

JPM USコア債券ファンド (為替ヘッジなし、年1回決算型)

第5期 運用報告書(全体版)

(決算日:2023年11月15日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「JPM USコア債券ファンド(為替ヘッジなし、年1回決算型)」は、去る11月15日に第5期の決算を行いました。

当ファンドは、米ドル建ての投資適格債券を実質的な主要投資対象とし、インカム収益の確保と信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として運用を行います。当期につきましてもそれに沿った運用を行いました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

当該投資信託の概要と仕組み

商品分類	追加型投信/海外/債券	
信託期間	2019年6月10日から2029年11月15日(休業日の場合は翌営業日)までです。	
運用方針	マザーファンドにおいて、外国投資法人が発行する外国投資証券への投資を通じて、主として米ドル建ての投資適格債券に投資することにより、インカム収益の確保と信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として運用を行います。 インカム収益とは、ファンドが実質的に受領する債券の利息を主とする収益をいいます。	
主要投資 (運用)対象	当ファンド	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)を主要投資対象とします。
	マザーファンド	以下の2ファンドを主要投資対象とします。 ①JPモルガン・ファンズ-USアグリゲート・ボンド・ファンド 米国の国債、米国政府機関が発行または保証する債券、主として米国で経済活動を行っていると判断される企業が発行する社債、モーゲージ・バック証券、アセット・バック証券等の米ドル建ての投資適格債券を主要投資対象とします。 ②GIMジャパン・マネープール・ファンドF(適格機関投資家専用) GIMマネープール・マザーファンド(適格機関投資家専用)を通じ、円建ての公社債を主要投資対象とします。 モーゲージ・バック証券:主に住宅ローン債権を証券化したものです。 アセット・バック証券:クレジットカード債権や自動車ローン等の債権を証券化したものです。
組入制限および 運用方法	当ファンド	マザーファンドを通じて運用を行います。為替ヘッジは行いません。株式への直接投資は行いません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。投資信託の受益権等の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
	マザーファンド	ファンド・オブ・ファンズ方式で運用します。米ドル建ての投資適格債券に投資する米国総合債券ファンドの組入比率を高位に保つとともに、円建ての公社債に投資する「GIMジャパン・マネープール・ファンドF(適格機関投資家専用)」にも必ず投資します。為替ヘッジは行いません。J.P.モルガン・アセット・マネジメント ^(※) のグローバルなネットワークを活用します。株式への直接投資は行いません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。投資信託の受益権等の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
配分方針	年1回の決算時(11月15日(休業日の場合は翌営業日))に基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。	

(注) 当報告書における比率は、表示桁未満四捨五入です。

(注) 「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)」は「USコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)」または「マザーファンド」ということがあります。

(注) 「JPモルガン・ファンズ-USアグリゲート・ボンド・ファンド」は「米国総合債券ファンド」ということがあります。

(※) J.P.モルガン・アセット・マネジメントは、JPモルガン・チェース・アンド・カンパニーおよび世界の関連会社の資産運用ビジネスのブランドです。

<お問い合わせ先>

JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社

ホームページアドレス am.jpmorgan.com/jp

TEL 03-6736-2350 (受付時間は営業日の午前9時~午後5時)

JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社

〒100-6432 東京都千代田区丸の内2丁目7番3号 東京ビルディング

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額	税 込 配 分		期 騰 落 中 率		ブルームバーグ米国総合インデックス (円ベース)		投資信託証券組入比率	純総資産額
		円	円	騰	落	騰	落		
(設定日) 2019年6月10日	10,000	円	円	—	—	10,000	—	—	百万円 38
1期(2019年11月15日)	10,260		0		2.6	10,358	3.6	99.0	478
2期(2020年11月16日)	10,513		0		2.5	10,682	3.1	99.3	1,346
3期(2021年11月15日)	11,289		0		7.4	11,524	7.9	99.2	1,106
4期(2022年11月15日)	11,898		0		5.4	12,194	5.8	99.3	1,067
5期(2023年11月15日)	12,786		0		7.5	13,342	9.4	99.1	1,658

(注) 設定日の欄には、設定時の数値を記載しております。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、各比率は実質比率を記載しております。

(注) 投資信託証券とは投資信託受益証券及び投資証券の総称です(以下同じ)。

(注) ブルームバーグ米国総合インデックス(円ベース)は設定時を10,000として指数化しております。

(注) ブルームバーグ米国総合インデックス(円ベース)は、当ファンドの実質的な主要投資対象であるJPM USアグリゲート・ボンド(Xクラス)(円建て)のベンチマークであり、当ファンドのベンチマークではありません(以下同じ)。

(注) 「Bloomberg[®]」およびブルームバーグ米国総合インデックス(円ベース)は、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited(以下「BISL」)をはじめとする関連会社(以下、総称して「ブルームバーグ」)のサービスマークであり、J.P.モルガン・アセット・マネジメントによる特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはJ.P.モルガン・アセット・マネジメントとは提携しておらず、また、J.P.モルガン・アセット・マネジメントが設定する商品を確認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、J.P.モルガン・アセット・マネジメントが設定する商品に関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません(以下同じ)。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰 落 率		ブルームバーグ米国総合インデックス (円ベース)		投資信託証券組入比率
		騰	落	騰	落	
(期首) 2022年11月15日	11,898	円	円	—	—	99.3
11月末	11,885		△0.1		△0.2	99.6
12月末	11,403		△4.2		△3.5	99.5
2023年1月末	11,462		△3.7		△3.3	99.7
2月末	11,688		△1.8		△1.3	99.4
3月末	11,611		△2.4		△1.7	99.7
4月末	11,838		△0.5		△0.2	99.9
5月末	12,146		2.1		3.1	99.4
6月末	12,600		5.9		6.4	99.6
7月末	12,157		2.2		3.3	99.7
8月末	12,542		5.4		6.7	99.8
9月末	12,497		5.0		6.7	99.8
10月末	12,342		3.7		4.8	99.8
(期末) 2023年11月15日	12,786		7.5		9.4	99.1

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、各比率は実質比率を記載しております。

(注) ブルームバーグ米国総合インデックス(円ベース)は設定時を10,000として指数化しております。

投資環境

◎債券市況

- ◆米国国債市場では、米国10年国債利回りが上昇(債券価格は下落)しました。期の前半では、FRB(米連邦準備制度理事会)の積極的な金融引き締め姿勢が意識されたことなどによる利回り上昇局面と、市場予想を下回る経済指標を背景とした利上げペースの減速観測や金融システム不安などを受けて利回り下落局面の狭間で、一進一退の動きとなりました。期の後半から10月末にかけては、堅調な経済指標やFRB高官らによる追加利上げを示唆する発言などを受けて利上げ観測が再浮上し、金利は上昇基調で推移しました。
- ◆米国社債市場については、期中、金融システム不安から信用スプレッドが拡大する局面もあったものの、堅調な経済指標を背景としたソフトランディングへの期待感から信用スプレッドが縮小し、リターンはプラスとなりました。

