, Series 2571 'S' 6.24% 15/12/2032	USD	48,343	47,954	0.00		FPMMA 1.27% 01/12/2029	USD	4,599,081	3,787,905	0.08	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3022 'S' 4.30% 15/08/2035	USD	6,704	6,194	0.00		FPMMA 4.41% 01/04/2030	USD	10,360,000	10,289,853	0.21	
FILMCO BONDS, Series 2189 'W' 7% 15/06/2039	USD	5,344	5,469	0.00		FPMMA 3.46% 01/08/2030	USD	4,920,602	4,634,793	0.10	
FILMCO BONDS, Series 2423 'W' 6.5% 15/03/2032	USD	38,602	38,778	0.00		FPMMA 4.24% 01/12/2030	USD	5,437,000	5,319,384	0.11	
FILMCO BONDS, Series 2434 'W' 7% 15/04/2032	USD	4,684	4,869	0.00		FPMMA 1.5% 01/01/2031	USD	10,580,000	8,396,884	0.17	
FILMCO BONDS, FPN, Series 3017 'W' 6% 15/04/2035	USD	19,427	18,722	0.00		FPMMA 3.99% 01/06/2031	USD	2,265,000	2,161,878	0.04	
						FPMMA 1.77% 01/11/2031	USD	8,780,000	6,996,714	0.14	
						FPMMA 3.54% 01/06/2032	USD	10,297,000	9,542,535	0.20	
						FPMMA 3.76% 01/07/2032	USD	5,122,000	4,828,690	0.10	
						FPMMA 3.84% 01/07/2032	USD	2,467,383	2,343,133	0.05	
						FPMMA 3.7% 01/08/2032	USD	9,820,000	8,457,778	0.17	
						FPMMA 3.41% 01/09/2032	USD	21,383,659	19,890,466	0.41	
						FPMMA 3.51% 01/09/2032	USD	5,272,000	4,866,882	0.10	
						FPMMA 3.8% 01/09/2032	USD	7,687,167	7,285,375	0.15	
						FPMMA 3.54% 01/10/2032	USD	3,899,044	3,620,281	0.07	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)	割合(%)						
FNMA 3.73% 01/10/2032	USD	9,832,813	9,297,821	0.19		FNMA, Series 2004-W1 '2A2' 7%	USD	30,301	31,400	0.00	
FNMA 3.81% 01/10/2032	USD	10,307,000	9,740,068	0.20		25/12/2033					
FNMA 4.55% 01/10/2032	USD	4,845,000	4,855,928	0.10		FNMA, Series 2004-W2 '2A2' 7%	USD	6,717	6,911	0.00	
FNMA 4.6% 01/10/2032	USD	7,700,000	7,743,215	0.16		25/02/2044					
FNMA 4.79% 01/10/2032	USD	6,996,123	7,103,227	0.15		FNMA, FPI, Series 2005-W1 '2A2'	USD	286,934	284,145	0.01	
FNMA 1.4% 01/11/2032	USD	12,000,000	9,083,206	0.19		5.31% 25/03/2045					
FNMA 3.94% 01/11/2032	USD	10,771,000	9,963,723	0.21		FNMA, IO, Series 383 '32' 6%	USD	25,755	5,001	0.00	
FNMA 5.23% 01/12/2032	USD	7,800,000	8,150,870	0.17		25/01/2038					
FNMA 5.29% 01/12/2032	USD	7,517,616	7,857,498	0.16		FNMA, FPI, Series 2003-W0 '3F1'	USD	37,396	37,106	0.00	
FNMA 3.896% 01/02/2033	USD	9,850,000	9,403,782	0.19		5.5% 25/05/2042					
FNMA 4.15% 01/03/2033	USD	6,900,000	6,708,988	0.14		FNMA, IO, FPI, Series 2003-W6 '4T'	USD	1,488,673	24,018	0.00	
FNMA 4.19% 01/04/2033	USD	7,766,000	7,578,603	0.16		0.5% 25/09/2042					
FNMA 4.9% 01/04/2033	USD	4,030,000	4,030,461	0.08		FNMA, Series 2000-W1 'A' 6%	USD	157,980	158,271	0.00	
FNMA 4.37% 01/05/2033	USD	10,090,000	9,978,585	0.21		25/12/2049					
FNMA 4.24% 01/06/2033	USD	5,627,000	5,505,801	0.11		FNMA, Series 2000-T6 'A1' 1.5%	USD	90,778	89,065	0.00	
FNMA 5.6% 01/01/2068	USD	5,160,637	5,295,804	0.11		25/11/2040					
FNMA 3.9% 01/03/2061	USD	6,226,917	5,642,681	0.12		FNMA, Series 2001-T7 'A1' 1.5%	USD	81,613	85,929	0.00	
FNMA 2.6% 01/07/2061	USD	6,995,261	5,720,217	0.12		25/02/2041					
FNMA 2.9% 01/09/2061	USD	10,961,376	8,963,366	0.19		FNMA, Series 2002-T18 'A2' 7%	USD	11,530	11,980	0.00	
FNMA 3% 01/12/2061	USD	8,076,635	6,985,784	0.14		25/07/2042					
FNMA 4% 01/12/2061	USD	7,212,082	6,757,406	0.14		FNMA, FPI, Series 2007-001 'A2'	USD	52,170	51,602	0.00	
FNMA 6% 01/12/2061	USD	9,299,490	9,743,958	0.20		4.825% 21/06/2026					
FNMA 2.6% 01/03/2062	USD	12,789,817	10,514,271	0.22		FNMA, Series 2015-W1 'A2' 2.525%	USD	1,841,941	1,772,902	0.04	
FNMA 3% 01/06/2062	USD	10,256,859	8,891,082	0.18		25/09/2024					
FNMA 3.6% 01/06/2062	USD	9,267,038	8,339,645	0.17		FNMA, FPI, Series 2015-W10 'A2'	USD	2,336,794	2,207,159	0.05	
FNMA 4% 01/09/2062	USD	9,913,803	9,205,368	0.19		3.092% 15/04/2027					
FNMA, FPI 1.754% 01/03/2032	USD	9,994,806	8,060,345	0.17		FNMA, Series 2015-W7 'A2' 2.59%	USD	2,076,284	1,990,461	0.04	
FNMA, FPI, Series 293 '1' 0%	USD		3,153	0.00		25/12/2024					
FNMA, FPI, Series 300 '1' 0%	USD		2,636	0.00		FNMA, Series 2016-W6 'A2' 2.49%	USD	4,096,356	3,830,226	0.08	
FNMA, FPI, Series 300 '1' 0%	USD		2,677	0.00		25/05/2026					
FNMA, Series 2004-W11 '1A1' 6%	USD	231,586	234,015	0.01		FNMA, Series 2016-W7 'A2' 2.49%	USD	1,895,730	1,764,173	0.04	
25/05/2044						25/09/2026					
FNMA, Series 2021-W3 '1A1' 1%	USD	1,089,553	1,002,656	0.02		FNMA, FPI, Series 2017-W1 'A2'	USD	3,223,064	2,993,332	0.06	
25/11/2033						2.415% 25/10/2026					
FNMA, Series 2005-W1 '1A2' 6.5%	USD	231,676	237,191	0.01		FNMA, FPI, Series 2017-W12 'A2'	USD	3,361,488	3,171,430	0.07	
25/10/2044						3.062% 25/06/2027					
FNMA, Series 2004-T2 '1A4' 7.5%	USD	131,187	133,958	0.00		FNMA, FPI, Series 2017-W3 'A2'	USD	946,250	879,100	0.02	
25/11/2043						2.415% 25/12/2026					
FNMA, FPI, Series 2007-W7 '1A4'	USD	3,947	4,528	0.00		FNMA, FPI, Series 2017-W4 'A2'	USD	5,632,483	5,242,595	0.11	
6.352% 25/07/2037						2.552% 25/12/2026					
FNMA, FPI, Series 2003-W4 '2A'	USD	3,312	3,290	0.00		FNMA, FPI, Series 2017-W5 'A2' 3.0%	USD	3,240,480	3,013,332	0.06	
5.167% 25/10/2042						25/04/2029					
FNMA, Series 2006-W3 '2A' 6%	USD	70,920	69,279	0.00		FNMA, FPI, Series 2017-W8 'A2'	USD	4,168,391	3,916,410	0.08	
25/09/2046						3.061% 25/05/2027					
FNMA, FPI, Series 2002-W6 '2A1' 7%	USD	42,506	40,909	0.00		FNMA, FPI, Series 2018-W10 'A2'	USD	4,677,000	4,425,778	0.09	
25/06/2042						3.157% 25/07/2028					
						FNMA, FPI, Series 2018-W4 'A2'	USD	1,998,148	1,877,035	0.04	
						3.064% 25/01/2028					

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
FNMA, Series 2001-MS0 'A2' 1.2%	USD	3,913,398	3,451,144	0.07		FNMA, PO, Series 2006-111 '80' 0%	USD	5,439	4,495	0.00	
25/10/2030						25/11/2036					
FNMA, FPN, Series 2007-106 'A1' 6.06%	USD	7,480,000	5,971,007	0.12		FNMA, PO, Series 2004-96 '8P' 0%	USD	21,361	20,229	0.00	
25/10/2037						25/03/2034					
FNMA, Series 2006-56 'AC' 5%	USD	39,165	39,850	0.00		FNMA, FPN, Series 2006-90 '8S' 4.0%	USD	22,926	22,872	0.00	
25/07/2038						25/10/2035					
FNMA, Series 2001-94 'AF6' 5.1%	USD	58,558	58,872	0.00		FNMA, Series 2005-67 '8T' 5.5%	USD	23,492	23,177	0.00	
25/01/2032						25/08/2025					
FNMA, Series 2010-111 'AM' 5.5%	USD	4,580	4,516	0.00		FNMA, FPN, Series 412 'F2' 5.63%	USD	316,361	316,831	0.01	
25/10/2040						25/09/2042					
FNMA, PO, Series 2006-22 '40' 0%	USD	405,976	415,499	0.01		FNMA, FPN, Series 2007-54 '8A' 5.52%	USD	16,773	16,438	0.00	
25/04/2036						25/06/2037					
FNMA, PO, Series 2001-42 '40' 0%	USD	15,910	13,444	0.00		FNMA, FPN, Series 2007-16 '8C' 5.88%	USD	3,413	3,379	0.00	
25/06/2031						25/03/2037					
FNMA, PO, Series 2009-113 '40' 0%	USD	4,645	3,997	0.00		FNMA, FPN, Series 2010-42 '8D' 5.73%	USD	188,462	187,460	0.00	
25/01/2040						25/05/2040					
FNMA, PO, Series 2006-58 '4P' 0%	USD	42,761	36,732	0.00		FNMA, FPN, Series 2003-119 '8E' 5.63%	USD	70,898	70,829	0.00	
25/07/2036						25/11/2033					
FNMA, IO, FPN, Series 2007-88 '4J' 2.01%	USD	13,107	10,943	0.00		FNMA, FPN, Series 2004-61 '8F' 5.91%	USD	103,525	104,428	0.00	
25/01/2037						25/11/2032					
FNMA, Series 2001-105 '4Z' 5.5%	USD	181,584	20,564	0.00		FNMA, FPN, Series 2010-49 'FJ' 5.73%	USD	47,583	47,526	0.00	
25/10/2031						25/04/2040					
FNMA, Series 2001-76 '4Z' 5.5%	USD	410,663	411,706	0.01		FNMA, Series 2007-71 '8G' 0%	USD	64,137	66,263	0.00	
25/08/2031						25/07/2037					
FNMA, Series 2004-97 'B' 5.5%	USD	38,737	38,401	0.00		FNMA, IO, FPN, Series 2006-94 '8I' 1.51%	USD	48,874	935	0.00	
25/01/2035						25/10/2026					
FNMA, Series 2007-42 'B' 6%	USD	2,788,831	2,730,382	0.06		FNMA, Series 2009-69 '8L' 5%	USD	326,822	322,118	0.01	
25/05/2037						25/09/2039					
FNMA, Series 2001-79 'BA' 7%	USD	98,788	100,265	0.00		FNMA, PO, Series 2006-44 '8O' 0%	USD	9,352	7,906	0.00	
25/03/2045						25/06/2036					
FNMA, IO, FPN, Series 2008-1 'BI' 0.77%	USD	44,580	45,180	0.00		FNMA, IO, FPN, Series 2009-6 '8S' 1.41%	USD	40,330	3,439	0.00	
25/02/2038						25/02/2039					
FNMA, FPN, Series 2012-107 'CP' 5.42%	USD	59,557	3,988	0.00		FNMA, FPN, Series 2006-104 '8B' 3.95%	USD	34,599	35,713	0.00	
25/08/2041						25/11/2036					
FNMA, IO, FPN, Series 2008-33 'CI' 2.06%	USD	183,648	182,210	0.00		FNMA, Series 2009-59 '8B' 5%	USD	141,596	139,719	0.00	
25/01/2038						25/08/2039					
FNMA, FPN, Series 2005-74 'CS' 5.81%	USD	25,504	2,436	0.00		FNMA, Series 2001-81 '8E' 6.5%	USD	135,097	137,722	0.00	
25/06/2035						25/01/2032					
FNMA, FPN, Series 2005-45 'DC' 5.41%	USD	18,889	18,926	0.00		FNMA, IO, FPN, Series 2007-116 '8I' 0%	USD	59,961	2,176	0.00	
25/06/2035						0%					
FNMA, FPN, Series 2006-79 'DF' 5.48%	USD	40,696	39,425	0.00		FNMA, IO, FPN, Series 2008-46 '8I' 0%	USD	19,693	1,001	0.00	
25/08/2036						25/06/2038					
FNMA 'DN' 2.5%	USD	18,595	18,474	0.00		FNMA, IO, Series 2008-33 'JA' 6.5%	USD	49,427	8,912	0.00	
25/10/2049						25/05/2035					
FNMA, PO, Series 2006-79 'DO' 0%	USD	2,906,008	2,482,494	0.05		FNMA, IO, Series 2009-88 'JP' 5.5%	USD	40,465	7,440	0.00	
25/08/2036						25/10/2039					
FNMA, IO, FPN, Series 2007-12 'EK' 1.26%	USD	13,453	11,813	0.00		FNMA, IO, FPN, Series 2008-16 '8S' 1.06%	USD	24,678	1,473	0.00	
25/01/2037						25/01/2038					

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
FNMA, IO, Series 2001-25 '10' 6%	USD	45,144	7,783	0.00		FNMA, Series 2009-69 'P' 5%	USD	5,120	4,967	0.00	
25/05/2022						25/03/2027					
FNMA, IO, Series 2001-44 '10' 1%	USD	15,423	3,389	0.00		FNMA, PO, Series 2006-44 'P' 0%	USD	27,247	22,721	0.00	
25/06/2022						25/12/2023					
FNMA, IO, FPN, Series 2007-65 '31' 1.48%	USD	57,092	4,895	0.00		FNMA, Series 1998-58 'PC' 6.5%	USD	20,543	20,684	0.00	
25/01/2027						25/10/2028					
FNMA, IO, FPN, Series 2008-28 '35' 1.96%	USD	59,926	3,646	0.00		FNMA, Series 2005-109 'PC' 0%	USD	43,711	43,679	0.00	
25/02/2040						25/12/2025					
FNMA, Series 2011-118 'LB' 7%	USD	399,299	421,033	0.01		FNMA, Series 2006-77 'PC' 6.5%	USD	37,469	38,107	0.00	
25/11/2041						25/08/2026					
FNMA, IO, FPN, Series 2011-20 'LS' 0%	USD	104,652	5,300	0.00		FNMA, Series 1997-29 'PD' 1.5%	USD	3,341	3,383	0.00	
25/04/2041						20/05/2027					
FNMA, FPN, Series 2006-23 'LS' 7.02%	USD	26,133	29,518	0.00		FNMA, Series 2001-44 'PD' 7%	USD	1,123	1,163	0.00	
25/06/2026						25/09/2021					
FNMA, Series 2005-84 'MS' 5.75%	USD	22,925	22,830	0.00		FNMA, Series 2001-7 'PF' 7%	USD	780	816	0.00	
25/10/2025						25/03/2031					
FNMA, FPN, Series 2009-103 'MS' 4.40%	USD	29,134	29,517	0.00		FNMA, Series 2011-52 'PS' 5%	USD	1,224,055	1,239,258	0.03	
25/12/2029						25/06/2041					
FNMA, Series 2011-118 'MT' 7%	USD	357,659	375,066	0.01		FNMA, IO, FPN, Series 2007-109 'PI'	USD	82,340	3,726	0.00	
25/11/2041						1.20%	25/02/2027				
FNMA, Series 2006-85 'MS' 6.5%	USD	17,479	18,011	0.00		FNMA, IO, Series 2009-52 'PI' 5%	USD	29,570	5,184	0.00	
25/09/2026						25/07/2029					
FNMA, Series 2018-38 'NS' 3%	USD	1,673,953	1,523,214	0.03		FNMA, Series 1994-83 'PX' 7%	USD	4,022	4,011	0.00	
25/01/2046						25/04/2024					
FNMA, IO, FPN, Series 2002-210 0.91%	USD	470,970	12,225	0.00		FNMA, Series 1991-201 'PL' 6.5%	USD	1,091	1,093	0.00	
25/08/2042						25/10/2023					
FNMA, PO, Series 2005-90 0%	USD	4,044	3,868	0.00		FNMA, FPN, Series 2006-11 'PS' 5.72%	USD	36,585	41,640	0.00	
25/09/2025						25/02/2026					
FNMA, PO, Series 2006-110 0%	USD	10,147	8,439	0.00		FNMA, FPN, Series 2006-62 'PS'	USD	6,438	7,964	0.00	
25/11/2026						9.01%	25/07/2026				
FNMA, PO, Series 2006-36 0%	USD	166,104	139,296	0.00		FNMA, FPN, Series 2004-73 'PT1'	USD	85,256	88,413	0.00	
25/05/2026						9.40%	25/01/2041				
FNMA, PO, Series 2006-58 0%	USD	29,188	34,384	0.00		FNMA, Series 2005-76 'P2' 5.5%	USD	357,190	360,596	0.01	
25/07/2026						25/09/2025					
FNMA, PO, Series 2007-48 0%	USD	80,589	51,113	0.00		FNMA, PO, Series 2006-65 'Q0' 0%	USD	8,571	7,296	0.00	
25/05/2027						25/07/2026					
FNMA, PO, Series 2009-69 0%	USD	51,457	40,449	0.00		FNMA, IO, FPN, Series 2009-17 'Q5'	USD	24,859	1,612	0.00	
25/09/2029						1.51%	25/03/2029				
FNMA, PO, Series 2013-92 0%	USD	203,229	153,040	0.00		FNMA, FPN, Series 2008-28 'Q5'	USD	26,167	26,864	0.00	
25/09/2043						5.20%	25/04/2028				
FNMA, Series 2011-118 'NT' 7%	USD	430,930	449,150	0.01		FNMA, IO, FPN, Series 2005-96 'S'	USD	35,327	2,656	0.00	
25/11/2041						1.57%	25/01/2025				
FNMA, PO, Series 2006-27 'OH' 0%	USD	15,743	13,547	0.00		FNMA, IO, FPN, Series 1996-4 'SA'	USD	2,428	23	0.00	
25/04/2026						3.26%	25/02/2024				
FNMA, PO, Series 2006-15 'OP' 0%	USD	54,690	44,792	0.00		FNMA, IO, FPN, Series 2007-108 'Sa'	USD	7,614	421	0.00	
25/02/2026						1.22%	25/02/2027				
FNMA, PO, Series 2009-86 'OT' 0%	USD	120,535	98,073	0.00		FNMA, IO, FPN, Series 2008-80 'SA'	USD	33,911	2,093	0.00	
25/10/2021						0.71%	25/09/2028				

JPMorgan Funds – US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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(%)	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(%)
FNMA, IO, FNM, Series 2010-125 'SI' 05/11/2040	USD	161,002	3,927	0.00	FNMA, Series 2009-79 'UI' 7% 25/03/2038	USD	7,532	7,600	0.00
FNMA, IO, FNM, Series 2010-08 'SI' 0% 25/07/2040	USD	150,516	7,420	0.00	FNMA, IO, FNM, Series 2006-53 'OS' 1.44% 25/06/2036	USD	67,875	5,257	0.00
FNMA, FNM, Series 2004-25 'SA' 5.29% 15/04/2034	USD	3,198	3,245	0.00	FNMA, IO, FNM, Series 2012-134 'US' 1.06% 25/01/2042	USD	1,291,580	60,546	0.00
FNMA, IO, FNM, Series 2009-116 'SO' 2.49% 25/11/2009	USD	12,045	877	0.00	FNMA, IO, FNM, Series 2007-88 'SI' 1.40% 25/09/2017	USD	126,708	11,026	0.00
FNMA, IO, FNM, Series 2008-81 'SO' 0.71% 25/09/2018	USD	66,247	3,293	0.00	FNMA, Series 2004-50 'VZ' 5.5% 25/07/2014	USD	442,001	440,445	0.01
FNMA, IO, FNM, Series 2010-35 'SO' 1.32% 25/04/2040	USD	40,031	2,644	0.00	FNMA, FNM, Series 2010-1 'W' 6.22% 25/02/2040	USD	58,066	58,025	0.00
FNMA, FNM, Series 2010-49 'SO' 2.30% 15/03/2040	USD	94,675	90,266	0.00	FNMA, FNM, Series 2010-61 'WS' 5.93% 15/06/2040	USD	61,540	62,318	0.00
FNMA, FNM, Series 2007-1 'SO' 8.17% 25/02/2017	USD	20,326	31,919	0.00	FNMA, FNM, Series 2011-42 'WS' 5.83% 15/05/2051	USD	49,390	49,408	0.00
FNMA, FNM, Series 2002-5 'SE' 5.02% 25/02/2012	USD	8,129	8,003	0.00	FNMA, Series 2006-53 'VE' 0% 25/06/2016	USD	368,804	377,398	0.01
FNMA, IO, FNM, Series 2007-1 'SO' 1.36% 25/08/2016	USD	94,673	9,901	0.00	FNMA, IO, FNM, Series 2000-8 'WI' 1.96% 25/03/2016	USD	540,491	48,742	0.00
FNMA, FNM, Series 2006-05 'SO' 5.64% 15/10/2016	USD	14,772	16,501	0.00	FNMA, Series 2005-8 'WQ' 0% 25/03/2016	USD	149,588	118,996	0.00
FNMA, FNM, Series 2007-29 'SO' 5.94% 25/04/2017	USD	16,284	17,240	0.00	FNMA, IO, FNM, Series 2009-84 'US' 0.76% 25/10/2019	USD	17,967	966	0.00
FNMA, IO, FNM, Series 2007-33 'SO' 0.96% 25/06/2017	USD	56,849	3,399	0.00	FNMA, IO, FNM, Series 2007-W30 'SI' 1.82% 25/03/2030	USD	55,281,582	3,532,703	0.07
FNMA, FNM, Series 2004-61 'SI' 3.44% 15/11/2012	USD	12,941	12,956	0.00	FNMA, IO, FNM, Series 2011-W3 'SI' 1.93% 25/11/2013	USD	12,290,778	1,066,933	0.02
FNMA, FNM, Series 2004-46 'SI' 2.31% 25/05/2014	USD	25,041	23,795	0.00	FNMA, Series 2005-84 'SI' 5.15% 25/10/2015	USD	274,268	273,267	0.01
FNMA, FNM, Series 2005-74 'SI' 6.00% 15/06/2015	USD	18,869	18,925	0.00	FNMA, IO, FNM, Series 2008-10 'SI' 1.08% 25/03/2018	USD	19,223	1,491	0.00
FNMA, FNM, Series 2001-85 'SI' 3.30% 15/09/2017	USD	9,986	9,601	0.00	FNMA, Series 2005-84 'SI' 5.15% 25/10/2015	USD	18,875	18,806	0.00
FNMA, FNM, Series 2008-18 'SI' 3.72% 15/03/2018	USD	11,810	10,322	0.00	FNMA, IO, FNM, Series 2007-92 'SI' 0.64% 25/06/2017	USD	99,906	9,082	0.00
FNMA, IO, FNM, Series 2009-112 'SI' 1.12% 25/01/2040	USD	60,546	5,211	0.00	FNMA, Series 1998-141 'Z' 7% 25/08/2023	USD	484	482	0.00
FNMA, FNM, Series 2005-75 'SI' 3.64% 15/09/2015	USD	28,153	26,906	0.00	FNMA, Series 1998-99 'Z' 7% 25/07/2023	USD	94	94	0.00
FNMA, FNM, Series 2004-74 'SI' 5.21% 15/11/2011	USD	16,908	17,491	0.00	FNMA, Series 1996-48 'Z' 7% 25/11/2026	USD	11,614	11,569	0.00
FNMA, FNM, Series 2001-52 'SI' 7.52% 15/10/2011	USD	3,851	4,152	0.00	FNMA, Series 2010-30 'Z' 6% 25/05/2012	USD	64,678	65,050	0.00
FNMA, IO, Series 2006-72 'IO' 0% 25/08/2016	USD	9,713	0,009	0.00	FNMA, Series 1998-44 'ZA' 6.5% 20/07/2018	USD	170,364	171,265	0.00
FNMA, FNM, Series 2005-56 'IO' 2.72% 15/08/2013	USD	10,287	9,784	0.00	FNMA, Series 2002-50 'ZA' 6% 25/05/2011	USD	81,198	81,298	0.00