* 米国社債市場の動向は、ブルームバーグ米国総合インデックスを使用しています。

◎為替市況

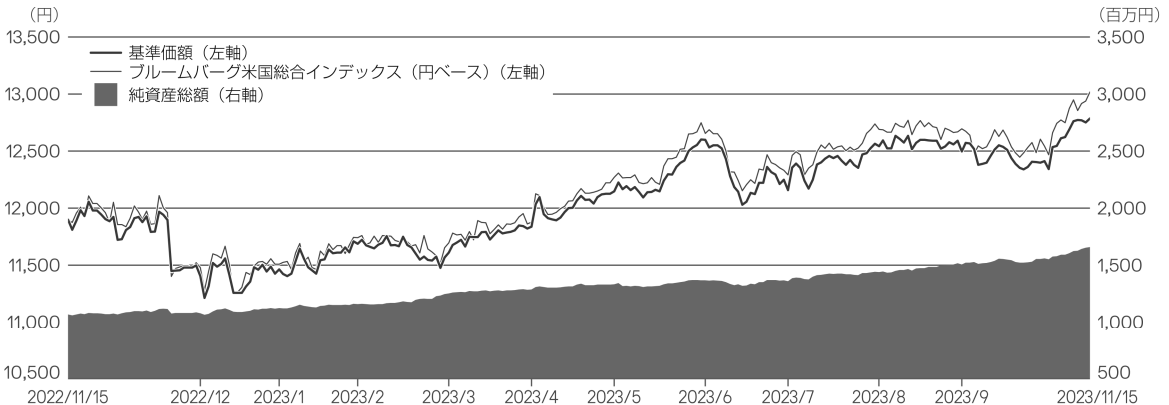
為替市場では、期首は市場予想を下回る米経済指標等を受けて米ドルが全面安となる局面もありましたが、その後は米国での継続的な金利上昇圧力や日米の金融政策の違いが意識されたことなどから、米ドルは対円で上昇しました。

運用経過の説明

◎基準価額等の推移

○当ファンド: 基準価額の騰落率は+7.5%となりました。

○組入ファンド: マザーファンドの基準価額の騰落率は+8.5%となりました。



(注) 基準価額は、信託報酬控除後です。(以下同じ)。

(注) ブルームバーグ米国総合インデックス(円ベース)はグラフの始点の日の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

◎基準価額の主な変動要因

当ファンドは、マザーファンドにおいて投資する米国総合債券ファンドの組み入れを高位に保つ運用を行いました。実質的に米国の国債、米国政府機関が発行または保証する債券、主として米国で経済活動を行っていると判断される企業が発行する社債、住宅ローン担保証券等、資産担保証券等の米ドル建ての投資適格債券を主要投資対象とする投資先の米国総合債券ファンドにおいては、保有債券の価格下落などはマイナスに寄与したものの、米ドルの対円での上昇などがプラスに寄与し、基準価額を押し上げました。

◎ポートフォリオについて

○当ファンド

マザーファンドの受益証券を高位に組み入れました。

○マザーファンド

米国総合債券ファンド(外国投資証券)を高位に組み入れました。また、米国総合債券ファンドにおいては、債券種別で住宅ローン担保証券等への投資比率が上昇した一方、現金への投資比率が減少しました。

◎分配金

基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案し、無分配としました。留保金の運用につきましては、委託会社の判断に基づき元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込)

項 目	第 5 期
	2022年11月16日～ 2023年11月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,785

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 円未満は切捨てです。当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の見通しと運用方針

◎今後の見通し

- ◆米国経済は力強い個人消費や堅調な労働市場などを背景に底堅さを見せていますが、長期的な政策金利の引き上げに加え、足元の米国債の利回り上昇によって金融環境のさらなる引き締めが見られています。また、金融市場ではソフトランディングへの期待感が高まっていますが、金融引き締めの時間差効果を加味すると、米国経済は依然として景気後退に向かうリスクを有していると考えられます。このような環境下、ポートフォリオ全体のデレレション(金利感応度)については小幅な積み増しを行っています。
- ◆セクター配分については、投資適格社債への投資比率を高め維持するとともに、ファンダメンタルズ(基礎的条件)が比較的良好と見られる金融セクターを優先して選好しています。証券化商品に関しては、バリュエーション(価格評価)の観点で魅力的であると考えられる住宅ローン担保証券への投資比率を引き上げています。

◎今後の運用方針

○当ファンド

マザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、配当等収益を確保し、かつ信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として運用を行います。

○マザーファンド

米国総合債券ファンドを主要投資対象とし、配当等収益を確保し、かつ信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として運用を行います。今後も米国総合債券ファンドを通じて、米国の国債、米国政府機関が発行または保証する債券、主として米国で経済活動を行っていると思われる企業が発行する社債、モーゲージ・バック証券、アセット・バック証券等の米ドル建ての投資適格債券を主要投資対象とし、投資を行う方針です。

〇1万口当たりの費用明細

(2022年11月16日～2023年11月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	103	0.858	(a) 信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率
(投 信 会 社)	(20)	(0.165)	投信会社 投資判断、受託会社に対する指図等の運用業務、目論見書、運用報告書等の開示資料作成業務、基準価額の計算業務、およびこれらに付随する業務の対価
(販 売 会 社)	(79)	(0.660)	販売会社 受益者の口座管理業務、換金代金等の支払い業務、交付運用報告書の交付業務、購入後の投資環境等の情報提供業務、およびこれらに付随する業務の対価
(受 託 会 社)	(4)	(0.033)	受託会社 信託財産の記帳・保管・管理業務、委託会社からの指図の執行業務、信託財産の計算業務、およびこれらに付随する業務の対価
(b) そ の 他 費 用	67	0.562	(b) その他費用＝ $\frac{\text{〔期中のその他費用〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}}$
(監 査 費 用)	(3)	(0.022)	監査費用 信託財産の財務諸表の監査業務の対価として監査法人に支払われる費用
(そ の 他)	(65)	(0.539)	その他 信託事務の処理等に要するその他諸費用 当ファンドが組入れているJPM USアグリゲート・ボンド(Xクラス)(円建て)の運用報酬：純資産に対して年率0.45%
合 計	170	1.420	
期中の平均基準価額は、12,014円です。			

(注) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各項目の円未満は四捨五入です。

(注) 比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注) 各項目の費用はマザーファンドが組み入れている投資信託証券(投資信託受益証券及び投資証券)が支払った費用を含んでおらず、上記以外に間接的に負担している主な費用として、マザーファンドが投資している投資信託証券には以下のものがあります。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における費用等については「補足情報」に表示しています。

①JPM USアグリゲート・ボンド(Xクラス)(円建て)(JPM US Aggregate Bond X (mth) - JPY)

事務管理報酬:実費(ただし、純資産に対して年率0.10%を上限とします。)

その他費用:有価証券の売買にかかる費用・税金、外貨建資産の保管費用、臨時で発生する費用、その他の税金等

②GIMジャパン・マネーボール・ファンドF(適格機関投資家専用)

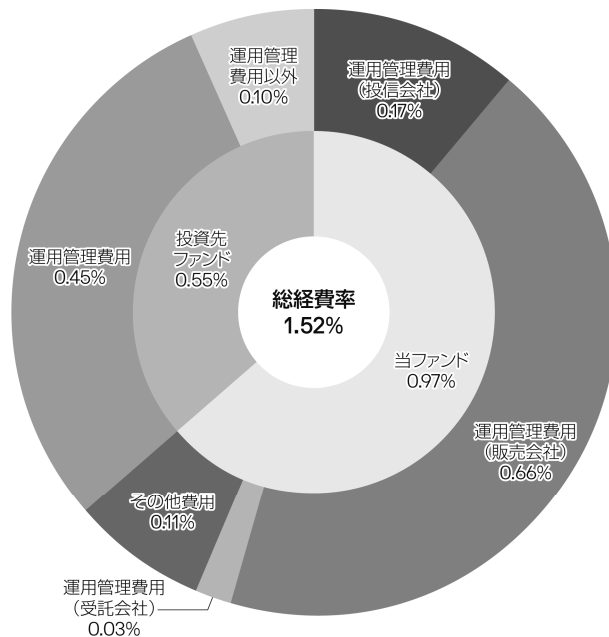
信託報酬:年率0.1045%(税抜0.095%)

監査費用:年率0.022%(税抜0.02%)ただし、年間330万円(税抜300万円)を上限とします。

(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額(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除く。)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総経費率(年率)は1.52%です。



(単位：%)

総経費率 (①+②+③)	1.52
①当ファンドの費用の比率	0.97
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.45
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10

(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 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。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、USコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)において組入れている投資信託証券です。

(注) それぞれの投資先ファンドの費用は以下簡便法により算出した合計値です。

JPM USアグリゲート・ボンド(Xクラス)(円建て)：当ファンドの目録見書に記載した当該投資先ファンドの運用管理費用を上記②とし、当該投資先ファンドの直近の計算期末時点におけるTER(総費用率)を上記③とする簡便法

GIMジャパン・マネーボール・ファンドF(適格機関投資家専用)：当該投資先ファンドの直近の計算期末時点における運用報告書1万口当たりの費用明細において用いた簡便法

(注) GIMジャパン・マネーボール・ファンドF(適格機関投資家専用)の費用は、GIMマネーボール・マザーファンド(適格機関投資家専用)が支払った費用を含みます。

(注) 当ファンドの費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、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。

○売買及び取引の状況

(2022年11月16日～2023年11月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
USコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし) 受益証券	千口 500,026	千円 627,805	千口 123,056	千円 155,878

(注) 単位未満は切捨てです。

○利害関係人との取引状況等

(2022年11月16日～2023年11月15日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

(2022年11月16日～2023年11月15日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年11月16日～2023年11月15日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2023年11月15日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
USコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし) 受益証券	千口 873,810	千口 1,250,781	千円 1,665,415

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨てです。

○投資信託財産の構成

(2023年11月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
USコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし) 受益証券	1,665,415	99.8
コール・ローン等、その他	3,925	0.2
投資信託財産総額	1,669,340	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨てです。なお、「コール・ローン等、その他」については投資信託財産総額から他の資産を差し引いた額を記載しています。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年11月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,669,340,804
USコア債券マザーファンド (為替ヘッジなし)受益証券(評価額)	1,665,415,643
未収入金	3,925,161
(B) 負債	10,887,090
未払解約金	3,925,161
未払信託報酬	6,170,894
その他未払費用	791,035
(C) 純資産総額(A-B)	1,658,453,714
元本	1,297,095,143
次期繰越損益金	361,358,571
(D) 受益権総口数	1,297,095,143口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,786円

<注記事項>

期首元本額	897,224,194円
期中追加設定元本額	518,639,024円
期中一部解約元本額	118,768,075円

当期末における未払信託報酬(消費税相当額を含む)の内訳は以下の通りです。

未払受託者報酬	237,344円
未払委託者報酬	5,933,550円

○損益の状況 (2022年11月16日～2023年11月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	116,732,708
売買益	122,719,044
売買損	△ 5,986,336
(B) 信託報酬等	△ 12,540,993
(C) 当期損益金(A+B)	104,191,715
(D) 前期繰越損益金	82,483,968
(E) 追加信託差損益金	174,682,888
(配当等相当額)	(101,270,539)
(売買損益相当額)	(73,412,349)
(F) 計(C+D+E)	361,358,571
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	361,358,571
追加信託差損益金	174,682,888
(配当等相当額)	(102,408,029)
(売買損益相当額)	(72,274,859)
分標準備積立金	186,675,683

(注) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) 損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(36,875,714円)、費用控除後の有価証券等損益額(67,316,001円)、信託約款に規定する収益調整金(174,682,888円)および分標準備積立金(82,483,968円)より分配対象収益は361,358,571円(10,000口当たり2,785円)ですが、当期に分配した金額はありません。

(注) 当期における信託報酬(消費税相当額を含む)の内訳は以下の通りです。

受託者報酬	427,545円
委託者報酬	10,688,531円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金 (税込み)	0円
------------------	----

課税上の取扱いについて

- 普通分配金に対して、個人の受益者については、配当所得として20.315%(所得税および復興特別所得税15.315%、ならびに地方税5%)の税率で課税されます。なお、外国税額控除の適用となった場合、分配時の税金が前記と異なる場合があります。法人の受益者の場合、前記とは異なります。元本払戻金(特別分配金)は課税されません。

※上記は2023年11月末現在適用されているものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。詳しくは税務専門家(税務署等)にお問い合わせください。

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)

第 5 期 運用報告書

(決算日:2023年11月15日)

(計算期間:2022年11月16日~2023年11月15日)

法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第5期の運用状況をご報告申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	親投資信託
運用方針	外国投資法人が発行する外国投資証券への投資を通じて、主として米ドル建ての投資適格債券に投資することにより、インカム収益の確保と信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として運用を行います。
主要運用対象	以下の2ファンドを主要投資対象とします。 ①JPモルガン・ファンズーUSアグリゲート・ボンド・ファンド 米国の国債、米国政府機関が発行または保証する債券、主として米国で経済活動を行っていると判断される企業が発行する社債、モーゲージ・バック証券、アセット・バック証券等の米ドル建ての投資適格債券を主要投資対象とします。 ②GIMジャパン・マネープール・ファンドF(適格機関投資家専用) GIMマネープール・マザーファンド(適格機関投資家専用)を通じ、円建ての公社債を主要投資対象とします。 上記①の組入比率を高位に保つとともに②にも必ず投資します。
主な組入制限	為替ヘッジは行いません。株式への直接投資は行いません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。投資信託の受益権等の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

(注) 当報告書における比率は、表示桁未満四捨五入です。

(注) 「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)」は「USコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)」または「マザーファンド」ということがあります。

(注) 「JPモルガン・ファンズーUSアグリゲート・ボンド・ファンド」は「米国総合債券ファンド」ということがあります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ブルームバーグ米国総合インデックス(円ベース)		投資信託組入比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率		
(設定日) 2019年6月10日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	百万円 55
1期(2019年11月15日)	10,298	3.0	10,358	3.6	98.8	808
2期(2020年11月16日)	10,648	3.4	10,682	3.1	98.9	2,157
3期(2021年11月15日)	11,535	8.3	11,524	7.9	98.7	1,627
4期(2022年11月15日)	12,275	6.4	12,194	5.8	98.8	1,553
5期(2023年11月15日)	13,315	8.5	13,342	9.4	98.7	2,367