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
FNMA, Series 2011-39 '2A' 6%	USD	187,024	189,107	0.00		FNMA, FRN 851432 4.365%	USD	103,684	102,125	0.00	
25/11/2033						01/10/2035					
FNMA, Series 2011-47 '2A' 5.5%	USD	155,060	156,370	0.00		FNMA, FRN 872502 3.694%	USD	28,197	28,565	0.00	
25/07/2033						01/06/2035					
FNMA, FRN, Series 1993-126 '2B' 6%	USD	112	110	0.00		FNMA, FRN 884066 3.811%	USD	15,389	15,154	0.00	
25/01/2033						01/06/2036					
FNMA, Series 1998-36 '2B' 6%	USD	656	657	0.00		FNMA, FRN 886588 4.023%	USD	15,583	15,465	0.00	
18/07/2028						01/08/2036					
FNMA, Series 2007-76 '2S' 6%	USD	59,629	59,539	0.00		FNMA 888408 6% 01/03/2037	USD	13,720	13,779	0.00	
25/08/2037						FNMA, FRN 888605 4.513%	USD	1,677	1,639	0.00	
FNMA 252489 6.5% 01/03/2029	USD	1,892	1,892	0.00		01/07/2035					
FNMA 257172 5.5% 01/04/2030	USD	10,606	10,721	0.00		FNMA 888796 6% 01/09/2037	USD	45,968	45,981	0.00	
FNMA 257183 7% 01/03/2038	USD	64,201	64,134	0.00		FNMA, FRN 888829 5.888%	USD	437,090	432,520	0.01	
FNMA 257209 5.5% 01/05/2030	USD	14,448	14,516	0.00		01/06/2037					
FNMA 468571 4.45% 01/07/2026	USD	789,835	789,991	0.02		FNMA, FRN 894661 4.32% 01/10/2034	USD	28,509	28,751	0.00	
FNMA 650236 5% 01/12/2032	USD	1,102	1,096	0.00		FNMA 900177 7.5% 01/08/2036	USD	19,360	19,873	0.00	
FNMA, FRN 722985 3.902%	USD	3,853	3,802	0.00		01/10/2036					
01/07/2033						FNMA, FRN 906694 4.077%	USD	11,461	11,612	0.00	
FNMA, FRN 735332 4.351%	USD	13,800	13,693	0.00		01/12/2036					
01/08/2034						FNMA, FRN 920843 4.784%	USD	101,390	103,537	0.00	
FNMA, FRN 745445 4.461%	USD	30,968	31,327	0.00		01/03/2036					
01/01/2036						FNMA, FRN 920954 5.343%	USD	52,139	52,811	0.00	
FNMA, FRN 745446 4.555%	USD	9,469	9,492	0.00		01/01/2037					
01/04/2033						FNMA 932355 6% 01/12/2039	USD	502,534	506,007	0.01	
FNMA 754922 5.5% 01/09/2030	USD	5,374	5,345	0.00		FNMA 933032 6% 01/10/2037	USD	7,809	7,628	0.00	
FNMA, FRN 756610 3.965%	USD	3,069	2,987	0.00		FNMA 961192 7% 01/01/2038	USD	24,591	24,646	0.00	
01/01/2034						FNMA, FRN 966946 4.285%	USD	13,061	12,760	0.00	
FNMA 771959 5.5% 01/02/2034	USD	13,761	13,606	0.00		01/01/2038					
FNMA, FRN 771131 3.43% 01/06/2034	USD	45,412	45,856	0.00		FNMA 995763 6% 01/11/2037	USD	10,942	11,099	0.00	
FNMA, FRN 781309 4.11% 01/07/2034	USD	10,859	10,728	0.00		FNMA AD9270 4.125% 01/07/2040	USD	117,549	112,726	0.00	
FNMA, FRN 790235 3.86% 01/06/2034	USD	11,178	10,961	0.00		FNMA AD8549 5.5% 01/01/2033	USD	59,936	58,890	0.00	
FNMA, FRN 791961 3.688%	USD	6,299	6,149	0.00		FNMA AED346 6% 01/05/2037	USD	52,438	52,635	0.00	
01/09/2034						FNMA AEA168 4.25% 01/07/2040	USD	103,582	100,432	0.00	
FNMA, FRN 801342 3.855%	USD	31,563	30,955	0.00		FNMA AEA183 4.125% 01/09/2040	USD	92,243	89,442	0.00	
01/09/2034						FNMA AL2606 4% 01/03/2042	USD	51,408	47,411	0.00	
FNMA, FRN 810896 5.592%	USD	19,317	19,564	0.00		FNMA AL6167 5.5% 01/01/2044	USD	1,300,114	1,206,565	0.03	
01/01/2035						FNMA, FRN AL6805 1.81% 01/01/2026	USD	957,462	929,119	0.02	
FNMA, FRN 816597 4.045%	USD	9,688	9,431	0.00		FNMA AL7395 5.556% 01/03/2038	USD	1,599,785	1,628,754	0.03	
01/02/2035						FNMA AM6660 3.765% 01/12/2025	USD	949,041	918,908	0.02	
FNMA, FRN 823660 4.217%	USD	17,170	16,762	0.00		FNMA AM6940 3.24% 01/06/2026	USD	833,833	795,167	0.02	
01/05/2035						FNMA AM6448 3.25% 01/09/2026	USD	2,739,907	2,610,895	0.05	
FNMA, FRN 843026 5.96% 01/09/2035	USD	15,029	15,171	0.00		FNMA AM7514 3.07% 01/02/2025	USD	6,000,000	5,773,079	0.12	
FNMA, FRN 843028 5.989%	USD	9,771	9,901	0.00		FNMA AM7649 2.885% 01/01/2025	USD	5,430,109	5,215,250	0.11	
01/09/2035						FNMA AM7785 3.17% 01/02/2030	USD	1,806,425	1,676,089	0.03	
FNMA 847188 6.5% 01/10/2035	USD	50,217	49,718	0.00		FNMA AM7836 3.11% 01/03/2027	USD	2,717,175	2,558,054	0.05	
FNMA, FRN 849251 5.333%	USD	41,001	40,471	0.00		FNMA AM8544 3.08% 01/04/2030	USD	1,807,658	1,666,886	0.03	
01/01/2036						FNMA AM8846 2.68% 01/05/2025	USD	3,381,534	3,220,432	0.07	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)	割合(%)						
FNMA AM9100 3.12% 01/06/2035	USD	3,000,000	2,645,400	0.05		FNMA ACES, FRN 'PT' 3.235%	USD	8,477,422	7,756,088	0.16	
FNMA AM9548 3.17% 01/08/2025	USD	3,000,000	2,874,325	0.06		25/04/2031					
FNMA AM9934 3.08% 01/10/2025	USD	5,071,535	4,942,887	0.10		FRN Greater Trust, Series 2017-01 'A'	USD	4,294,709	3,985,951	0.08	
FNMA AN1243 2.64% 01/06/2026	USD	2,999,000	2,809,830	0.06		1.88% 25/06/2027					
FNMA AN1247 2.64% 01/06/2026	USD	2,462,000	2,307,102	0.05		Ford Foundation (The) 2.815%	USD	825,000	505,178	0.01	
FNMA AN1583 3.04% 01/05/2031	USD	1,381,191	1,255,942	0.03		01/06/2070					
FNMA AN1590 2.4% 01/05/2026	USD	2,561,449	2,389,877	0.05		FRMCF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	13,563,000	13,009,371	0.27	
FNMA AN2005 2.73% 01/07/2028	USD	1,893,325	1,735,825	0.04		2015-644 'B', 1444 3.119%	USD	8,250,000	7,894,918	0.16	
FNMA AN2009 2.7% 01/07/2026	USD	4,668,891	4,372,659	0.09		25/01/2048					
FNMA AN2124 2.85% 01/01/2029	USD	2,031,324	1,867,019	0.04		FRMCF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	2,825,000	2,683,362	0.06	
FNMA AN2370 2.44% 01/08/2026	USD	2,951,307	2,748,641	0.06		2015-645 'B', 1444 3.61% 25/04/2048	USD	14,935,000	14,254,012	0.29	
FNMA AN2388 2.64% 01/08/2028	USD	2,416,418	2,212,507	0.05		FRMCF Mortgage Trust, FRN 'B', 1444	USD	1,665,000	1,588,411	0.03	
FNMA AN2429 2.45% 01/12/2026	USD	3,662,320	3,389,279	0.07		3.50% 25/06/2048					
FNMA AN2444 2.43% 01/08/2026	USD	6,285,284	5,851,077	0.12		FRMCF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	7,149,000	6,829,445	0.14	
FNMA AN2487 2.8% 01/08/2028	USD	895,300	828,034	0.02		2015-648 'B', 1444 3.646%	USD	6,830,000	6,505,756	0.13	
FNMA AN2906 2.83% 01/10/2031	USD	5,393,632	4,759,222	0.10		25/08/2048					
FNMA AN3134 2.58% 01/10/2028	USD	1,640,720	1,503,752	0.03		FRMCF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	18,226,000	17,341,520	0.36	
FNMA AN3254 2.8% 01/11/2031	USD	1,553,431	1,411,802	0.03		2015-649 'B', 1444 3.125%	USD	3,500,000	3,299,539	0.07	
FNMA AN3364 2.6% 01/10/2028	USD	4,800,601	4,382,186	0.09		25/10/2048					
FNMA AN4331 2.6% 01/11/2028	USD	3,964,622	3,616,011	0.07		FRMCF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	3,050,000	2,835,644	0.06	
FNMA AN5665 2.94% 01/12/2028	USD	8,646,348	7,944,868	0.16		2015-651 'B', 1444 3.951% 25/10/2048	USD	2,500,000	2,304,690	0.05	
FNMA AN5685 2.69% 01/12/2028	USD	9,548,000	8,679,509	0.18		FRMCF Mortgage Trust, FRN 'B', 1444	USD	6,606,000	6,477,522	0.13	
FNMA AN5788 2.79% 01/02/2027	USD	2,016,322	1,883,638	0.04		4.05% 25/04/2048					
FNMA AN5801 2.94% 01/12/2026	USD	3,480,547	3,280,763	0.07		FRMCF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	2,500,000	2,304,690	0.05	
FNMA AN4110 2.95% 01/04/2025	USD	4,920,255	4,705,725	0.10		2016-655 'B', 1444 4.167%	USD	6,000,000	5,800,060	0.12	
FNMA AN4154 3.17% 01/01/2029	USD	7,560,000	7,023,436	0.15		25/04/2049					
FNMA AN5527 3.02% 01/07/2029	USD	9,859,869	9,094,291	0.19		FRMCF Mortgage Trust, FRN 'B', 1444	USD	3,050,000	2,835,644	0.06	
FNMA AN5935 3.13% 01/07/2027	USD	1,029,522	976,105	0.02		3.91% 25/08/2049					
FNMA AN6244 3.09% 01/09/2029	USD	7,788,000	7,141,333	0.15		FRMCF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	8,401,442	7,876,914	0.16	
FNMA AQ9352 4% 01/07/2042	USD	216,005	206,065	0.00		2016-658 'B', 1444 3.138%	USD	6,179,000	5,757,042	0.12	
FNMA AQ9999 3% 01/02/2043	USD	926,386	837,497	0.02		25/09/2049					
FNMA A57212 3.5% 01/04/2036	USD	943,700	882,074	0.02		FRMCF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	3,850,000	3,606,000	0.07	
FNMA BFD464 3.5% 01/03/2060	USD	6,819,276	6,203,812	0.13		2016-659 'B', 1444 3.8% 25/11/2049	USD	11,768,052	11,331,305	0.23	
FNMA BL2595 3.34% 01/07/2028	USD	2,882,002	2,719,631	0.06		FRMCF Mortgage Trust, FRN 'B', 1444	USD	11,768,052	11,331,305	0.23	
FNMA BL2805 3.07% 01/08/2031	USD	6,208,000	5,541,831	0.11		3.8% 25/01/2050					
FNMA BL2616 2.88% 01/07/2028	USD	11,286,455	10,406,695	0.21		FRMCF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	2,500,000	2,304,690	0.05	
FNMA BL4070 2.37% 01/08/2030	USD	9,345,349	8,177,344	0.17		2011-670 'B', 1444 3.809%	USD	6,606,000	6,477,522	0.13	
FNMA BL4118 2.42% 01/09/2028	USD	4,601,873	4,154,064	0.09		25/12/2049					
FNMA BL4398 2.59% 01/10/2031	USD	1,800,000	1,557,146	0.03		FRMCF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	2,500,000	2,304,690	0.05	
FNMA BL4411 2.47% 01/10/2031	USD	5,445,801	4,896,839	0.10		2011-6715 'B', 1444 1.90%	USD	6,606,000	6,477,522	0.13	
FNMA BL4435 2.42% 01/10/2029	USD	5,525,000	4,874,844	0.10		25/02/2050					
FNMA MA1463 3.5% 01/06/2043	USD	430,339	399,750	0.01		FRMCF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	6,000,000	5,800,060	0.12	
FNMA MA2592 3.5% 01/04/2046	USD	1,674,531	1,557,155	0.03		2011-6718 'B', 1444 1.651%	USD	6,000,000	5,800,060	0.12	
FNMA MA2633 3.5% 01/04/2046	USD	897,894	834,942	0.02		25/11/2050					
FNMA MA2734 3.5% 01/08/2046	USD	2,215,405	2,060,103	0.04		FRMCF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	11,768,052	11,331,305	0.23	
FNMA ACES, FRN 'A2' 1.532% 25/09/2031	USD	10,000,000	8,018,704	0.17		2011-6729 'B', 1444 1.672% 25/11/2049	USD	11,768,052	11,331,305	0.23	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K117 'B', 1444 4.390% 25/09/2021	USD	5,150,000	4,471,204	0.09		FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K154 'C', 1444 4.650% 25/04/2049	USD	3,000,000	2,837,168	0.06	
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K72 'B', 1444 3.994% 25/12/2050	USD	1,933,000	1,785,539	0.04		FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2017-882 'C', 1444 3.83% 25/01/2030	USD	8,016,355	7,942,338	0.15	
FREMF Mortgage Trust, FRM 'B', 1444 3.854% 25/02/2051	USD	1,515,000	1,395,811	0.03		FREMF Mortgage Trust, FRM 'C', 1444 3.878% 25/02/2030	USD	1,700,000	1,572,263	0.03	
FREMF Mortgage Trust, FRM 'B', 1444 3.755% 25/02/2030	USD	10,000,000	9,590,332	0.20		FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2011-K724 'C', 1444 1.480% 25/12/2049	USD	6,325,000	6,224,944	0.13	
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K712 'B', 1444 4.051% 25/05/2025	USD	4,910,000	4,704,408	0.10		FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2011-K725 'C', 1444 1.904% 25/02/2050	USD	2,255,000	2,205,511	0.05	
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K74 'B', 1444 4.094% 25/02/2051	USD	5,680,000	5,182,796	0.11		FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2011-K726 'C', 1444 4.609% 25/07/2049	USD	8,489,000	8,199,222	0.17	
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K75 'B', 1444 3.975% 25/04/2051	USD	3,000,000	2,764,778	0.06		FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2011-K728 'C', 1444 1.651% 25/11/2050	USD	5,540,000	5,323,974	0.11	
FREMF Mortgage Trust, FRM 'B', 1444 4.305% 25/09/2051	USD	2,500,000	2,307,001	0.05		FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K711 'C', 1444 1.938% 25/02/2025	USD	14,725,000	14,097,884	0.29	
FREMF Mortgage Trust, FRM 'B', 1444 4.215% 25/09/2051	USD	3,040,000	2,838,788	0.06		FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K712 'C', 1444 4.684% 25/09/2025	USD	2,883,000	1,977,497	0.04	
FREMF Mortgage Trust, FRM 'B', 1444 4.175% 25/09/2051	USD	6,526,000	6,046,890	0.12		FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K76 'C', 1444 4.388% 25/06/2051	USD	4,861,000	3,736,680	0.08	
FREMF Mortgage Trust, FRM 'B', 1444 4.385% 25/10/2038	USD	12,000,000	11,107,528	0.23		FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K78 'C', 1444 4.22% 25/06/2051	USD	7,858,000	6,461,279	0.13	
FREMF Mortgage Trust, FRM 'B', 1444 4.294% 25/11/2051	USD	2,000,000	1,869,184	0.04		FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K511 'C', 1444 1.856% 25/11/2025	USD	8,000,000	7,128,272	0.15	
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K512 'B', 1.143% 25/09/2028	USD	2,058,209	1,851,771	0.04		FREMF Trust, FRM, Series 2018-8004 'B', 1444 1.925% 25/09/2028	USD	6,775,000	5,776,822	0.12	
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2018-K511 'B', 1444 1.856% 25/11/2025	USD	10,000,000	9,186,611	0.19		General Motors Financial Co., Inc., FRM 6.28% 17/11/2023	USD	2,930,000	2,932,301	0.06	
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2011-K211 'BPL', 1444 1.562% 25/10/2021	USD	5,252,032	4,969,582	0.10		Geleed Sciences, Inc. 2.8% 01/10/2040	USD	3,870,000	2,206,449	0.05	
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2011-K211 'BPL', 1444 1.593% 25/10/2021	USD	5,000,000	4,473,551	0.09		Glencore Funding LLC, 1444 4.625% 29/04/2024	USD	700,000	691,839	0.01	
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2014-K29 'C', 1444 4.156% 25/08/2041	USD	2,500,000	2,431,326	0.05		Glencore Funding LLC, 1444 2.5% 01/09/2020	USD	5,585,000	4,580,757	0.09	
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2014-K40 'C', 1444 4.015% 25/11/2041	USD	3,521,000	3,401,516	0.07		GMAC Mortgage Loan Trust, FRM, Series 2005-AR3 '344' 3.805% 19/08/2035	USD	33,750	31,569	0.00	
FREMF Mortgage Trust, FRM, Series 2015-K45 'C', 1444 1.61% 25/04/2048	USD	8,598,000	8,204,869	0.17		GMMA, 10, FRM, Series 2019-R17 1.872% 28/11/2069	USD	15,805,344	612,173	0.01	
						GMMA, 2.5% 20/08/2051	USD	62,188,178	53,736,720	1.11	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)	割合(%)						
GNMA 2.5% 20/10/2051	USD	11,863,606	10,344,520	0.21		GNMA, Series 2005-72 'A2' 5.5%	USD	284,973	284,146	0.01	
GNMA 5% 20/06/2052	USD	2,733,598	2,682,094	0.06		20/09/2025					
GNMA 5% 20/07/2052	USD	1,280,152	1,267,056	0.03		GNMA, FPI, Series 2012-898 '2P'	USD	649,279	641,260	0.01	
GNMA 5% 20/07/2052	USD	1,278,066	1,275,263	0.03		5.25% 20/01/2063					
GNMA 5% 20/07/2052	USD	3,934,519	3,914,996	0.08		GNMA, PO, Series 2010-14 '20' 0%	USD	62,726	51,250	0.00	
GNMA 5% 20/07/2052	USD	5,181,312	5,115,515	0.11		20/11/2025					
GNMA 4% 20/08/2052	USD	17,907,814	16,903,938	0.35		GNMA, FPI, Series 2012-821 'CP'	USD	4,434	4,361	0.00	
GNMA 4.5% 20/09/2052	USD	2,343,616	2,161,678	0.04		4.811% 20/05/2061					
GNMA 4.5% 20/10/2052	USD	3,373,046	3,205,561	0.07		GNMA, FPI 'CP' 6.08% 20/09/2071	USD	5,368,423	5,425,726	0.11	
GNMA 5.5% 20/10/2052	USD	1,140,512	1,144,990	0.02		GNMA, PO, Series 2010-14 'CO' 0%	USD	44,346	38,211	0.00	
GNMA 5.5% 20/10/2052	USD	1,550,679	1,549,764	0.03		20/09/2025					
GNMA 5.5% 20/10/2052	USD	1,585,859	1,564,938	0.03		GNMA, Series 2010-130 'CP' 7%	USD	79,932	83,744	0.00	
GNMA 5.5% 20/10/2052	USD	1,640,600	1,647,183	0.03		16/10/2040					
GNMA 5.5% 20/10/2052	USD	3,258,040	3,261,938	0.07		GNMA, FPI, Series 2012-821 'CP'	USD	7,889	7,775	0.00	
GNMA 5.5% 20/06/2053	USD	5,594,045	5,477,383	0.11		4.811% 20/05/2061					
GNMA 6% 20/01/2053	USD	1,048,064	1,068,750	0.02		GNMA, FPI, Series 2017-899 'CP'	USD	3,862,928	3,838,988	0.06	
GNMA 6% 20/01/2053	USD	2,143,699	2,161,222	0.04		5.65% 20/01/2067					
GNMA 6% 20/02/2053	USD	3,396,030	3,423,792	0.07		GNMA, IO, FPI, Series 2020-805 '01'	USD	19,201,265	1,155,625	0.02	
GNMA 6% 20/06/2053	USD	1,068,343	1,082,418	0.02		2.67% 20/01/2070					
GNMA 6% 20/06/2053	USD	3,183,149	3,221,106	0.07		GNMA, FPI, Series 2005-68 'CP'	USD	38,075	37,823	0.00	
GNMA 6.5% 20/06/2053	USD	1,802,458	1,845,396	0.04		4.04% 11/06/2025					
GNMA 5.5% 20/06/2053	USD	2,621,409	2,634,925	0.05		GNMA, IO, FPI, Series 2008-95 '05'	USD	119,725	3,960	0.00	
GNMA 5.5% 20/06/2053	USD	3,840,036	3,859,826	0.08		2.15% 20/12/2028					
GNMA 5.5% 20/06/2053	USD	12,500,000	12,594,448	0.26		GNMA, IO, FPI, Series 2007-53 '05'	USD	93,390	10,160	0.00	
GNMA 6% 20/06/2053	USD	2,235,169	2,250,645	0.05		1.29% 20/09/2037					
GNMA 6.5% 20/06/2053	USD	2,110,367	2,146,792	0.04		GNMA, FPI, Series 2015-897 '05'	USD	751,645	745,593	0.02	
GNMA, FPI 6.981% 20/03/2072	USD	6,442,336	6,694,487	0.14		5.28% 20/01/2065					
GNMA, FPI 6.72% 20/04/2072	USD	8,389,945	8,621,191	0.18		GNMA, FPI, Series 2016-821 'P'	USD	2,148,977	2,148,975	0.04	
GNMA, FPI 6.76% 20/04/2072	USD	7,766,343	7,990,268	0.16		5.84% 20/10/2066					
GNMA, FPI 6.68% 20/05/2072	USD	6,916,817	7,095,280	0.15		GNMA, FPI, Series 2012-810 'PA'	USD	690,321	686,827	0.01	
GNMA, FPI 6.845% 20/07/2072	USD	8,370,126	8,688,004	0.18		5.64% 20/12/2061					
GNMA, Series 2019-44 'A' 3.5% 20/04/2049	USD	3,219,315	2,995,895	0.06		GNMA, FPI, Series 2012-815 'PA' 5.5% 20/05/2062	USD	26	25	0.00	
GNMA, Series 2009-104 'A8' 7% 16/08/2030	USD	21,594	21,537	0.00		GNMA, FPI, Series 2012-808 'PA' 5.5% 20/03/2060	USD	17,259	16,908	0.00	
GNMA, FPI, Series 2011-899 'AF' 5.99% 20/03/2061	USD	313,891	312,163	0.01		GNMA, FPI, Series 2012-828 'PA'	USD	5,293	5,222	0.00	
GNMA, PO, Series 2006-22 'A0' 0% 20/06/2026	USD	25,412	23,029	0.00		4.913% 20/09/2062					
GNMA, PO, Series 2007-28 'A0' 0% 16/06/2021	USD	347,991	319,963	0.01		GNMA, FPI, Series 2012-829 'PA'	USD	542,860	539,872	0.01	
GNMA, IO, FPI, Series 2008-90 'A5' 0.55% 20/12/2038	USD	54,786	4,198	0.00		5.609% 20/10/2062					
GNMA, IO, FPI, Series 2009-106 'A5' 1.26% 16/11/2039	USD	140,364	9,912	0.00		GNMA, Series 2013-901 'PA' 1.62% 20/01/2063	USD	1,112	989	0.00	
GNMA, FPI, Series 2010-129 'AW' 5.99% 20/04/2037	USD	122,603	123,706	0.00		GNMA, FPI, Series 2013-893 'PA'	USD	572	566	0.00	
						5.29% 20/08/2060					
						GNMA, FPI, Series 2015-896 'PA'	USD	795,418	789,565	0.02	
						5.51% 20/01/2065					
						GNMA, FPI, Series 2015-812 'PA'	USD	2,264,735	2,248,723	0.05	
						5.51% 20/05/2065					