(注) 設定日の欄には、設定時の数値を記載しております。

(注) 投資信託証券とは投資信託受益証券及び投資証券の総称です(以下同じ)。

(注) ブルームバーグ米国総合インデックス(円ベース)は設定時を10,000として指数化しております。

(注) ブルームバーグ米国総合インデックス(円ベース)は、当ファンドの主要投資対象であるJPM USアグリゲート・ボンド(Xクラス)(円建て)のベンチマークであり、当ファンドのベンチマークではありません(以下同じ)。

(注) 「Bloomberg」およびブルームバーグ米国総合インデックス(円ベース)は、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited(以下「BISL」)をはじめとする関連会社(以下、総称して「ブルームバーグ」)のサービスマークであり、J.P.モルガン・アセット・マネジメントによる特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはJ.P.モルガン・アセット・マネジメントとは提携しておらず、また、J.P.モルガン・アセット・マネジメントが設定する商品を確認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、J.P.モルガン・アセット・マネジメントが設定する商品に関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません(以下同じ)。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ブルームバーグ米国総合 インデックス (円ベース)		投 資 信 託 証 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
(期 首) 2022年11月15日	円	%		%	%
	12,275	—	12,194	—	98.8
11月末	12,266	△0.1	12,169	△0.2	99.6
12月末	11,778	△4.0	11,766	△3.5	99.4
2023年1月末	11,849	△3.5	11,794	△3.3	99.5
2月末	12,091	△1.5	12,034	△1.3	99.1
3月末	12,022	△2.1	11,986	△1.7	99.4
4月末	12,265	△0.1	12,174	△0.2	99.5
5月末	12,594	2.6	12,575	3.1	99.4
6月末	13,075	6.5	12,970	6.4	99.5
7月末	12,626	2.9	12,597	3.3	99.5
8月末	13,036	6.2	13,005	6.7	99.6
9月末	12,999	5.9	13,012	6.7	99.5
10月末	12,850	4.7	12,779	4.8	99.4
(期 末) 2023年11月15日	13,315	8.5	13,342	9.4	98.7

(注) 騰落率は期首比です。

(注) ブルームバーグ米国総合インデックス(円ベース)は設定時を10,000として指数化しております。

投資環境

◎債券市況

- ◆米国国債市場では、米国10年国債利回りが上昇(債券価格は下落)しました。期の前半では、FRB(米連邦準備制度理事会)の積極的な金融引き締め姿勢が意識されたことなどによる利回り上昇局面と、市場予想を下回る経済指標を背景とした利上げペースの減速観測や金融システム不安などを受けて利回り下落局面の狭間で、一進一退の動きとなりました。期の後半から10月末にかけては、堅調な経済指標やFRB高官らによる追加利上げを示唆する発言などを受けて利上げ観測が再浮上し、金利は上昇基調で推移しました。
- ◆米国社債市場については、期中、金融システム不安から信用スプレッドが拡大する局面もあったものの、堅調な経済指標を背景としたソフトランディングへの期待感から信用スプレッドが縮小し、リターンはプラスとなりました。

* 米国社債市場の動向は、ブルームバーグ米国総合インデックスを使用しています。

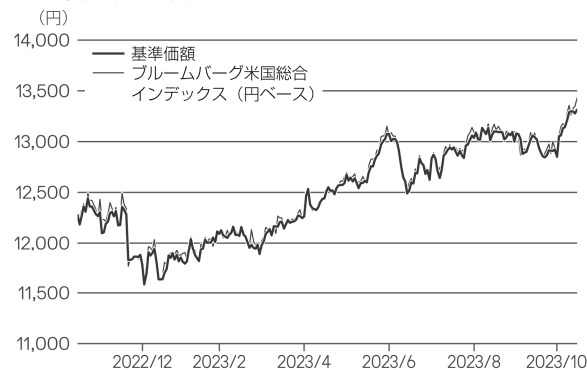
◎為替市況

為替市場では、期首は市場予想を下回る米経済指標等を受けて米ドルが全面安となる局面もありましたが、その後は米国での継続的な金利上昇圧力や日米の金融政策の違いが意識されたことなどから、米ドルは対円で上昇しました。

運用経過の説明

◎基準価額等の推移

基準価額の騰落率は+8.5%となりました。



(注) ブルームバーグ米国総合インデックス(円ベース)はグラフの始点の日の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

◎基準価額の主な変動要因

当ファンドは、米国総合債券ファンドの組み入れを高位に保つ運用を行いました。実質的に米国の国債、米国政府機関が発行または保証する債券、主として米国で経済活動を行っていると判断される企業が発行する社債、住宅ローン担保証券等、資産担保証券等の米ドル建ての投資適格債券を主要投資対象とする投資先の米国総合債券ファンドにおいては、保有債券の価格下落などはマイナスに寄与したものの、米ドルの対円での上昇などがプラスに寄与し、基準価額を押し上げました。

◎ポートフォリオについて

米国総合債券ファンド(外国投資証券)を高位に組み入れました。また、米国総合債券ファンドにおいては、債券種別で住宅ローン担保証券等への投資比率が上昇した一方、現金への投資比率が減少しました。

今後の見通しと運用方針

◎今後の見通し

- ◆米国経済は力強い個人消費や堅調な労働市場などを背景に底堅さを見せていますが、長期的な政策金利の引き上げに加え、足元の米国債の利回り上昇によって金融環境のさらなる引き締めが見られています。また、金融市場ではソフトランディングへの期待感が高まっていますが、金融引き締め の時間差効果を加味すると、米国経済は依然として景気後退に向かうリスクを有していると考えられます。このような環境下、ポートフォリオ全体のデレレション(金利感応度)については小幅な積み増しを行っています。
- ◆セクター配分については、投資適格社債への投資比率を高め維持するとともに、ファンダメンタルズ(基礎的条件)が比較的良好と見られる金融セクターを選択しています。証券化商品に関しては、バリュエーション(価格評価)の観点で魅力的であると考えられる住宅ローン担保証券への投資比率を引き上げています。

◎今後の運用方針

米国総合債券ファンドを主要投資対象とし、配当等収益を確保し、かつ信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として運用を行います。今後も米国総合債券ファンドを通じて、米国の国債、米国政府機関が発行または保証する債券、主として米国で経済活動を行っていると判断される企業が発行する社債、モーゲージ・バック証券、アセット・バック証券等の米ドル建ての投資適格債券を主要投資対象とし、投資を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2022年11月16日～2023年11月15日)

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) そ の 他 費 用	円 56	% 0.450
(そ の 他)	(56)	(0.450)
合 計	56	0.450
期中の平均基準価額は、12,454円です。		

(注) 項目の概要については、前記当ファンドに投資している投資信託の運用報告書「1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

(注) 各項目は簡便法により算出し、円未満は四捨五入です。

(注) 比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2022年11月16日～2023年11月15日)

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外国	JPM US AGGR BOND X (MTH) JPY	口	千円	口	千円
		63,155	713,600	2,777	31,700
合 計		63,155	713,600	2,777	31,700

(注) 金額は受渡し代金です。なお、単位未満は切捨てです。

○利害関係人との取引状況等

(2022年11月16日～2023年11月15日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

(2022年11月16日～2023年11月15日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2023年11月15日現在)

下記は、USコア債券マザーファンド(為替ヘッジなし)全体(1,778,345千口)の内容です。

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
GIMジャパン・マネーブル・ファンドF (適格機関投資家専用)		996,247	996,247	987	0.0
JPM US AGGR BOND X (MTH) JPY		136,706	197,083	2,335,836	98.6
合 計		1,132,953	1,193,330	2,336,824	98.7

(注) 比率欄は純資産総額に対する比率です。

(注) 評価額の単位未満は切捨てです。

○投資信託財産の構成

(2023年11月15日現在)

項 目	当 期 末		
	評 価 額	比 率	
		千円	%
投資信託証券	2,336,824	97.5	
コール・ローン等、その他	60,334	2.5	
投資信託財産総額	2,397,158	100.0	

(注) 評価額の単位未満は切捨てです。なお、「コール・ローン等、その他」については投資信託財産総額から他の資産を差し引いた額を記載しています。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年11月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,397,158,391
コール・ローン等	60,333,665
投資信託証券(評価額)	2,336,824,726
(B) 負債	29,204,659
未払金	24,100,000
未払解約金	3,925,161
その他未払費用	1,179,498
(C) 純資産総額(A-B)	2,367,953,732
元本	1,778,345,829
次期繰越損益金	589,607,903
(D) 受益権総口数	1,778,345,829口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,315円

<注記事項>

期首元本額	1,265,224,732円
期中追加設定元本額	707,060,909円
期中一部解約元本額	193,939,812円

元本の内訳

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
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

○損益の状況 (2022年11月16日～2023年11月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	59,011,507
受取配当金	59,013,763
支払利息	△ 2,256
(B) 有価証券売買損益	120,090,192
売買益	120,095,572
売買損	△ 5,380
(C) その他費用等	△ 8,305,785
(D) 当期損益金(A+B+C)	170,795,914
(E) 前期繰越損益金	287,798,437
(F) 追加信託差損益金	182,705,318
(G) 解約差損益金	△ 51,691,766
(H) 計(D+E+F+G)	589,607,903
次期繰越損益金(H)	589,607,903

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

＜補足情報＞

以下に記載した情報は2023年6月30日におけるJPMorgan Fundsの監査済財務諸表の抜粋です。当ファンドが投資するJPモルガン・ファンズーUSアグリゲート・ボンド・ファンド(Xクラス)は円建てですが、JPモルガン・ファンズーUSアグリゲート・ボンド・ファンドは米ドル建てのため、以下は米ドルでの表記になっています。

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	—
証券発行未収金	14,442,447
投資有価証券売却未収金	1,175,365
TBA証券売却未収金	—
未収配当	—
未収利息	28,854,083
未収還付税額	—
未収報酬免除額	156,689
未買建オプション契約－公正価値	—
金融先物契約未実現利益	184,344
先渡為替契約未実現利益	31,761,310
スワップ契約の公正価値	—
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務	—
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・サービスマネジメント報酬	391,913
未払業績報酬	—
未買建オプション契約－公正価値	—
金融先物契約未実現損失	5,169,911
先渡為替契約未実現損失	562,450
スワップ契約の公正価値	—
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、登録、発行、発送、印刷、法務ならびにマーケティング費用から構成されている。

JPMorgan Funds - US 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	—
証券貸付取引収益	—
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・サービスマネジメント報酬	3,979,725
業績報酬	—
保管、支払代行、事務および所在地代行報酬	839,648
販売報酬	872,742
登録および名義書換代行報酬	350,028
税	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)
当期未実現評価益 (損) 純増減	(71,402,538)
事業活動による純資産増減	(31,187,172)
設定	2,859,000,190
解約	(1,533,474,543)
資本の増減による純資産増減	1,325,525,647
支払配当金	(17,575,231)
期末現在純資産額	4,853,089,988

* 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、登録、発行、発送、印刷、法務ならびにマーケティング費用から構成されている。