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)	割合(%)						
ONMA, FPN, Series 2015-012 'PB' 5.614% 20/09/2065	USD	1,130,291	1,122,151	0.02		ONMA, FPN, Series 2013-001 'JA' 5.414% 20/01/2063	USD	344,519	340,914	0.01	
ONMA, FPN, Series 2014-017 'PC' 5.594% 20/07/2064	USD	327,369	325,882	0.01		ONMA, FPN 'JE' 5.544% 20/07/2071	USD	5,554,278	5,631,738	0.12	
ONMA, FPN, Series 2015-005 'PC' 5.514% 20/02/2065	USD	1,428,402	1,412,270	0.03		ONMA, IO, FPN, Series 2007-17 'JI' 1.652% 16/04/2037	USD	98,086	7,717	0.00	
ONMA, FPN, Series 2015-008 'PC' 5.514% 20/02/2065	USD	2,684,683	2,666,348	0.06		ONMA, FPN, Series 2006-f 'JM' 5.172% 20/05/2004	USD	352	346	0.00	
ONMA, FPN, Series 2015-010 'PC' 5.514% 20/04/2065	USD	1,471,986	1,466,406	0.03		ONMA, IO, FPN, Series 2005-60 'JN' 1.142% 20/09/2035	USD	168,552	12,224	0.00	
ONMA, FPN, Series 2016-026 'PC' 6.094% 20/12/2066	USD	1,133,711	1,130,470	0.02		ONMA, Series 2008-70 'LG' 5% 20/08/2033	USD	357,030	350,314	0.01	
ONMA, FPN, Series 2012-021 'PD' 5.424% 20/12/2062	USD	688,066	682,068	0.01		ONMA, FPN, Series 2012-026 'ML' 4.879% 20/07/2062	USD	2,941	2,893	0.00	
ONMA, FPN, Series 2016-011 'PD' 4.889% 20/06/2066	USD	980,871	970,655	0.02		ONMA, IO, FPN, Series 2007-73 'MN' 0.842% 20/11/2037	USD	109,293	1,695	0.00	
ONMA, FPN, Series 2010-022 'PE' 5.440% 20/06/2059	USD	37,794	37,440	0.00		ONMA, 'MT' 4.5% 20/04/2053	USD	4,970,549	4,815,659	0.10	
ONMA, FPN, Series 2012-024 'PE' 5.524% 20/04/2060	USD	9,856	9,680	0.00		ONMA, IO, Series 2009-14 'NI' 6.5% 20/02/2039	USD	38,744	4,175	0.00	
ONMA, FPN, Series 2015-026 'PE' 5.614% 20/10/2065	USD	744,789	736,262	0.02		ONMA, FPN, Series 2007-16 'NS' 5.262% 20/04/2037	USD	47,593	49,295	0.00	
ONMA, FPN, Series 2015-032 'PE' 5.754% 20/12/2065	USD	796,405	792,574	0.02		ONMA, IO, Series 2009-79 'OK' 0% 16/11/2037	USD	46,381	39,420	0.00	
ONMA, FPN, Series 2016-021 'PE' 4.939% 20/09/2066	USD	4,462,191	4,432,933	0.09		ONMA, IO, Series 2010-157 'OP' 0% 20/12/2040	USD	93,322	77,806	0.00	
ONMA, FPN, Series 2015-015 'PJ' 5.514% 20/06/2065	USD	994,170	986,304	0.02		ONMA, FPN, Series 2012-138 'PT' 2.936% 16/11/2042	USD	288,554	274,894	0.01	
ONMA, FPN, Series 2020-005 'PK' 4.151% 20/02/2070	USD	4,685,745	4,576,860	0.09		ONMA, FPN, Series 2020-30 'PT' 4.169% 16/01/2048	USD	5,352,566	5,250,048	0.11	
ONMA, FPN, Series 2015-016 'PL' 5.524% 20/07/2065	USD	1,613,616	1,600,299	0.03		ONMA, Series 2006-SI 'PZ' 5.662% 20/10/2026	USD	457,738	453,551	0.01	
ONMA, FPN, Series 2016-007 'PQ' 5.734% 20/02/2066	USD	2,175,634	2,166,469	0.04		ONMA, IO, FPN, Series 2006-65 'SA' 1.642% 20/11/2036	USD	61,782	735	0.00	
ONMA, FPN, Series 2012-008 'PS' 5.734% 20/04/2062	USD	546,681	544,433	0.01		ONMA, IO, FPN, Series 2007-37 'SA' 1.054% 20/05/2037	USD	62,013	2,000	0.00	
ONMA, FPN, Series 2017-014 'PT' 5.594% 20/06/2067	USD	3,159,212	3,133,544	0.06		ONMA, IO, FPN, Series 2007-76 'SA' 1.284% 20/11/2037	USD	53,897	1,332	0.00	
ONMA, IO, FPN, Series 2020-010 'QI' 5% 20/06/2070	USD	23,868,424	985,479	0.02		ONMA, IO, FPN, Series 2008-40 'SA' 1.242% 16/05/2038	USD	49,967	2,501	0.00	
ONMA, Series 2017-112 'Q2' 3% 20/07/2047	USD	2,595,573	2,023,385	0.04		ONMA, IO, FPN, Series 2009-10 'SA' 0.804% 20/02/2039	USD	81,181	3,145	0.00	
ONMA, FPN, Series 2013-007 'HA' 5.504% 20/02/2063	USD	264,633	262,471	0.01		ONMA, IO, FPN, Series 2009-22 'SA' 1.124% 20/04/2039	USD	97,823	4,208	0.00	
ONMA, IO, Series 2020-134 'BI' 2% 20/09/2050	USD	5,688,412	777,058	0.02		ONMA, IO, FPN, Series 2009-6 'SA' 0.942% 16/02/2039	USD	33,104	15	0.00	
ONMA, FPN, Series 2012-026 'JA' 3.941% 20/10/2061	USD	2,808	2,756	0.00		ONMA, IO, FPN, Series 2007-40 'SB' 1.604% 20/07/2037	USD	82,872	3,634	0.00	
						ONMA, IO, FPN, Series 2007-42 'SB' 1.604% 20/07/2037	USD	47,939	5,245	0.00	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
GNMA, 10, FPM, Series 2007-01 '0B' 1.904% 20/12/2037	USD	130,100	16,730	0.00		GNMA, FPM, Series 2012-023 '0A' 5.614% 20/10/2063	USD	194,072	192,043	0.00	
GNMA, 10, FPM, Series 2009-02 '0C' 0.904% 20/06/2039	USD	82,712	7,261	0.00		GNMA, FPM, Series 2012-041 '0C' 3.714% 20/01/2042	USD	436,376	411,523	0.01	
GNMA, 10, FPM, Series 2006-09 '0D' 1.943% 20/10/2036	USD	60,576	5,432	0.00		GNMA, FPM, Series 2015-151 '0X' 4.149% 20/10/2043	USD	704,935	693,379	0.01	
GNMA, 10, FPM, Series 2007-16 '0D' 0.654% 20/11/2037	USD	142,602	9,837	0.00		GNMA, 10, FPM, Series 2017-014 '0I' 1.253% 20/06/2067	USD	5,890,563	224,906	0.00	
GNMA, FPM, Series 2003-07 '0D' 5.266% 10/08/2033	USD	34,414	34,032	0.00		GNMA, FPM, Series 2010-017 '0Q' 5.145% 20/07/2060	USD	2,085	1,674	0.00	
GNMA, 10, FPM, Series 2007-36 '0E' 1.212% 16/06/2037	USD	20,800	755	0.00		GNMA, Series 2008-33 '2' 6.5% 20/07/2036	USD	306,985	313,622	0.01	
GNMA, 10, FPM, Series 2004-00 '0I' 0.954% 20/10/2034	USD	120,837	4,926	0.00		GNMA, Series 2008-75 '2I' 6% 16/09/2033	USD	662,884	661,371	0.01	
GNMA, 10, FPM, Series 2007-07 '0I' 1.253% 20/11/2037	USD	57,041	1,407	0.00		GNMA 4286 6% 20/11/2038	USD	7,872	7,968	0.00	
GNMA, 10, FPM, Series 2007-14 '0L' 1.202% 16/11/2037	USD	96,311	7,851	0.00		GNMA 456388 7.5% 15/03/2028	USD	2,949	2,945	0.00	
GNMA, 10, FPM, Series 2007-40 '0N' 1.534% 20/07/2037	USD	113,163	12,884	0.00		GNMA 465505 7.5% 15/06/2028	USD	5,980	6,033	0.00	
GNMA, 10, FPM, Series 2009-04 '0N' 0.942% 16/07/2039	USD	72,328	3,178	0.00		GNMA 569568 6.5% 15/01/2032	USD	33,050	33,921	0.00	
GNMA, FPM, Series 2009-06 '0P' 3.04% 16/08/2035	USD	31,784	30,264	0.00		GNMA 591882 6.5% 15/07/2032	USD	2,570	2,619	0.00	
GNMA, FPM, Series 2001-52 '0W' 4.715% 10/09/2037	USD	20,016	20,158	0.00		GNMA 607645 6.5% 15/02/2033	USD	2,878	2,729	0.00	
GNMA, 10, FPM, Series 2007-19 '0Y' 1.293% 20/12/2037	USD	72,823	1,827	0.00		GNMA 607728 6% 15/05/2033	USD	952	964	0.00	
GNMA, FPM, Series 2013-001 '0A' 4.634% 10/01/2063	USD	6,578	6,434	0.00		GNMA 611453 7% 15/04/2032	USD	3,132	3,108	0.00	
GNMA, 10, Series 2009-33 '0I' 6% 20/05/2039	USD	26,226	5,987	0.00		GNMA 621970 6% 15/02/2034	USD	2,689	2,722	0.00	
GNMA, 10, FPM, Series 2009-31 '0S' 1.143% 20/01/2039	USD	53,845	531	0.00		GNMA 742051 4.25% 20/07/2040	USD	523,446	501,798	0.01	
GNMA, FPM, Series 2004-04 '0S' 4.244% 10/10/2034	USD	48,642	45,323	0.00		GNMA 742052 4.4% 20/06/2040	USD	274,635	281,550	0.01	
GNMA, 10, FPM, Series 2008-16 '0S' 0.754% 20/09/2038	USD	152,141	3,475	0.00		GNMA 742147 4.25% 20/07/2040	USD	779,551	777,115	0.02	
GNMA, Series 2018-138 '0Z' 3.5% 20/10/2048	USD	1,462,602	1,303,657	0.03		GNMA 742155 4.25% 20/07/2040	USD	675,931	641,973	0.01	
GNMA, FPM, Series 2014-168 '0B' 3.425% 16/06/2047	USD	147,109	146,540	0.00		GNMA 742178 4.25% 20/07/2040	USD	132,311	126,936	0.00	
GNMA, FPM, Series 2015-137 '0' 5.442% 10/10/2040	USD	656,614	663,505	0.01		GNMA 742196 4.4% 20/07/2040	USD	186,883	179,106	0.00	
GNMA, FPM, Series 2011-127 '0A' 5.922% 10/07/2040	USD	1,057,420	1,082,141	0.02		GNMA 742197 4.25% 20/08/2040	USD	1,715,946	1,701,154	0.04	
GNMA, FPM, Series 2011-163 '0A' 5.885% 10/12/2038	USD	253,666	257,772	0.01		GNMA 742203 4.25% 20/08/2040	USD	517,345	518,629	0.01	
						GNMA 742310 4.25% 20/06/2040	USD	346,336	331,328	0.01	
						GNMA 745389 4.25% 20/06/2040	USD	801,209	802,233	0.02	
						GNMA 745410 4.25% 20/08/2040	USD	368,315	350,582	0.01	
						GNMA 746766 6.5% 20/01/2039	USD	47,513	47,474	0.00	
						GNMA 748803 4.4% 20/06/2040	USD	80,931	77,234	0.00	
						GNMA 748951 4.4% 20/06/2040	USD	82,170	78,421	0.00	
						GNMA 748952 4.25% 20/09/2040	USD	675,088	665,204	0.01	
						GNMA 752485 4.25% 20/09/2040	USD	440,065	421,862	0.01	
						GNMA 752521 4.25% 20/09/2040	USD	818,932	812,100	0.02	
						GNMA 752523 4.85% 20/07/2040	USD	67,958	65,829	0.00	
						GNMA 752597 4% 15/10/2040	USD	502,914	492,938	0.01	
						GNMA 752598 4.25% 20/09/2040	USD	108,042	103,315	0.00	
						GNMA 752636 4.25% 20/10/2040	USD	195,370	186,459	0.00	
						GNMA 752667 4.25% 20/09/2040	USD	107,392	102,497	0.00	
						GNMA 752668 4% 15/10/2040	USD	330,723	319,874	0.01	
						GNMA 752721 4.25% 20/09/2040	USD	234,807	224,115	0.00	
						GNMA 757072 4% 15/11/2040	USD	405,497	392,193	0.01	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)	割合(%)						
GNMA 757076 4.25% 20/10/2040	USD	185,523	157,678	0.00		Goldman Sachs Group, Inc. (The), FBN	USD	975,000	778,112	0.02	
GNMA 757125 4.25% 15/09/2040	USD	129,647	125,155	0.00		2.38% 21/07/2032					
GNMA 761328 7% 15/09/2031	USD	40,170	40,767	0.00		Goldman Sachs Group, Inc. (The), FBN	USD	2,300,000	1,999,200	0.04	
GNMA 761614 7% 15/06/2033	USD	2,122	2,234	0.00		4.41% 23/04/2039					
GNMA 761648 6% 15/08/2033	USD	9,213	9,630	0.00		Goodman Trust, Series 2017-1A 'A',	USD	602,417	530,473	0.01	
GNMA 762615 7% 15/06/2035	USD	56,640	57,830	0.00		1444 1.74% 15/10/2032					
GNMA 783123 5.5% 15/04/2033	USD	135,872	138,529	0.00		Goodman Trust, Series 2017-2A 'A',	USD	1,783,431	1,569,102	0.03	
GNMA 783389 6% 20/08/2039	USD	131,084	137,271	0.00		1444 1.26% 15/10/2033					
GNMA 783444 5.5% 20/09/2039	USD	115,247	116,978	0.00		Goodman US Finance Three LLC, BEI,	USD	431,000	390,803	0.01	
GNMA 784045 4.5% 20/07/2045	USD	413,826	403,929	0.01		1444 1.7% 15/02/2028					
GNMA A17628 4% 15/07/2046	USD	2,530,651	2,447,541	0.05		Graphic Packaging International LLC,	USD	2,710,000	2,415,008	0.05	
GNMA A17478 4% 15/09/2046	USD	1,760,700	1,710,605	0.04		1444 1.51% 15/04/2026					
GNMA AX6215 4% 15/04/2047	USD	759,586	733,737	0.02		Gray Oak Pipeline LLC, 1444A 2%	USD	1,355,000	1,343,655	0.03	
GNMA AX6607 4% 15/06/2047	USD	416,212	398,690	0.01		15/09/2023					
GNMA AX8715 4% 15/12/2046	USD	1,516,448	1,464,042	0.03		Gray Oak Pipeline LLC, 1444A 1.6%	USD	3,150,000	2,889,367	0.06	
GNMA BA7567 4.5% 20/05/2048	USD	1,680,036	1,624,281	0.03		15/10/2025					
GNMA BE1604 4.5% 20/09/2048	USD	1,073,970	1,038,081	0.02		GNMFS Mortgage Loan Trust, FBN,	USD	58,243	51,257	0.00	
GNMA BJ1314 5% 20/06/2049	USD	1,066,661	1,071,780	0.02		Series 2004-4 '1AP', 1444A 5.55%					
GNMA BK7198 4.5% 20/03/2049	USD	1,217,627	1,174,677	0.02		25/06/2024					
GNMA BM2163 5% 15/07/2049	USD	3,003,402	3,035,452	0.06		GNMFS Mortgage Loan Trust, FBN,	USD	22,670	20,261	0.00	
GNMA BM2282 4.5% 20/07/2049	USD	557,910	549,234	0.01		Series 2005-021 '1AP', 1444 5.5%					
GNMA BM9691 4.5% 15/07/2049	USD	3,607,554	3,512,413	0.07		25/01/2025					
GNMA BM9692 4.5% 20/07/2049	USD	3,953,327	3,820,360	0.08		GNMFS Mortgage Loan Trust, FBN,	USD	90,765	79,400	0.00	
GNMA BM9701 4.5% 20/08/2049	USD	2,986,238	2,877,287	0.06		Series 2005-022 '1AP', 1444 5.5%					
GNMA BM9713 4.5% 20/09/2049	USD	2,447,210	2,367,305	0.05		25/02/2025					
GNMA BM9734 4% 20/10/2049	USD	2,854,821	2,737,764	0.06		GNMFS Mortgage Loan Trust, FBN,	USD	413,695	22,156	0.00	
GNMA BV9349 5.5% 20/07/2049	USD	2,068,647	2,088,315	0.04		Series 2006-022 '1AC2', 1444 1.00%					
GNMA BQ9248 4.5% 20/08/2049	USD	4,941,262	4,833,394	0.10		25/04/2026					
GNMA BQ8204 4.5% 20/09/2049	USD	3,031,834	2,921,280	0.06		GSX Mortgage Loan Trust, Series	USD	95,982	94,542	0.00	
GNMA BP7143 4.5% 20/09/2049	USD	1,737,196	1,679,811	0.03		2002-7F '1A4' 5.25% 25/06/2033					
GNMA BS7412 4.5% 15/04/2050	USD	2,388,476	2,198,592	0.05		GSX Mortgage Loan Trust, Series	USD	55,614	55,874	0.00	
GNMA BS7592 4.5% 20/03/2050	USD	897,651	869,868	0.02		2004-6P '3A4' 6.5% 25/05/2024					
GNMA BT8093 3.5% 20/04/2050	USD	12,081,169	11,402,630	0.24		GGP Acquisition Partners I LLC, 1444	USD	225,000	214,410	0.00	
GNMA BU7638 2.5% 20/09/2050	USD	5,788,464	5,051,678	0.10		3.48% 15/06/2050					
GNMA BU7669 3% 20/07/2050	USD	5,722,643	5,102,243	0.11		Guardian Life Insurance Co. of America	USD	250,000	206,232	0.00	
Gold Bay Reports LLC, Series 2014-A	USD	5,807	5,752	0.00		(The), 1444 4.8% 24/01/2017					
'A', 1444 1.22% 17/03/2031						Hankensack Meridian Health, Inc.	USD	2,000,000	1,332,329	0.03	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FBN	USD	1,773,000	1,713,371	0.04		2.81% 01/09/2030					
3.27% 29/09/2025						Hartford HealthCare Corp. 3.447%	USD	2,680,000	1,876,704	0.04	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FBN	USD	5,790,000	5,172,387	0.11		01/07/2024					
1.431% 09/01/2027						HEBD Funding Trust, Series 2016-1A	USD	204,202	178,542	0.00	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FBN	USD	1,365,000	1,210,368	0.03		'A1', 1444 1.03% 20/09/2042					
1.948% 21/10/2027						HEBD Funding Trust, Series 2016-4A	USD	976,076	864,712	0.02	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FBN	USD	1,200,000	1,222,200	0.03		'A1', 1444 1.57% 20/09/2047					
7.02% 28/10/2027						Hilton Grand Vacations Trust, Series	USD	257,469	254,148	0.01	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FBN	USD	2,292,000	2,070,772	0.04		2017-1A 'A', 1444 2.68% 29/12/2028					
2.64% 24/02/2028						Hilton Grand Vacations Trust 'B', 1444	USD	1,656,451	1,583,531	0.03	
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FBN	USD	4,090,000	3,841,581	0.08		1.7% 25/02/2022					
3.691% 05/06/2028											