JPMorgan Funds – US 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 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 (%)
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					TotalEnergies Capital International SA 3.127% 29/05/2050	USD	2,555,000	1,831,394	0.04
債券								5,183,228	0.11
オーストラリア									
BHP Billiton Finance USA Ltd. 6.42% 01/03/2026	USD	695,000	713,171	0.01	ドイツ				
			713,171	0.01	Deutsche Bank AG 3.7% 30/05/2024	USD	400,000	388,272	0.01
								388,272	0.01
カナダ									
Bank of Montreal 3.7% 07/06/2025	USD	3,000,000	2,892,480	0.06	香港				
Barrick Gold Corp. 6.45% 15/10/2035	USD	709,000	749,178	0.02	AIA Group Ltd., 144A 3.2% 16/09/2040	USD	1,475,000	1,123,913	0.02
Brookfield Finance, Inc. 4.85% 29/03/2029	USD	1,089,000	1,042,156	0.02				1,123,913	0.02
Canadian Pacific Railway Co. 2.9% 01/02/2025	USD	346,000	331,983	0.01	アイルランド				
Canadian Pacific Railway Co. 5.75% 15/03/2033	USD	305,000	312,277	0.01	AerCap Ireland Capital DAC 4.5% 15/09/2023	USD	5,870,000	5,849,922	0.12
Enbridge, Inc. 5.7% 08/03/2033	USD	2,120,000	2,142,686	0.04	AerCap Ireland Capital DAC 2.875% 14/08/2024	USD	1,385,000	1,330,381	0.03
Fortis, Inc. 3.055% 04/10/2026	USD	1,406,000	1,295,346	0.03	AerCap Ireland Capital DAC 1.65% 29/10/2024	USD	210,000	197,288	0.00
Nutrien Ltd. 4.9% 27/03/2028	USD	2,000,000	1,960,603	0.04	AerCap Ireland Capital DAC 6.5% 15/07/2025	USD	743,000	746,546	0.02
Nutrien Ltd. 4.2% 01/04/2029	USD	275,000	259,515	0.00	AerCap Ireland Capital DAC 4.45% 01/10/2025	USD	958,000	919,717	0.02
Nutrien Ltd. 5% 01/04/2049	USD	400,000	358,373	0.01	AerCap Ireland Capital DAC 1.75% 30/01/2026	USD	997,000	893,768	0.02
Suncor Energy, Inc. 7.15% 01/02/2032	USD	150,000	161,261	0.00	AerCap Ireland Capital DAC 4.45% 03/04/2026	USD	735,000	701,911	0.01
Suncor Energy, Inc. 6.8% 15/05/2038	USD	550,000	581,343	0.01	AerCap Ireland Capital DAC 2.45% 29/10/2026	USD	790,000	704,696	0.01
TransCanada PipeLines Ltd. 6.2% 15/10/2037	USD	540,000	557,443	0.01	AerCap Ireland Capital DAC 5.75% 06/06/2028	USD	2,800,000	2,772,038	0.06
TransCanada PipeLines Ltd. 4.75% 15/05/2038	USD	1,150,000	1,022,578	0.02	AerCap Ireland Capital DAC 3% 29/10/2028	USD	975,000	842,621	0.02
			13,667,222	0.28	AerCap Ireland Capital DAC 3.3% 30/01/2032	USD	920,000	748,795	0.02
ケイマン諸島					Bank of Ireland Group plc, FRN, 144A 2.029% 30/09/2027	USD	1,132,000	976,285	0.02
CK Hutchison International 16 Ltd., 144A 2.75% 03/10/2026	USD	1,050,000	969,838	0.02	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23/09/2023	USD	177,000	175,840	0.00
			969,838	0.02	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.2% 23/09/2026	USD	3,120,000	2,927,020	0.06
チリ								19,786,828	0.41
Chile Government Bond 2.55% 27/01/2032	USD	1,272,000	1,085,629	0.02	日本				
			1,085,629	0.02	Mitsubishi HC Capital, Inc., 144A 3.559% 28/02/2024	USD	700,000	687,812	0.01
コロンビア					Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2.048% 17/07/2030	USD	3,120,000	2,525,726	0.05
Ecopetrol SA 5.375% 26/06/2026	USD	464,000	442,957	0.01					
			442,957	0.01					
フランス									
Credit Agricole SA, 144A 4.375% 17/03/2025	USD	2,320,000	2,235,905	0.05					
TotalEnergies Capital International SA 3.461% 12/07/2049	USD	1,450,000	1,115,929	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 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 (%)
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3.751% 18/07/2039	USD	1,280,000	1,076,764	0.02	Mexico Government Bond 2.659% 24/05/2031	USD	2,763,000	2,291,868	0.05
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., FRN 1.538% 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
Mizuho Financial Group, Inc., FRN 1.234% 22/05/2027	USD	2,291,000	2,010,989	0.04	Mexico Government Bond 4.35% 15/01/2047	USD	36,000	28,587	0.00
Mizuho Financial Group, Inc., FRN 5.414% 13/09/2028	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. 2.648% 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. 2.679% 16/07/2030	USD	1,640,000	1,336,877	0.03	Mexico Government Bond 6.338% 04/05/2053	USD	389,000	393,613	0.01
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 144A 4.436% 02/04/2024	USD	1,200,000	1,180,856	0.03	Mexico Government Bond 3.771% 24/05/2061	USD	1,811,000	1,228,108	0.03
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 3.01% 19/10/2026	USD	297,000	274,498	0.01	Mexico Government Bond 5.75% 12/10/2110	USD	566,000	501,481	0.01
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5.52% 13/01/2028	USD	3,105,000	3,120,774	0.06				16,854,997	0.35
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 3.04% 16/07/2029	USD	2,290,000	2,000,742	0.04	オランダ				
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5.71% 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
			22,722,395	0.47	ING Groep NV, FRN 1.726% 01/04/2027	USD	695,000	618,948	0.01
								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 3.4% 19/03/2024	USD	1,000,000	982,440	0.02
DH Europe Finance II SARL 3.25% 15/11/2039	USD	2,600,000	2,110,869	0.04	ANZ New Zealand Int' l Ltd., 144A 2.55% 13/02/2030	USD	3,246,000	2,759,442	0.06
			2,110,869	0.04				3,741,882	0.08
					メキシコ				
America Movil SAB de CV 3.625% 22/04/2029	USD	1,405,000	1,284,369	0.03	パナマ				
America Movil SAB de CV 4.375% 22/04/2049	USD	966,000	835,307	0.02	Panama Government Bond 4.5% 16/04/2050	USD	425,000	327,491	0.01
Coca-Cola Fensa SAB de CV 2.75% 22/01/2030	USD	673,000	592,135	0.01				327,491	0.01
Coca-Cola Fensa SAB de CV 1.85% 01/09/2032	USD	1,500,000	1,165,210	0.02	サウジアラビア				
Grupo Televisa SAB 8.5% 11/03/2032	USD	263,000	309,757	0.01	Saudi Arabian Oil Co., 144A 1.25% 24/11/2023	USD	348,000	341,628	0.01
Grupo Televisa SAB 6.125% 31/01/2046	USD	204,000	200,794	0.00	Saudi Arabian Oil Co., 144A 1.625% 24/11/2025	USD	691,000	631,747	0.01
Mexico City Airport Trust, 144A 5.5% 31/07/2047	USD	210,000	182,843	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% 10/10/2024	USD	790,000	764,815	0.01
					Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4.75% 19/05/2033	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	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 (%)
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 5.3% 19/05/2053	USD	4,270,000	4,405,073	0.09	Lloyds Banking Group plc 4.5% 04/11/2024	USD	2,550,000	2,471,073	0.05
			7,460,586	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% 28/05/2025	USD	3,400,000	3,193,240	0.06	Lloyds Banking Group plc, FRN 1.627% 11/05/2027	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, FRN 5.871% 06/03/2029	USD	5,000,000	4,953,719	0.10
Banco Santander SA 1.849% 25/03/2026	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, FRN 1.722% 14/09/2027	USD	800,000	694,717	0.01	Nationwide Building Society, FRN, 144A 4.363% 01/08/2024	USD	3,300,000	3,293,401	0.07
Telefonica Emisiones SA 4.665% 06/03/2038	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, FRN 4.269% 22/03/2025	USD	640,000	628,749	0.01