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Hyundai Capital America, 144A 5.0% 25/06/2025	USD	12,200,000	12,174,019	0.25		JB Hunt Transport Services, Inc. 3.85% 15/03/2024	USD	1,200,000	1,177,335	0.02	
Hyundai Capital America, 144A 1.0% 15/10/2025	USD	1,340,000	1,222,338	0.03		JB Hunt Transport Services, Inc. 3.85% 01/01/2026	USD	860,000	829,973	0.02	
Hyundai Capital America, 144A 1.0% 08/01/2026	USD	1,005,000	899,118	0.02		Jersey Central Power & Light Co., 144A 4.0% 15/01/2026	USD	460,000	444,646	0.01	
Hyundai Capital America, 144A 1.0% 15/06/2026	USD	1,005,000	888,789	0.02		Keurig Dr Pepper, Inc. 4.417% 25/05/2025	USD	81,000	79,401	0.00	
Hyundai Capital America, 144A 5.65% 26/06/2026	USD	11,187,000	11,118,068	0.23		Keurig Dr Pepper, Inc. 3.45% 15/06/2027	USD	450,000	434,237	0.01	
Hyundai Capital America, 144A 2% 10/02/2027	USD	605,000	551,632	0.01		Keurig Dr Pepper, Inc. 3.2% 01/05/2030	USD	1,500,000	1,339,661	0.03	
Hyundai Capital America, 144A 2.97% 15/10/2027	USD	1,330,000	1,160,425	0.02		KeyCorp, FHM 4.789% 01/06/2033	USD	400,000	334,748	0.01	
Hyundai Capital America, 144A 1.0% 10/01/2028	USD	1,940,000	1,635,486	0.03		KeySpan Gas East Corp., 144A 2.742% 15/09/2026	USD	440,000	406,989	0.01	
Impac Secured Assets OMN Owner Trust, Series 2002-2 'A1' 5.5% 25/08/2022	USD	22,339	18,643	0.00		KLAC Corp. 3.3% 01/09/2050	USD	1,800,000	744,773	0.02	
Independence Plaza Trust, Series 2018-IMP 'A', 144A 1.763% 10/07/2025	USD	3,660,000	3,416,549	0.07		Kraft Heinz Foods Co. 4.625% 01/10/2039	USD	1,600,000	1,438,035	0.03	
IndyMac IHEX Mortgage Loan Trust, FHM, Series 2004-AET 'A1' 5.93% 25/09/2024	USD	2,070	1,829	0.00		Kraft Heinz Foods Co. 4.375% 01/06/2046	USD	1,158,000	975,543	0.02	
Intel Corp. 5.625% 10/02/2043	USD	2,150,000	2,165,568	0.04		Ladeco Mortgage Trust, Series 2008-2 'A6' 6% 25/09/2028	USD	215,010	76,362	0.00	
Intel Corp. 5.7% 10/02/2053	USD	1,475,000	1,484,633	0.03		Liberty Mutual Group, Inc., 144A 4.969% 01/01/2029	USD	250,000	243,354	0.01	
International Flavors & Fragrances, Inc., 144A 1.822% 15/10/2027	USD	1,995,000	1,680,274	0.03		Liberty Mutual Group, Inc., 144A 3.951% 15/10/2060	USD	1,120,000	889,325	0.02	
International Flavors & Fragrances, Inc., 144A 2.0% 01/11/2030	USD	836,000	661,024	0.01		Liberty Mutual Insurance Co., 144A 8.5% 15/05/2025	USD	400,000	409,157	0.01	
International Flavors & Fragrances, Inc., 144A 3.365% 15/11/2040	USD	1,140,000	792,064	0.02		Marathon Petroleum Corp. 4.7% 01/05/2025	USD	1,209,000	1,184,696	0.02	
ITC Holdings Corp., 144A 4.95% 22/09/2027	USD	2,715,000	2,672,504	0.06		Massachusetts Electric Co., 144A 4.094% 15/08/2046	USD	483,000	363,747	0.01	
ITC Holdings Corp., 144A 2.95% 14/05/2030	USD	910,000	781,035	0.02		MetLife Global Funding II, 144A 2.75% 22/06/2034	USD	1,800,000	972,643	0.02	
J.P. Morgan Mortgage Trust, FHM, Series 2004-A4 'A1' 3.938% 25/09/2024	USD	3,941	3,655	0.00		WSTR Adjustable Rate Mortgages Trust, FHM, Series 2004-15 '2A1' 4.578% 21/04/2034	USD	42,425	40,475	0.00	
J.P. Morgan Mortgage Trust, FHM, Series 2004-A3 'A1' 4.549% 25/07/2024	USD	1,434	1,392	0.00		WSTR Adjustable Rate Mortgages Trust, FHM, Series 2004-15 '3A1' 4.143% 21/11/2034	USD	127,147	120,240	0.00	
J.P. Morgan Mortgage Trust, FHM, Series 2006-A2 'A1' 4.157% 25/08/2024	USD	17,234	17,258	0.00		WSTR Adjustable Rate Mortgages Trust, FHM, Series 2004-1 '4A2' 3.463% 15/04/2034	USD	6,705	5,981	0.00	
J.P. Morgan Mortgage Trust, FHM, Series 2006-A2 '5A2' 4.194% 25/11/2022	USD	31,578	30,538	0.00		WSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-4 '1A1' 5% 25/06/2034	USD	4,130	3,941	0.00	
						WSTR Alternative Loan Trust '1A1' 4.0% 25/09/2032	USD	347	337	0.00	
						WSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-4 '1A1' 5.5% 25/09/2034	USD	42,433	40,465	0.00	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
WSTR Alternative Loan Trust, Series 2005-6 'A1' 5.5% 25/12/2035	USD	14,354	11,406	0.00		Microchip Technology, Inc. 0.93% 01/09/2024	USD	620,000	585,717	0.01	
WSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-6 'A1' 5% 25/01/2034	USD	25,052	23,038	0.00		Microsoft Corp. 3.5% 12/02/2025	USD	1,907,000	1,777,875	0.04	
WSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-4 'A1' 5.5% 25/12/2029	USD	53,043	49,456	0.00		Microsoft Corp. 3.041% 11/03/2062	USD	536,000	386,988	0.01	
WSTR Asset Securitization Trust, Series 2004-4 'M6' 5.2% 25/12/2033	USD	26,323	26,357	0.00		Nid-A-Biotic Interstate Transmission LLC, 144A 4.5% 15/06/2028	USD	410,000	387,403	0.01	
WSTR Performing Loan Trust, FPM, Series 2005-2 'M1F', 144A 5.48% 25/05/2035	USD	376,999	147,962	0.00		Morgan Stanley, FPM 2.188% 28/04/2026	USD	2,000,000	1,877,346	0.04	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A1' 6.5% 25/08/2032	USD	26,694	25,424	0.00		Morgan Stanley, FPM 2.475% 21/01/2028	USD	264,000	238,156	0.01	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Morgan Stanley, FPM 5.133% 01/02/2029	USD	1,710,000	1,684,420	0.04	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Morgan Stanley, FPM 5.164% 20/04/2029	USD	3,860,000	3,802,528	0.08	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Morgan Stanley, FPM 3.971% 22/07/2038	USD	1,000,000	848,693	0.02	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Morgan Stanley, FPM 3.217% 22/04/2042	USD	2,000,000	1,506,447	0.03	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, FPM, Series 2004-3 'A4' 5.65% 25/04/2024	USD	91,429	88,787	0.00	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Mount Sinai Hospital; Group, Inc. 3.981% 01/01/2048	USD	366,000	290,537	0.01	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		MultiCare Health System 2.803% 15/08/2050	USD	1,115,000	672,814	0.01	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Mylan, Inc. 5.4% 29/11/2043	USD	1,265,000	1,051,700	0.02	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Mylan, Inc. 5.2% 15/04/2048	USD	1,500,000	1,160,436	0.02	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		MyMichigan Health 3.409% 01/06/2050	USD	780,000	555,607	0.01	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Nasdaq, Inc. 5.35% 28/06/2028	USD	4,920,000	4,927,767	0.10	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Nasdaq, Inc. 5.55% 15/02/2034	USD	1,095,000	1,096,410	0.02	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Nationwide Children's Hospital, Inc. 4.58% 01/11/2032	USD	451,000	414,767	0.01	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		New York and Presbyterian Hospital (The) 2.806% 01/08/2080	USD	1,330,000	788,958	0.02	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		New York Life Global Funding, 144A 2.5% 14/07/2035	USD	503,000	462,055	0.01	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		New York Life Insurance Co., 144A 4.45% 15/05/2068	USD	1,040,000	860,927	0.02	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		New York State Dormitory Authority 5.6% 15/03/2040	USD	175,000	184,821	0.00	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		NGPL PipeCo LLC, 144A 3.25% 15/07/2031	USD	1,755,000	1,445,197	0.03	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Niagara Mohawk Power Corp., 144A 1.98% 21/06/2030	USD	2,250,000	1,795,874	0.04	
WSTR Seasoned Securitization Trust, FPM, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00		Nauva Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2005-A1 'A1' 5.5% 25/05/2033	USD	221	212	0.00	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Norura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2003-A1 'X2' 25/05/2023	USD	823	800	0.00		Pacific Gas and Electric Co. 3.45% 01/07/2025	USD	1,535,000	1,449,732	0.03	
Norura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2003-A1 'X5' 25/04/2023	USD	1,673	1,653	0.00		Pacific Gas and Electric Co. 6.1% 15/01/2029	USD	6,560,000	6,445,097	0.13	
Norfolk Southern Corp. 5.55% 17/05/2025	USD	4,000	3,993	0.00		Pacific Gas and Electric Co. 6.4% 15/06/2033	USD	2,210,000	2,178,534	0.05	
Norfolk Southern Corp. 4.05% 15/08/2052	USD	1,373,000	1,039,629	0.02		Pacific Life Global Funding II, 144A 1.2% 24/06/2025	USD	1,560,000	1,432,529	0.03	
Northern States Power Co. 5.1% 15/05/2053	USD	1,690,000	1,646,315	0.03		Pacific Life Insurance Co., FOM, 144A 4.3% 24/10/2067	USD	627,000	477,972	0.01	
Northern Trust Corp., FOM 3.37% 08/05/2022	USD	823,000	730,220	0.02		Paramount Global 2.9% 15/01/2027	USD	750,000	675,076	0.01	
Northwestern Mutual Global Funding, 144A 1.1% 01/06/2028	USD	1,685,000	1,438,078	0.03		Paramount Global 4.85% 01/07/2042	USD	150,000	110,764	0.00	
NBG Energy, Inc., 144A 2% 02/12/2025	USD	1,770,000	1,508,042	0.03		PECO Energy Co. 2.8% 15/06/2050	USD	900,000	590,710	0.01	
NBG Energy, Inc., 144A 2.45% 02/12/2027	USD	1,975,000	1,662,819	0.03		Pensylvania Electric Co., 144A 3.2% 15/03/2028	USD	75,000	67,999	0.00	
NBG Energy, Inc., 144A 4.45% 15/06/2029	USD	1,080,000	951,911	0.02		Penske Truck Leasing Co. LP, 144A 5.1% 24/05/2026	USD	11,500,000	11,389,499	0.24	
NRX Energy Spread-Collateralized Notes, Series 2021-FM2 'A', 144A 3.22% 25/05/2026	USD	4,676,934	4,215,148	0.09		Penske Truck Leasing Co. LP, 144A 3.4% 15/11/2026	USD	177,000	163,094	0.00	
NRX Energy Spread-Collateralized Notes 'A', 144A 3.47% 25/11/2026	USD	5,468,234	4,915,120	0.10		Peeco Holdings LLC 7.4% 15/08/2022	USD	174,000	189,379	0.00	
Nucor Corp. 2.97% 15/12/2055	USD	1,470,000	900,838	0.02		Pepperdine University 3.301% 01/12/2059	USD	1,170,000	816,773	0.02	
NYU Langone Hospitals 3.3% 01/07/2055	USD	1,010,000	717,168	0.02		PERE Wildfire Recovery Funding LLC 4.26% 01/06/2028	USD	815,000	773,972	0.02	
Ohio Power Co. 6.0% 01/03/2033	USD	340,000	250,415	0.01		Phillips 66 Co. 3.60% 15/02/2025	USD	700,000	676,556	0.01	
Ohio State University (The) 4.8% 01/06/2111	USD	716,000	651,830	0.01		Phillips 66 Co. 3.5% 01/10/2026	USD	147,000	137,885	0.00	
Ohio State University (The) 4.04% 01/12/2056	USD	325,000	270,068	0.01		Phillips 66 Co. 3.1% 15/12/2029	USD	1,130,000	986,101	0.02	
Oxxo Electric Delivery Co. LLC 5.7% 15/03/2029	USD	150,000	155,889	0.00		Phillips 66 Co. 4.9% 01/10/2046	USD	1,006,000	884,257	0.02	
Oxxo Electric Delivery Co. LLC 3.1% 15/09/2049	USD	1,990,000	1,396,481	0.03		Physicians Realty LP, REIT 2.62% 01/11/2021	USD	1,050,000	816,008	0.02	
Oxxo Electric Delivery Co. LLC 5.1% 01/10/2032	USD	395,000	297,932	0.01		Piedmont Natural Gas Co., Inc. 3.5% 01/09/2029	USD	1,550,000	1,404,603	0.03	
Orangelake Trust 'B', 144A 3.1% 08/11/2030	USD	825,926	811,107	0.02		Plains All American Pipeline LP 3.8% 15/10/2023	USD	2,770,000	2,754,914	0.06	
O' Kelly Automotive, Inc. 3.6% 01/09/2021	USD	556,000	525,649	0.01		PNC Bank NA 2.5% 27/08/2024	USD	1,750,000	1,677,199	0.03	
Otis Worldwide Corp. 2.05% 05/04/2025	USD	2,000,000	1,885,061	0.04		PNC Financial Services Group, Inc. (The), FOM 5.06% 24/01/2024	USD	2,879,000	2,755,125	0.06	
Otis Worldwide Corp. 2.56% 15/02/2030	USD	2,750,000	2,367,931	0.05		Port Authority of New York & New Jersey 5.64% 01/11/2040	USD	285,000	306,374	0.01	
						Port Authority of New York & New Jersey 5.64% 01/11/2040	USD	650,000	698,749	0.01	
						Port Authority of New York & New Jersey 4.45% 01/10/2062	USD	1,330,000	1,206,065	0.03	
						Potomac Electric Power Co. 6.5% 15/11/2027	USD	200,000	222,769	0.00	
						Principal Life Global Funding II, 144A 1.2% 25/09/2025	USD	1,100,000	1,003,744	0.02	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Principal Life Global Funding II, 144A 5.75% 20/09/2028	USD	8,500,000	8,446,071	0.17		Seasoned Loans Structured Transaction, Series 2019-1 'A1' 3.75% 25/09/2028	USD	2,359,131	2,226,460	0.05	
Prologis LP, REIT 2.875% 15/11/2029	USD	830,000	727,937	0.02		Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust, Series 2006-CB 'A2' 2.875% 25/01/2036	USD	27,363	21,886	0.00	
Providence St Joseph Health Obligated Group 2.745% 01/10/2026	USD	280,000	255,908	0.01		Sequoia Mortgage Trust, FNM, Series 10 '1A' 5.945% 20/10/2027	USD	36,369	35,035	0.00	
Prudential Insurance Co. of America (The), 144A 3.25% 01/07/2025	USD	1,350,000	1,399,115	0.03		Sequoia Mortgage Trust, FNM, Series 2013-1 '1A' 5.935% 20/04/2033	USD	48,098	43,839	0.00	
Public Service Co. of Colorado 6.25% 01/08/2028	USD	135,000	148,053	0.00		Sequoia Mortgage Trust, FNM, Series 2014-12 'A3' 5.935% 20/01/2025	USD	37,330	34,614	0.00	
Public Service Co. of Oklahoma 6.025% 15/11/2027	USD	300,000	319,024	0.01		Serra Timshare Receivables Funding LLC, Series 2018-2A 'A', 144A 3.65% 20/09/2025	USD	389,006	385,933	0.01	
Puget Sound Energy, Inc. 5.445% 01/05/2023	USD	1,235,000	1,235,188	0.03		Sigmax Securitization I LLC 5.025% 15/11/2028	USD	2,239,000	2,233,188	0.05	
RMP Trust, Series 2004-22 'A3' 7% 25/10/2021	USD	80,800	80,148	0.00		Sigmax Securitization I LLC 5.125% 15/05/2043	USD	354,000	350,391	0.01	
Realty Income Corp., REIT 4.875% 01/06/2026	USD	1,500,000	1,484,215	0.03		Smithfield Foods, Inc., 144A 5.25% 01/04/2029	USD	1,600,000	1,473,946	0.03	
Regency Centers LP, REIT 2.95% 15/09/2029	USD	1,305,000	1,119,081	0.02		Southern Natural Gas Co. LLC, 144A 4.25% 15/03/2047	USD	407,000	341,592	0.01	
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 1.75% 15/09/2030	USD	3,100,000	2,471,643	0.05		Southwestern Electric Power Co. 2.75% 01/10/2026	USD	500,000	458,180	0.01	
Regents of the University of California Medical Center Pooled 3.70% 15/05/2020	USD	2,540,000	1,685,597	0.04		Southwestern Public Service Co. 4.5% 15/09/2041	USD	250,000	216,415	0.00	
Roper Technologies, Inc. 1.4% 15/09/2027	USD	3,420,000	2,943,802	0.06		Spirit Airlines Pass-Through Trust, Series 2017-3A 'AA' 3.375% 15/09/2021	USD	554,925	478,019	0.01	
Roper Technologies, Inc. 4.2% 15/09/2028	USD	450,000	431,947	0.01		Sprint Capital Corp. 6.875% 15/11/2028	USD	6,743,000	7,139,420	0.15	
SMP Global, Inc. 2.9% 01/03/2022	USD	1,450,000	1,253,248	0.03		Sprint LLC 7.625% 01/03/2026	USD	1,577,000	1,638,711	0.03	
Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 01/03/2025	USD	4,000,000	3,983,316	0.08		Steel Dynamics, Inc. 1.65% 15/10/2027	USD	1,519,000	1,288,554	0.03	
Sabine Pass Liquefaction LLC 5% 15/03/2027	USD	2,000,000	1,966,685	0.04		Stellantis Finance US, Inc., 144A 2.691% 15/09/2021	USD	1,547,000	1,230,201	0.03	
Sabine Pass Liquefaction LLC 4.5% 15/05/2029	USD	1,200,000	1,136,884	0.02		Structured Asset Mortgage Investments II Trust, FNM, Series 2014-425 '1A1' 5.152% 19/10/2024	USD	77,306	72,256	0.00	
Sabra Health Care LP, REIT 3.2% 01/12/2021	USD	1,685,000	1,254,963	0.03		Structured Asset Mortgage Investments II Trust, FNM, Series 2015-425 'A2' 5.236% 19/07/2025	USD	145,663	132,689	0.00	
SCE Recovery Funding LLC 2.51% 15/11/2042	USD	1,140,000	785,895	0.02		Structured Asset Securities Corp., FNM, Series 2002-2A 'A2' 4.75% 26/11/2022	USD	48,907	48,197	0.00	
Schlumberger Holdings Corp., 144A 3.9% 11/05/2028	USD	455,000	428,627	0.01		Structured Asset Securities Corp., Series 2002-4L1 'A3' 3.42% 25/02/2022	USD	24,796	12,758	0.00	
Seasoned Credit Risk Transfer Trust, Series 2018-4 'A1' 1.25% 25/09/2028	USD	5,678,468	5,327,261	0.11							
Seasoned Credit Risk Transfer Trust 'A01' 3.25% 25/11/2021	USD	6,060,726	5,281,736	0.11							
Seasoned Credit Risk Transfer Trust, Series 2018-4 'A1' 1.25% 25/09/2028	USD	7,886,900	6,202,283	0.13							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)						割合(%)	
Structured Asset Securities Corp., Series 2004-035 'ASB' 6.0%	USD	15,321	15,052	0.00		UMBS 5% 01/03/2063	USD	7,960,571	7,817,254	0.16	
25/03/2034						UMBS 5.5% 01/05/2063	USD	9,989,135	10,040,002	0.21	
Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A 4.9%	USD	400,000	360,333	0.01		UMBS 5% 01/06/2063	USD	1,327,076	1,304,013	0.03	
15/06/2044						UMBS 5% 01/06/2063	USD	4,431,910	4,350,735	0.09	
Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A 4.2%	USD	800,000	657,452	0.01		UMBS 5% 01/06/2063	USD	7,110,000	6,961,999	0.14	
15/05/2047						UMBS 5% 01/06/2063	USD	14,200,000	13,895,539	0.29	
Tennessee Valley Authority 0%	USD	1,150,000	1,027,521	0.02		UMBS 5.5% 01/06/2063	USD	3,320,415	3,326,950	0.07	
01/11/2025						UMBS 255849 5.5% 01/09/2035	USD	32,108	32,881	0.00	
Tennessee Valley Authority 0%	USD	800,000	534,944	0.01		UMBS 257055 6.5% 01/12/2027	USD	13,294	13,581	0.00	
15/03/2032						UMBS 257510 7% 01/12/2038	USD	53,201	56,775	0.00	
Tennessee Valley Authority 0%	USD	2,000,000	1,156,662	0.02		UMBS 357639 5.5% 01/11/2034	USD	1,262	1,291	0.00	
15/06/2005						UMBS 590559 6.5% 01/08/2031	USD	3,360	3,496	0.00	
Texas Eastern Transmission LP, 144A 3.5%	USD	90,000	83,309	0.00		UMBS 602589 7% 01/09/2031	USD	11,670	11,633	0.00	
15/01/2028						UMBS 622534 3% 01/09/2031	USD	87,363	77,345	0.00	
Texas Health Resources 2.32%	USD	1,360,000	734,580	0.02		UMBS 622542 5.5% 01/09/2031	USD	85,215	86,155	0.00	
15/11/2050						UMBS 674349 6% 01/05/2033	USD	936	934	0.00	
Texas Health Resources 4.33%	USD	700,000	611,056	0.01		UMBS 689977 8% 01/05/2027	USD	4,901	4,936	0.00	
15/11/2055						UMBS 686533 8% 01/06/2027	USD	2,924	2,949	0.00	
Texas Instruments, Inc. 5.05%	USD	2,280,000	2,252,930	0.05		UMBS 725704 6% 01/08/2034	USD	2,207	2,282	0.00	
18/05/2063						UMBS 745148 5% 01/01/2036	USD	26,322	26,466	0.00	
Time Warner Cable LLC 6.55%	USD	400,000	378,758	0.01		UMBS 745418 5.5% 01/04/2036	USD	34,866	35,731	0.00	
01/05/2037						UMBS 755973 8% 01/11/2028	USD	9,415	9,590	0.00	
Time Warner Cable LLC 6.75%	USD	1,560,000	1,487,155	0.03		UMBS 755994 8% 01/10/2028	USD	1,470	1,476	0.00	
15/06/2039						UMBS 775902 8.5% 01/04/2038	USD	20,270	20,434	0.00	
Truist Financial Corp., FNN 6.04%	USD	1,935,000	1,934,203	0.04		UMBS 788150 6% 01/05/2032	USD	10,715	10,797	0.00	
08/06/2027						UMBS 870770 6.5% 01/07/2036	USD	16,714	17,400	0.00	
Truist Financial Corp., FNN 5.12%	USD	1,450,000	1,366,630	0.03		UMBS 888892 7.5% 01/11/2037	USD	48,176	51,332	0.00	
26/01/2034						UMBS 889519 5.5% 01/12/2035	USD	41,872	42,880	0.00	
UMBS 4% 01/06/2048	USD	3,423,315	3,252,502	0.07		UMBS 889757 5% 01/02/2038	USD	29,948	30,279	0.00	
UMBS 2.5% 01/05/2050	USD	7,907,859	6,749,504	0.14		UMBS 924857 8.5% 01/09/2037	USD	14,718	14,679	0.00	
UMBS 2.5% 01/07/2050	USD	13,920,179	11,804,576	0.24		UMBS 929560 7% 01/06/2038	USD	52,466	55,356	0.00	
UMBS 2.5% 01/10/2051	USD	8,309,135	7,034,619	0.15		UMBS 945870 6.5% 01/08/2037	USD	26,601	27,838	0.00	
UMBS 2.5% 01/10/2051	USD	12,808,792	10,994,183	0.23		UMBS 946338 7% 01/09/2037	USD	45,013	46,354	0.00	
UMBS 3% 01/11/2051	USD	9,229,359	8,141,327	0.17		UMBS 960150 6% 01/11/2037	USD	21,471	21,685	0.00	
UMBS 2.5% 01/12/2051	USD	18,007,325	15,273,376	0.32		UMBS 976871 6.5% 01/08/2036	USD	187,015	189,834	0.00	
UMBS 2.5% 01/01/2052	USD	7,296,648	6,194,943	0.13		UMBS 995149 6.5% 01/10/2038	USD	57,580	59,940	0.00	
UMBS 3% 01/01/2052	USD	6,827,389	6,003,823	0.12		UMBS 995456 6.5% 01/02/2024	USD	1,071	1,066	0.00	
UMBS 2.5% 01/02/2052	USD	19,806,724	16,623,811	0.34		UMBS 995505 8% 01/01/2038	USD	16,373	16,796	0.00	
UMBS 3% 01/04/2052	USD	14,084,399	12,424,624	0.26		UMBS AAD922 6% 01/09/2036	USD	68,955	71,489	0.00	
UMBS 4% 01/05/2052	USD	6,619,260	6,207,273	0.13		UMBS AA1019 6% 01/11/2036	USD	46,875	48,203	0.00	
UMBS 5% 01/07/2052	USD	7,737,584	7,577,336	0.16		UMBS AB9551 3% 01/06/2043	USD	1,528,932	1,377,119	0.03	
UMBS 4% 01/09/2052	USD	11,397,040	10,687,681	0.22		UMBS ACC407 5.5% 01/10/2039	USD	26,489	26,350	0.00	
UMBS 4% 01/10/2052	USD	18,703,314	18,037,133	0.21		UMBS AD0133 5% 01/08/2024	USD	1,966	1,952	0.00	
UMBS 4% 01/12/2052	USD	2,215,116	2,078,630	0.04		UMBS AD0755 7% 01/01/2039	USD	51,257	54,531	0.00	
UMBS 4.5% 01/12/2052	USD	7,380,995	7,122,410	0.15		UMBS AD0755 7% 01/06/2035	USD	2,640,979	2,781,138	0.06	
						UMBS BHM683 4% 01/06/2047	USD	1,174,732	1,118,834	0.02	
						UMBS BHM684 4% 01/06/2047	USD	1,692,880	1,610,242	0.03	
						UMBS BHM685 4% 01/06/2047	USD	1,778,441	1,713,496	0.04	