スイス					NatWest Group plc, FRN 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	1,489,043	0.03	NatWest Group plc, FRN 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, FRN 3.073% 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, FRN 4.892% 18/05/2029	USD	667,000	634,533	0.01
Credit Suisse AG 1.25% 07/08/2026	USD	713,000	612,886	0.01	NatWest Group plc, FRN 3.754% 01/11/2029	USD	1,500,000	1,408,109	0.03
UBS Group AG, FRN, 144A 2.593% 11/09/2025	USD	2,057,000	1,957,107	0.04	NatWest Group plc, FRN 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, FRN 6.016% 02/03/2034	USD	1,750,000	1,753,484	0.04
			15,003,332	0.31	NatWest Markets plc, 144A 1.6% 29/09/2026	USD	1,420,000	1,245,235	0.03
イギリス					Santander UK Group Holdings plc, FRN 6.833% 21/11/2026	USD	3,771,000	3,778,791	0.08
Barclays plc, FRN 1.007% 10/12/2024	USD	3,467,000	3,385,460	0.07	Santander UK Group Holdings plc, FRN 1.675% 14/06/2027	USD	1,485,000	1,280,134	0.03
Barclays plc, FRN 5.82% 09/05/2027	USD	1,500,000	1,480,049	0.03	Santander UK Group Holdings plc, FRN 6.534% 10/01/2029	USD	4,200,000	4,221,306	0.09
Barclays plc, FRN 2.894% 24/11/2032	USD	1,171,000	915,518	0.02	Standard Chartered plc, FRN, 144A 3.785% 21/05/2025	USD	2,000,000	1,950,031	0.04
Barclays plc, FRN 6.224% 09/05/2034	USD	3,000,000	2,971,442	0.06	Standard Chartered plc, FRN, 144A 2.819% 30/01/2026	USD	1,770,000	1,669,853	0.03
BP Capital Markets plc 3.279% 19/09/2027	USD	461,000	434,059	0.01	Standard Chartered plc, FRN, 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, FRN, 144A 0% 06/07/2027	USD	2,895,000	2,896,371	0.06
HSBC Holdings plc 6.5% 15/09/2037	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, FRN 3.803% 11/03/2025	USD	6,930,000	6,795,561	0.14					
HSBC Holdings plc, FRN 7.39% 03/11/2028	USD	2,460,000	2,595,246	0.05					
HSBC Holdings plc, FRN 2.206% 17/08/2029	USD	1,605,000	1,342,220	0.03					
HSBC Holdings plc, FRN 2.357% 18/08/2031	USD	2,870,000	2,280,257	0.05					
HSBC Holdings plc, FRN 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	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 (%)
Standard Chartered plc, FRN, 144A 4.866% 15/03/2033	USD	700,000	633,657	0.01	American Tower Corp., REIT 3.1% 15/06/2050	USD	1,231,000	795,166	0.02
Vodafone Group plc 5.625% 10/02/2053	USD	345,000	334,218	0.01	American Tower Corp., REIT 2.95% 15/01/2051	USD	804,000	502,961	0.01
			82,323,950	1.70	American Water Capital Corp. 3.45% 01/06/2029	USD	365,000	338,990	0.01
アメリカ					American Water Capital Corp. 6.593% 15/10/2037	USD	125,000	140,420	0.00
AbbVie, Inc. 3.2% 21/11/2029	USD	4,396,000	3,974,294	0.08	American Water Capital Corp. 4% 01/12/2046	USD	375,000	299,412	0.01
AbbVie, Inc. 4.5% 14/05/2035	USD	1,624,000	1,530,256	0.03	American Water Capital Corp. 3.45% 01/05/2050	USD	2,181,000	1,616,768	0.03
AbbVie, Inc. 4.05% 21/11/2039	USD	4,929,000	4,261,498	0.09	Anheuser-Busch Cos. LLC 3.65% 01/02/2026	USD	1,500,000	1,452,067	0.03
AbbVie, Inc. 4.4% 06/11/2042	USD	1,200,000	1,061,643	0.02	Anheuser-Busch Cos. LLC 4.7% 01/02/2036	USD	3,903,000	3,774,400	0.08
AbbVie, Inc. 4.25% 21/11/2049	USD	1,560,000	1,330,477	0.03	Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. 4.625% 01/02/2044	USD	150,000	136,697	0.00
Aetna, Inc. 6.75% 15/12/2037	USD	300,000	328,819	0.01	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4.375% 15/04/2038	USD	1,000,000	922,569	0.02
Aetna, Inc. 4.5% 15/05/2042	USD	147,000	125,006	0.00	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4.6% 15/04/2048	USD	1,314,000	1,205,518	0.02
Air Lease Corp. 3.375% 01/07/2025	USD	3,021,000	2,862,963	0.06	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4.439% 06/10/2048	USD	1,280,000	1,143,664	0.02
Air Lease Corp. 2.875% 15/01/2026	USD	2,500,000	2,311,943	0.05	Arizona Public Service Co. 5.05% 01/09/2041	USD	210,000	190,582	0.00
Air Lease Corp. 3.75% 01/06/2026	USD	958,000	904,821	0.02	Arrow Electronics, Inc. 3.25% 08/09/2024	USD	469,000	452,660	0.01
Air Lease Corp. 1.875% 15/08/2026	USD	3,125,000	2,768,825	0.06	Arrow Electronics, Inc. 3.875% 12/01/2028	USD	761,000	701,777	0.01
Air Lease Corp. 5.85% 15/12/2027	USD	1,120,000	1,115,412	0.02	AT&T, Inc. 2.3% 01/06/2027	USD	5,180,000	4,657,393	0.10
Air Lease Corp. 3.25% 01/10/2029	USD	4,540,000	3,914,044	0.08	AT&T, Inc. 1.65% 01/02/2028	USD	485,000	416,167	0.01
Air Products and Chemicals, Inc. 1.85% 15/05/2027	USD	3,000,000	2,698,132	0.06	AT&T, Inc. 2.25% 01/02/2032	USD	3,220,000	2,546,132	0.05
Alabama Power Co. 5.7% 15/02/2033	USD	150,000	153,276	0.00	AT&T, Inc. 5.4% 15/02/2034	USD	1,840,000	1,833,354	0.04
Alabama Power Co. 6.125% 15/05/2038	USD	179,000	191,357	0.00	AT&T, Inc. 3.5% 01/06/2041	USD	1,382,000	1,051,677	0.02
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.8% 15/04/2026	USD	214,000	204,466	0.00	AT&T, Inc. 3.65% 01/06/2051	USD	3,168,000	2,298,010	0.05
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 3.95% 15/01/2028	USD	1,347,000	1,255,874	0.03	AT&T, Inc. 3.55% 15/09/2055	USD	1,332,000	921,150	0.02
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 4.9% 15/12/2030	USD	2,000,000	1,932,043	0.04	AT&T, Inc. 3.8% 01/12/2057	USD	246,000	175,802	0.00
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 1.875% 01/02/2033	USD	2,690,000	1,961,480	0.04	Atmos Energy Corp. 4.15% 15/01/2043	USD	690,000	592,652	0.01
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 4% 01/02/2050	USD	1,016,000	752,616	0.02	Atmos Energy Corp. 4.125% 15/03/2049	USD	780,000	654,258	0.01
Allstate Corp. (The) 5.35% 01/06/2033	USD	805,000	800,494	0.02	AutoZone, Inc. 1.65% 15/01/2031	USD	1,740,000	1,355,049	0.03
American Tower Corp., REIT 5% 15/02/2024	USD	367,000	364,853	0.01	Bank of America NA 6% 15/10/2036	USD	1,800,000	1,913,087	0.04
American Tower Corp., REIT 3.375% 15/10/2026	USD	437,000	407,497	0.01	Berkshire Hathaway Energy Co. 6.125% 01/04/2036	USD	1,437,000	1,495,432	0.03
American Tower Corp., REIT 1.5% 31/01/2028	USD	2,820,000	2,362,806	0.05	Berkshire Hathaway Finance Corp. 4.3% 15/05/2043	USD	312,000	282,536	0.01
American Tower Corp., REIT 2.1% 15/06/2030	USD	1,440,000	1,161,120	0.02					
American Tower Corp., REIT 1.875% 15/10/2030	USD	2,740,000	2,154,705	0.04					
American Tower Corp., REIT 3.7% 15/10/2049	USD	1,995,000	1,422,054	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	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 (%)
Berkshire Hathaway Finance Corp. 3.85% 15/03/2052	USD	2,640,000	2,154,384	0.04	Cleveland Electric Illuminating Co. (The) 5.95% 15/12/2036	USD	425,000	419,170	0.01
Boardwalk Pipelines LP 3.4% 15/02/2031	USD	1,610,000	1,383,053	0.03	CMS Energy Corp. 3.875% 01/03/2024	USD	1,200,000	1,183,099	0.02
Boston Scientific Corp. 4.55% 01/03/2039	USD	721,000	667,192	0.01	CMS Energy Corp. 3% 15/05/2026	USD	219,000	205,050	0.00
BP Capital Markets America, Inc. 3.017% 16/01/2027	USD	1,500,000	1,410,805	0.03	CMS Energy Corp. 2.95% 15/02/2027	USD	387,000	355,706	0.01