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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		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(%)	割合(%)						
UMBS BH7663 4% 01/10/2047	USD	3,166,412	3,040,310	0.06		United Airlines Pass-Through Trust 'M' 3.45% 01/04/2039	USD	1,853,606	1,696,686	0.04	
UMBS BK0919 4.5% 01/03/2049	USD	493,662	480,572	0.01							
UMBS BK8753 4.5% 01/06/2049	USD	1,377,241	1,338,889	0.03		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-2 'M' 2.875% 01/04/2030	USD	950,407	847,627	0.02	
UMBS BK9929 4.5% 01/09/2048	USD	3,908,479	3,791,310	0.08		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-1 'M' 1.5% 01/09/2021	USD	3,182,815	2,864,417	0.06	
UMBS BM1213 4% 01/04/2047	USD	3,406,825	3,261,661	0.07		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-1 'M' 4.15% 25/02/2033	USD	1,260,139	1,164,635	0.02	
UMBS BMS254 4% 01/01/2038	USD	2,304,835	2,223,683	0.05		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-2 'M' 2.7% 01/11/2023	USD	2,004,900	1,712,139	0.04	
UMBS BMS566 4% 01/02/2038	USD	2,787,997	2,691,576	0.06		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-1 'B' 3.65% 01/07/2027	USD	1,146,949	1,057,430	0.02	
UMBS BMS430 5% 01/01/2049	USD	2,917,531	2,902,042	0.06		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2018-1 'B' 4.0% 01/09/2027	USD	820,876	776,104	0.02	
UMBS BMS689 5% 01/02/2049	USD	777,430	770,661	0.02		University of Miami 4.063% 01/04/2052	USD	880,000	741,788	0.02	
UMBS BMS169 4.5% 01/04/2049	USD	679,586	660,904	0.01		University of Southern California 3.26% 01/10/2120	USD	1,090,000	668,557	0.01	
UMBS BMS504 5% 01/08/2049	USD	616,755	615,672	0.01		US Treasury STRIP 0% 15/08/2023	USD	11,765,000	11,693,141	0.24	
UMBS BMS950 5% 01/08/2049	USD	746,210	736,337	0.02		US Treasury STRIP 0% 15/02/2024	USD	7,713,000	7,472,744	0.15	
UMBS BMS194 5% 01/09/2049	USD	345,910	349,695	0.01		US Treasury STRIP 0% 15/05/2024	USD	4,150,000	3,968,600	0.08	
UMBS BMS199 5% 01/08/2049	USD	511,061	506,410	0.01		US Treasury STRIP 0% 15/05/2026	USD	1,000,000	879,346	0.02	
UMBS BMS200 5% 01/08/2049	USD	1,679,892	1,663,967	0.03		US Treasury STRIP 0% 15/08/2028	USD	100,000	87,168	0.00	
UMBS BMS201 5% 01/08/2049	USD	2,403,862	2,384,419	0.05		US Treasury STRIP 0% 15/08/2033	USD	1,600,000	1,071,515	0.02	
UMBS BMS202 5% 01/08/2049	USD	1,361,457	1,364,221	0.03		US Treasury STRIP 0% 15/11/2033	USD	3,920,000	2,598,061	0.05	
UMBS BMS203 5% 01/08/2049	USD	1,653,822	1,635,936	0.04		US Treasury STRIP 0% 15/11/2034	USD	3,600,000	2,288,638	0.05	
UMBS BMS594 4% 01/09/2049	USD	2,020,596	1,928,434	0.04		US Treasury STRIP 0% 15/02/2035	USD	1,515,000	953,530	0.02	
UMBS BMS625 3.5% 01/10/2049	USD	5,845,215	5,469,257	0.11		US Treasury STRIP 0% 15/05/2035	USD	2,600,000	1,618,109	0.03	
UMBS BMS678 3.5% 01/10/2049	USD	2,090,132	1,920,316	0.04		US Treasury STRIP 0% 15/11/2043	USD	10,000,000	4,241,997	0.09	
UMBS BMS681 3.5% 01/10/2049	USD	1,342,396	1,143,230	0.02		Utah Acquisition Sub, Inc. 3.95% 15/06/2026	USD	1,215,000	1,154,106	0.02	
UMBS BMS1623 3% 01/08/2050	USD	3,316,406	2,926,620	0.06		Yankee Mortgage Trust, Series 2008-2 'A' 6.75% 15/06/2028	USD	80,819	82,292	0.00	
UMBS CA1254 4% 01/02/2038	USD	879,851	855,475	0.02		Yankee Mortgage Trust, Series 2008-1 '2E' 7% 15/09/2028	USD	9,900	9,879	0.00	
UMBS CA1238 4% 01/02/2038	USD	989,239	944,780	0.02		Verisk Analytics, Inc. 5.75% 01/04/2033	USD	1,980,000	2,058,480	0.04	
UMBS CA5729 3% 01/05/2050	USD	5,853,021	5,169,875	0.11		Verizon Communications, Inc. 1.65% 30/10/2030	USD	585,000	460,783	0.01	
UMBS FMS1219 4% 01/07/2049	USD	799,319	757,580	0.02		Verizon Communications, Inc. 2.35% 15/09/2032	USD	528,000	422,923	0.01	
UMBS FMS1758 3.5% 01/09/2049	USD	2,303,075	2,127,517	0.04		Viatris, Inc. 3.85% 22/06/2040	USD	1,326,000	910,939	0.02	
UMBS MA0406 4.5% 01/05/2030	USD	66,548	65,181	0.00		WFO Trust, Series 2016-30P 'A', 144A 3.805% 30/01/2035	USD	5,294,000	4,868,110	0.10	
UMBS MA0948 5% 01/11/2031	USD	90,621	90,448	0.00		Wolverine Group of America Finance LLC, 144A 1.825% 24/11/2027	USD	945,000	808,807	0.02	
UMBS QA9332 2.5% 01/05/2050	USD	3,931,872	3,350,275	0.07		Walt Disney Co. (Ech) 9.5% 15/01/2028	USD	480,000	497,010	0.01	
UMBS QBL061 3.5% 01/06/2050	USD	711,931	655,287	0.01		Walt Disney Co. (Ech) 7.7% 30/10/2025	USD	170,000	177,363	0.00	
UMBS RA2008 4% 01/01/2050	USD	2,906,218	2,834,284	0.06							
UMBS SDB089 2.5% 01/07/2050	USD	22,349,176	19,008,398	0.39							
United Airlines Pass-Through Trust 'A' 4.0% 11/10/2025	USD	2,432,931	2,390,355	0.05							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2013-1 'A' 4.2% 15/02/2027	USD	3,207,166	3,103,606	0.06							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2014-1 'A' 4% 11/10/2027	USD	546,661	518,380	0.01							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2014-2 'A' 3.75% 09/09/2028	USD	406,413	385,305	0.01							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-2 'A' 3.1% 01/04/2030	USD	2,049,759	1,763,607	0.04							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2018-1 'A' 3.7% 01/09/2031	USD	2,800,082	2,437,143	0.05							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-1 'A' 4.5% 25/02/2033	USD	1,126,560	1,002,638	0.02							

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023年6月30日現在

2023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(%)
アメリカ	87.81
ルクセンブルク	2.84
イギリス	1.80
フランス	1.28
カナダ	1.02
日本	0.88
ケイマン諸島	0.70
オーストラリア	0.66
アイルランド	0.55
スイス	0.41
メキシコ	0.35
オランダ	0.33
フィンランド	0.20
ドイツ	0.16
シンガポール	0.15
スペイン	0.14
国際機関	0.12
イタリア	0.11
ノルウェー	0.10
ニュージーランド	0.09
デンマーク	0.08
英ヴァージン諸島	0.06
パナマ	0.06
スウェーデン	0.04
バミューダ	0.04
イスラエル	0.04
ジャージー	0.04
香港	0.03
チリ	0.02
サウジアラビア	0.02
コロンビア	0.01
投資有価証券合計	100.10
現金およびその他資産／(負債)	(0.10)
合計	100.00

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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(%)
AUD	206,487	USD	136,459	03/07/2023	RBC	907	—
AUD	5,366	USD	3,481	05/07/2023	BNP Paribas	89	—
AUD	12,139	USD	8,045	05/07/2023	Goldman Sachs	31	—
AUD	11,445	USD	7,452	05/07/2023	HSBC	163	—
AUD	2,686,980	USD	1,743,762	05/07/2023	Merrill Lynch	43,802	—
AUD	6,655	USD	4,352	05/07/2023	Standard Chartered	75	—
AUD	2,521,408	USD	1,670,147	03/08/2023	Citibank	8,846	—
AUD	4,801	USD	3,190	03/08/2023	Morgan Stanley	7	—
CHF	308,147	USD	339,622	05/07/2023	BNP Paribas	4,229	—
CHF	1,929	USD	2,140	05/07/2023	Merrill Lynch	12	—
EUR	8,348,185	USD	8,977,244	05/07/2023	Barclays	132,404	—
EUR	325,710	USD	350,111	05/07/2023	BNP Paribas	5,582	—
EUR	764,927	USD	824,727	05/07/2023	Citibank	10,613	—
EUR	1,016,501,219	USD	1,086,859,733	05/07/2023	HSBC	23,212,028	0.48
EUR	2,530,420	USD	2,720,862	05/07/2023	Merrill Lynch	42,487	—
EUR	1,525,138	USD	1,640,224	05/07/2023	Morgan Stanley	25,306	—
EUR	10,667	USD	11,404	05/07/2023	RBC	244	—
EUR	20,187,019	USD	21,741,233	05/07/2023	Standard Chartered	304,033	0.01
EUR	7,647,070	USD	8,246,151	05/07/2023	State Street	104,844	—
EUR	1,048,243,502	USD	1,139,036,064	03/08/2023	HSBC	7,497,037	0.15
EUR	1,652,479	USD	1,803,677	03/08/2023	Merrill Lynch	3,748	—
EUR	4,821	USD	5,235	03/08/2023	RBC	38	—
EUR	132,599	USD	144,935	03/08/2023	Standard Chartered	97	—
EUR	1,583,256	USD	1,726,390	03/08/2023	State Street	5,321	—
GBP	1,187	USD	1,499	03/07/2023	State Street	9	—
GBP	24,204	USD	30,294	05/07/2023	Citibank	453	—
GBP	8,897,642	USD	11,154,368	05/07/2023	HSBC	148,827	—
GBP	3,149	USD	3,895	05/07/2023	Merrill Lynch	106	—
GBP	1,708,288	USD	2,114,788	05/07/2023	Morgan Stanley	55,349	—
GBP	9,581	USD	12,165	05/07/2023	Standard Chartered	6	—
GBP	10,503,225	USD	13,255,579	03/08/2023	HSBC	90,366	—
JPY	678,084,928	USD	4,707,387	03/08/2023	BNP Paribas	10,990	—
SGD	9,705,474	USD	7,172,476	05/07/2023	HSBC	298	—
SGD	9,709,129	USD	7,164,593	03/08/2023	Goldman Sachs	18,942	—
USD	112,534	AUD	163,726	05/07/2023	BNP Paribas	3,612	—
USD	10,176	AUD	15,282	05/07/2023	Merrill Lynch	9	—
USD	3,564	AUD	5,305	05/07/2023	Morgan Stanley	35	—
USD	3,266	AUD	4,809	05/07/2023	RBC	66	—
USD	2,252,668	EUR	2,047,993	05/07/2023	BNP Paribas	16,153	—
USD	386,915	EUR	352,784	05/07/2023	Standard Chartered	1,656	—
USD	26,349	GBP	20,624	05/07/2023	Merrill Lynch	149	—
USD	26,030	GBP	20,425	03/08/2023	State Street	77	—
USD	19,777	JPY	2,747,306	05/07/2023	Citibank	753	—
USD	32,242	JPY	4,500,603	05/07/2023	Merrill Lynch	1,076	—
USD	28,225	JPY	3,916,680	05/07/2023	Morgan Stanley	1,103	—
USD	27,526	JPY	3,630,602	05/07/2023	RBC	1,000	—

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023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(%)
USD	21,275	JPY	3,000,000	05/07/2023	State Street	501	—
USD	41,519	SGD	55,962	05/07/2023	Barclays	168	—
USD	14,312	SGD	19,193	05/07/2023	Goldman Sachs	127	—
USD	15,738	SGD	21,127	05/07/2023	HSBC	124	—
USD	34,693	SGD	46,600	05/07/2023	Merrill Lynch	254	—
USD	14,978	SGD	20,248	05/07/2023	Morgan Stanley	14	—
USD	45,674	SGD	61,606	05/07/2023	State Street	144	—
先渡為替契約未実現利益合計						31,761,310	0.65
AUD	5,196	USD	3,518	05/07/2023	HSBC	(62)	—
AUD	5,644	USD	3,884	05/07/2023	Merrill Lynch	(129)	—
AUD	3,911	USD	2,613	03/08/2023	HSBC	(8)	—
CHF	932	USD	1,047	05/07/2023	Merrill Lynch	(7)	—
CHF	1,110	USD	1,246	03/08/2023	Morgan Stanley	(3)	—
EUR	2,145,468	USD	2,343,866	05/07/2023	Goldman Sachs	(904)	—
EUR	2,276,566	USD	2,494,306	05/07/2023	HSBC	(8,178)	—
EUR	2,821,213	USD	3,092,788	05/07/2023	Morgan Stanley	(11,878)	—
EUR	2,824,519	USD	3,089,846	05/07/2023	RBC	(5,325)	—
EUR	820,378	USD	897,555	05/07/2023	Standard Chartered	(1,660)	—
EUR	2,024,561	USD	2,222,612	03/08/2023	Goldman Sachs	(8,216)	—
EUR	251,102	USD	275,415	03/08/2023	Morgan Stanley	(768)	—
GBP	21,654	USD	27,642	05/07/2023	Citibank	(134)	—
GBP	22,948	USD	29,345	05/07/2023	HSBC	(192)	—
GBP	36,834	USD	46,869	03/08/2023	Morgan Stanley	(65)	—
JPY	3,563,998	USD	25,774	05/07/2023	BNP Paribas	(1,094)	—
JPY	1,460,835	USD	10,305	05/07/2023	Citibank	(189)	—
JPY	1,538,273	USD	10,920	05/07/2023	Goldman Sachs	(268)	—
JPY	685,373,118	USD	4,924,719	05/07/2023	HSBC	(178,652)	—
JPY	2,772,260	USD	19,962	05/07/2023	Merrill Lynch	(765)	—
JPY	1,371,635	USD	9,853	05/07/2023	Morgan Stanley	(355)	—
JPY	1,377,219	USD	9,612	03/08/2023	Goldman Sachs	(29)	—
JPY	1,105,251	USD	7,763	03/08/2023	Morgan Stanley	(72)	—
SGD	21,345	USD	15,974	05/07/2023	BNP Paribas	(199)	—
SGD	44,446	USD	33,079	05/07/2023	Citibank	(231)	—
SGD	20,282	USD	15,097	05/07/2023	Goldman Sachs	(108)	—
SGD	52,846	USD	39,160	05/07/2023	HSBC	(104)	—
SGD	1,576	USD	1,179	05/07/2023	Merrill Lynch	(15)	—
SGD	42,481	USD	31,421	05/07/2023	Morgan Stanley	(26)	—
SGD	19,600	USD	14,547	05/07/2023	Standard Chartered	(62)	—
SGD	23,835	USD	17,647	05/07/2023	State Street	(32)	—
SGD	15,456	USD	11,437	03/08/2023	Barclays	(1)	—
SGD	19,094	USD	14,144	03/08/2023	Goldman Sachs	(17)	—
SGD	1,740	USD	1,288	03/08/2023	State Street	(1)	—
USD	7,027	AUD	10,755	05/07/2023	HSBC	(128)	—
USD	3,682	AUD	5,618	05/07/2023	Merrill Lynch	(55)	—
USD	4,293	AUD	6,523	05/07/2023	Morgan Stanley	(47)	—
USD	7,323	AUD	11,047	03/08/2023	Goldman Sachs	(34)	—

JPMorgan Funds - US Aggregate Bond Fund

投資有価証券明細表(続き)

2023年6月30日現在

先渡し替契約明細表

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(%)
USD	136,580	AUD	206,487	03/08/2023	RBC	(918)	—
USD	824	CHF	744	05/07/2023	Merrill Lynch	(8)	—
USD	1,949	CHF	1,763	05/07/2023	Morgan Stanley	(18)	—
USD	1,329	CHF	1,196	05/07/2023	RBC	(5)	—
USD	144,710	EUR	132,599	03/07/2023	Standard Chartered	(88)	—
USD	11,445,214	EUR	10,664,759	05/07/2023	Barclays	(201,253)	(0.01)
USD	2,657,426	EUR	2,458,438	05/07/2023	BNP Paribas	(27,316)	—
USD	3,583,383	EUR	3,331,925	05/07/2023	Goldman Sachs	(55,250)	—
USD	2,791	EUR	2,612	05/07/2023	RBC	(60)	—
USD	246,666	EUR	231,031	05/07/2023	State Street	(5,633)	—
USD	7,996,526	EUR	7,314,686	03/08/2023	Morgan Stanley	(4,030)	—
USD	5,420,745	EUR	4,990,885	03/08/2023	RBC	(38,115)	—
USD	1,521,485	EUR	1,395,454	03/08/2023	Standard Chartered	(4,815)	—
USD	4,120	GBP	3,321	05/07/2023	Barclays	(99)	—
USD	50,511	GBP	40,379	05/07/2023	Merrill Lynch	(784)	—
USD	148,805	GBP	119,917	05/07/2023	Morgan Stanley	(3,533)	—
USD	63,933	GBP	50,590	03/08/2023	Morgan Stanley	(349)	—
USD	1,500	GBP	1,187	03/08/2023	State Street	(9)	—
USD	23,748	JPY	3,422,045	03/08/2023	RBC	(64)	—
USD	34,948	SGD	47,359	03/08/2023	Barclays	(92)	—
先渡し替契約未実現損失合計						(562,450)	(0.01)
先渡し替契約未実現純利益						31,198,860	0.64

金融先物契約

証券名	契約数	通貨	グローバルエクスポージャー (米ドル)	未実現損益 (米ドル)	純資産に 占める割合(%)
US Ultra Bond, 20/09/2023	295	USD	39,871,094	184,344	0.01
金融先物契約未実現利益合計				184,344	0.01
US 2 Year Note, 29/09/2023	521	USD	105,927,848	(1,370,254)	(0.03)
US 5 Year Note, 29/09/2023	920	USD	98,465,156	(1,532,547)	(0.03)
US 10 Year Note, 20/09/2023	1,183	USD	132,515,148	(1,963,250)	(0.04)
US 10 Year Ultra Bond, 20/09/2023	176	USD	20,791,375	(303,860)	(0.01)
金融先物契約未実現損失合計				(5,169,911)	(0.11)
金融先物契約未実現純損失				(4,985,567)	(0.10)

JPM US Aggregate Bond X (mth) - JPY

直近計算期間におけるTER(総費用率)

2023年6月30日現在

0.10%

(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常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、保管報酬、税金、その他費用が含まれております。

当該貸付利息と実務報酬は計算対象から除いております。日々の純資産に対してかかる年率0.45%の運用報酬は含みません。

(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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(2024年6月3日現在)

種類	金額	単位
資産総額	1,072,354,115	円
負債総額	520,884	円
純資産総額(-)	1,071,833,231	円
発行済口数	866,945,876	口
1口当たり純資産額(/)	1.2363	円

(参考) GIM USコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)

(2024年6月3日現在)

種類	金額	単位
資産総額	3,775,646,275	円
負債総額	56,160,575	円
純資産総額(-)	3,719,485,700	円
発行済口数	2,584,021,975	口
1口当たり純資産額(/)	1.4394	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12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 >

資本金の額（2024年6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、2024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。

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、2024年6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	45	766,832
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	70	4,966,787
総合計	115	5,733,619
親投資信託	41	-

(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JP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34期事業年度（2023年4月1日から2024年3月31日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による監査を受けております。

なお、従来、当社が監査証明を受けているPwCあらた有限責任監査法人は、2023年12月1日に名称を変更し、PwC Japan有限責任監査法人となりました。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第33期 (2023年 3 月31日)	第34期 (2024年 3 月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	17,854,232	16,673,933
前払費用	10,057	10,082
未収入金	1,077	1,603
未収委託者報酬	1,906,906	1,987,338
未収収益	1,148,869	3,061,883
関係会社短期貸付金	100,000	-
その他	280	15,682
流動資産合計	21,021,423	21,750,524
固定資産		
投資その他の資産		
関係会社株式	60,000	60,000
投資有価証券	548,702	681,717
敷金保証金	33,657	37,171
前払年金費用	212,429	228,037
繰延税金資産	877,589	1,039,201
その他	5,500	5,500
投資その他の資産合計	1,737,878	2,051,627
固定資産合計	1,737,878	2,051,627
資産合計	22,759,301	23,802,152

(単位：千円)

	第33期 (2023年3月31日)	第34期 (2024年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	172,530	213,331
未払金	1,496,536	2,978,383
未払手数料	859,337	906,271
その他未払金	637,198	2,072,111
未払費用	159,983	132,370
未払法人税等	331,240	1,292,546
賞与引当金	867,476	1,173,672
役員賞与引当金	53,851	97,026
流動負債合計	3,081,619	5,887,331
固定負債		
長期未払金	234,648	242,772
賞与引当金	729,216	789,791
役員賞与引当金	114,927	140,155
固定負債合計	1,078,793	1,172,719
負債合計	4,160,412	7,060,050
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	15,347,039	13,490,425
利益剰余金合計	15,380,716	13,524,101
株主資本合計	18,598,716	16,742,101
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	173	-
評価・換算差額等合計	173	-
純資産合計	18,598,889	16,742,101
負債・純資産合計	22,759,301	23,802,152

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)	第34期 (自2023年4月1日 至2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	10,324,813	10,499,412
運用受託報酬	7,542,468	10,370,840
業務受託報酬	2,566,610	2,744,580
その他営業収益	240,482	277,179
営業収益合計	20,674,375	23,892,013
営業費用		
支払手数料	5,189,809	5,192,430
広告宣伝費	146,804	102,192
調査費	1,909,927	3,404,975
委託調査費	1,562,850	3,023,575
調査費	333,567	377,411
図書費	13,508	3,988
委託計算費	256,679	269,987
営業雑経費	161,211	133,374
通信費	12,491	6,615
印刷費	109,847	96,034
協会費	38,873	30,724
営業費用合計	7,664,433	9,102,961
一般管理費		
給料	5,188,544	5,707,205
役員報酬及び賞与	321,404	338,638
給料・手当	3,037,732	2,999,251
賞与	1,012,802	1,127,025
賞与引当金繰入額	750,056	1,172,792
役員賞与引当金繰入額	66,548	69,497
福利厚生費	376,603	387,162
交際費	7,936	9,346
寄付金	10,261	456
旅費交通費	96,976	140,310
租税公課	135,661	171,364
不動産関連費用	1,097,659	879,560
退職給付費用	202,450	215,497
退職金	133,286	91,987
消耗器具備品費	19,816	7,934
事務委託費	183,364	221,828
関係会社等配賦経費	2,394,646	2,431,843
減価償却費	294	-
諸経費	79,798	71,029
一般管理費合計	9,927,302	10,335,527
営業利益	3,082,640	4,453,525

(単位：千円)

	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)	第34期 (自2023年4月1日 至2024年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	1 25	250,008
投資有価証券売却益	33	544
受取利息	1 2,269	92
その他営業外収益	29,202	32,909
営業外収益合計	31,530	283,554
営業外費用		
投資有価証券売却損	284,331	178
為替差損	179,805	57,620
その他営業外費用	187	89
営業外費用合計	464,324	57,887
経常利益	2,649,846	4,679,192
税引前当期純利益	2,649,846	4,679,192
法人税、住民税及び事業税	1,015,667	1,697,341
法人税等調整額	37,516	161,534
法人税等合計	978,151	1,535,806
当期純利益	1,671,695	3,143,385

(3) 【株主資本等変動計算書】

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

第34期（自2023年4月1日 至2024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	15,347,039	15,380,716	18,598,716
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	-	5,000,000	5,000,000	5,000,000
当期純利益	-	-	-	-	3,143,385	3,143,385	3,143,385
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	1,856,614	1,856,614	1,856,614
当期末残高	2,218,000	1,000,000	1,000,000	33,676	13,490,425	13,524,101	16,742,101

	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	173	173	18,598,889
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	5,000,000
当期純利益	-	-	3,143,385
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	173	173	173
当期変動額合計	173	173	1,856,787
当期末残高	-	-	16,742,101

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．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。

（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33期 (2023年3月31日)	第34期 (2024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33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)	第34期 (自2023年4月1日 至2024年3月31日)
関係会社からの受取利息	2,269千円	92千円
関係会社からの受取配当金	- 千円	250,000千円

（株主資本等変動計算書関係）

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

第34期（自2023年4月1日 至2024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
2023年6月27日 定時株主総会	普通株式	5,000,000	88,865	2023年3月31日	2023年6月28日

（リース取引関係）

第33期 （自2022年4月1日 至2023年3月31日）		第34期 （自2023年4月1日 至2024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	1,859千円	1年以内	1,651千円
1年超	4,493千円	1年超	2,340千円
合計	6,352千円	合計	3,991千円

（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

第34期（2024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	242,772	242,772	-
負債計	242,772	242,772	-

（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」

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）	681,717

（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

第34期（2024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	-	242,772	-	242,772
負債計	-	242,772	-	242,772

（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	-	-	-

第34期（2024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	16,673,933	-	-	-
未収委託者報酬	1,987,338	-	-	-
未収収益	3,061,883	-	-	-
合計	21,723,155	-	-	-

（有価証券関係）

1．関係会社株式

関係会社株式（第33期の貸借対照表計上額は60,000千円、第34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、記載していません。

2．その他有価証券

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、次表には記載していません。

（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

第34期（2024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 681,717千円）については市場価格のない株式等と認められるため、記載していません。

3．当事業年度中に売却したその他有価証券

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

第34期（自2023年4月1日 至2024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	3,985	544	178

（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33期 (2023年3月31日)	第34期 (2024年3月31日)
	(千円)	(千円)
退職給付債務の期首残高	1,561,511	1,552,554
勤務費用	156,871	152,793
利息費用	7,808	17,854
数理計算上の差異の発生額	786	101,633
退職給付の支払額	172,850	95,278
退職給付債務の期末残高	1,552,554	1,729,556

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第33期 (2023年3月31日)	第34期 (2024年3月31日)
	(千円)	(千円)
年金資産の期首残高	1,780,406	1,813,116
期待運用収益	5,341	9,972
数理計算上の差異の発生額	33,342	151,080
事業主からの拠出額	166,877	168,000
退職給付の支払額	172,850	95,278
年金資産の期末残高	1,813,116	2,046,891

(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33期 (2023年3月31日)	第34期 (2024年3月31日)
	(千円)	(千円)
積立型制度の退職給付債務	1,552,554	1,729,556
年金資産	1,813,116	2,046,891
	260,562	317,334
未認識数理計算上の差異	48,133	89,297
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	212,429	228,037
前払年金費用	212,429	228,037
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	212,429	228,037

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第33期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)	第34期 (自2023年4月1日 至2024年3月31日)
	(千円)	(千円)
勤務費用	156,871	152,793
利息費用	7,808	17,854
期待運用収益	5,341	9,972
数理計算上の差異の費用処理額	15,657	8,283
過去勤務債務の費用処理額	-	-
その他(注1)	5,425	7,313
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)	149,106	159,705

(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33期 (2023年3月31日)	第34期 (2024年3月31日)
債券	29%	31%
現金及び預金等	71%	69%
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33期 (2023年3月31日)	第34期 (2024年3月31日)
主要な数理計算上の計算基礎		
割引率	0.50%	1.15%
長期期待運用収益率	0.30%	0.55%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第33期事業年度53,343千円、第34期事業年度55,792千円であります。

（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33期 (2023年3月31日)	第34期 (2024年3月31日)
繰延税金資産	(千円)	(千円)
賞与引当金	473,755	585,906
未払費用	119,056	110,803
未払事業税	25,819	72,564
長期前払費用	119,205	119,206
減価償却超過額	204,658	220,363
その他	5,772	5,741
繰延税金資産小計	948,268	1,114,582
評価性引当額	5,556	5,556
繰延税金資産合計	942,712	1,109,026
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	65,122	69,825
繰延税金資産又は繰延税金負債（ ）の純額	877,589	1,039,201

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33期 (2023年3月31日)	第34期 (2024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	6.20%	3.89%
外国子会社配当等永久に益金に算入されない項目	-	1.64%
住民税等均等割	0.09%	0.05%
過年度法人税等	0.01%	0.12%
その他	0.00%	0.02%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.90%	32.82%

（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

第34期（自2023年4月1日 至2024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	10,499,412	9,138,462	2,744,580	277,179	22,659,635
成功報酬	-	1,232,378	-	-	1,232,378
合計	10,499,412	10,370,840	2,744,580	277,179	23,892,013

（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

第34期（自2023年4月1日 至2024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	10,499,412	10,370,840	2,744,580	277,179	23,892,013

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
13,679,111	3,389,037	6,823,865	23,892,013

(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	3,364,483	資産運用業

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

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）	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

（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。

第34期（自2023年4月1日 至2024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	240,253 百万米ドル	持株会社	被所有 間接 100%	人件費の立替	-	-	未払金	469,971

(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。

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	投資運用再委託等	運用受託報酬	2,902,015	未収収益	276,530
							調査費	1,900,307	未払金	468,034
最終的な親会社が同一である会社	J.P. Morgan Investment Management Inc.	米国 ニューヨーク	4.5百万 米ドル	投資運用業	なし	投資運用再委託等	業務受託報酬	1,613,740	未収収益	172,783
							調査費	1,030,619	未払金	732,524

(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、業務受託報酬及び調査費に関しては、運用の再委託や業務委託の一般的な手数料率を勘案し、協議の上、再委託契約や業務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33期 （自2022年4月1日 至2023年3月31日）	第34期 （自2023年4月1日 至2024年3月31日）
1株当たり純資産額	330,558.77円	297,558.01円
1株当たり当期純利益	29,711.10円	55,867.51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33期 （自2022年4月1日 至2023年3月31日）	第34期 （自2023年4月1日 至2024年3月31日）
損益計算書上の当期純利益	1,671,695千円	3,143,385千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,671,695千円	3,143,385千円
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】

<訂正前>

(1) 受託会社

名 称 三菱UFJ信託銀行株式会社
資本金の額 324,279百万円(2023年3月末現在)
事業の内容
(略)

(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	三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	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。

<訂正後>

(1) 受託会社

名 称 三菱UFJ信託銀行株式会社
資本金の額 324,279百万円(2024年3月末現在)
事業の内容
(略)

(2) 販売会社

	名 称	資本金の額 (2024年3月末現在)	事業の内容
1	三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	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。

独立監査人の監査報告書

2024年7月26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

PwC Japan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JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）の2023年11月16日から2024年5月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、JPM USコア債券ファンド（為替ヘッジなし、隔月決算型）の2024年5月15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

2024年6月6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

PwC Japan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2023年4月1日から2024年3月31日までの第34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2024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。