BP Capital Markets America, Inc. 4.893% 11/09/2033	USD	1,565,000	1,542,143	0.03	CNA Financial Corp. 3.95% 15/05/2024	USD	173,000	170,110	0.00
BP Capital Markets America, Inc. 2.772% 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
BP Capital Markets America, Inc. 2.939% 04/06/2051	USD	2,200,000	1,488,995	0.03	Conagra Brands, Inc. 5.3% 01/11/2038	USD	330,000	315,567	0.01
Brimor Operating Partnership LP, REIT 3.85% 01/02/2025	USD	900,000	861,015	0.02	ConocoPhillips Co. 5.3% 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. 5.7% 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	2,762,379	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	542,848	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	290,658	0.01	Constellation Brands, Inc. 5.25% 15/11/2048	USD	260,000	247,117	0.00
Burlington Northern Santa Fe LLC 6.15% 01/05/2037	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	Corning, 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	1,397,000	1,100,842	0.02	Corporate Office Properties LP, REIT 2% 15/01/2029	USD	660,000	503,158	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	2,402,977	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	CVS Health Corp. 4.3% 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	CVS Health Corp. 5.25% 30/01/2031	USD	720,000	714,795	0.01
Caterpillar, Inc. 6.05% 15/08/2036	USD	355,000	389,260	0.01	CVS Health Corp. 5.25% 21/02/2033	USD	2,600,000	2,575,880	0.05
CenterPoint Energy Resources Corp. 5.85% 15/01/2041	USD	250,000	255,634	0.01	CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	USD	4,205,000	3,842,629	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	622,677	0.01
Citigroup, Inc. 3.2% 21/10/2026	USD	1,293,000	1,209,595	0.02	Dell International LLC 6.02% 15/06/2026	USD	3,730,000	3,787,987	0.08
Citigroup, Inc. 6.625% 15/01/2028	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) 5.5% 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. 2.65% 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 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 (%)
Duke Energy Indiana LLC 6.12% 15/10/2035	USD	150,000	156,241	0.00	Energy 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	Energy Louisiana LLC 4% 15/03/2033	USD	330,000	298,663	0.01
Duke Energy Ohio, Inc. 3.7% 15/06/2046	USD	265,000	199,896	0.00	Energy 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	Energy 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	2,093,743	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% 01/03/2035	USD	1,245,000	1,233,927	0.03
DuPont de Nemours, Inc. 5.319% 15/11/2038	USD	2,230,000	2,193,714	0.05	EQM Midstream Partners LP 5.5% 15/07/2028	USD	1,250,000	1,182,011	0.02
Eaton Corp. 7.625% 01/04/2024	USD	400,000	405,113	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	138,317	0.00	Evergny Metro, Inc. 4.2% 15/03/2048	USD	670,000	555,265	0.01
Eaton Corp. 5.8% 15/03/2037	USD	100,000	101,075	0.00	Evergny, Inc. 2.9% 15/09/2029	USD	1,775,000	1,547,774	0.03
Edison International 3.55% 15/11/2024	USD	2,880,000	2,784,163	0.06	Exxon Mobil Corp. 2.995% 16/08/2039	USD	1,615,000	1,273,245	0.03
Edison International 5.25% 15/11/2028	USD	2,225,000	2,163,443	0.04	Exxon Mobil Corp. 3.095% 16/08/2049	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. 4.5% 15/08/2046	USD	2,360,000	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	173,345	0.00	Florida Power & Light Co. 5.3% 01/04/2053	USD	1,540,000	1,582,008	0.03
Eli Lilly & Co. 4.95% 27/02/2063	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 3.9% 15/05/2024	USD	3,997,000	3,930,080	0.08	General Motors Financial Co., Inc. 3.8% 07/04/2025	USD	565,000	544,880	0.01
Energy Transfer LP 4.75% 15/01/2026	USD	1,821,000	1,779,262	0.04	General Motors Financial Co., Inc. 1.25% 08/01/2026	USD	4,269,000	3,808,668	0.08
Energy Transfer LP 3.9% 15/07/2026	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% 15/03/2027	USD	850,000	813,156	0.02	General Motors Financial Co., Inc. 5.8% 23/06/2028	USD	7,850,000	7,796,642	0.16
Energy Transfer LP 4.95% 15/05/2028	USD	430,000	415,739	0.01	General Motors Financial Co., Inc. 2.7% 10/06/2031	USD	2,615,000	2,078,849	0.04
Energy Transfer LP 4.15% 15/09/2029	USD	1,068,000	982,016	0.02	Global Payments, Inc. 4.8% 01/04/2026	USD	1,880,000	1,835,197	0.04
Energy Transfer LP 6.1% 15/02/2042	USD	800,000	752,429	0.02	Global Payments, Inc. 3.2% 15/08/2029	USD	4,145,000	3,600,303	0.07
Energy Transfer LP 6% 15/06/2048	USD	650,000	609,576	0.01	Global Payments, Inc. 5.3% 15/08/2029	USD	710,000	690,950	0.01
Eni USA, Inc. 7.3% 15/11/2027	USD	1,030,000	1,101,477	0.02					
Entergy Corp. 2.95% 01/09/2026	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 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 (%)
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
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 4.25% 21/10/2025	USD	457,000	440,189	0.01	Lennar Corp. 4.5% 30/04/2024	USD	1,220,000	1,209,798	0.02
Goldman Sachs 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	1,246,118	0.03
Gulf Power Co. 3.3% 30/05/2027	USD	670,000	632,159	0.01	Life Storage LP, REIT 2.2% 15/10/2030	USD	2,940,000	2,351,366	0.05
Haleon US Capital LLC 3.375% 24/03/2029	USD	1,970,000	1,788,788	0.04	Lowe's Cos., Inc. 1.7% 15/10/2030	USD	3,000,000	2,394,040	0.05
Halliburton Co. 4.75% 01/08/2043	USD	430,000	374,149	0.01	Lowe's Cos., Inc. 5.75% 01/07/2053	USD	745,000	753,724	0.02
Hanover Insurance Group, Inc. (The) 2.5% 01/09/2030	USD	1,420,000	1,116,960	0.02	LYB International Finance III LLC 1.25% 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 3.625% 01/04/2051	USD	2,705,000	1,855,036	0.04
Hartford Financial Services Group, Inc. (The) 4.3% 15/04/2043	USD	500,000	406,725	0.01	Magellan Midstream Partners LP 3.2% 15/03/2025	USD	171,000	162,648	0.00
HCA, Inc. 5.375% 01/02/2025	USD	1,880,000	1,862,637	0.04	Marathon Oil Corp. 6.8% 15/03/2032	USD	241,000	248,705	0.00
HCA, Inc. 5.25% 15/06/2026	USD	3,300,000	3,259,856	0.07	Markel 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. 3.45% 01/06/2027	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	1,986,069	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. 6.3% 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	1,542,621	0.03
Healthcare Realty Holdings LP, REIT 3.1% 15/02/2030	USD	1,161,000	992,823	0.02	MDC Holdings, Inc. 2.5% 15/01/2031	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	Merck & Co., Inc. 5% 17/05/2053	USD	1,760,000	1,763,183	0.04
Healthpeak OP, LLC, REIT 3.4% 01/02/2025	USD	14,000	13,455	0.00	Merck & Co., Inc. 5.15% 17/05/2063	USD	1,370,000	1,383,217	0.03
Healthpeak OP, LLC, REIT 3.5% 15/07/2029	USD	1,334,000	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	2,365,000	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	1,961,405	0.04	Mid-America Apartments LP, REIT 1.7% 15/02/2031	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 3.875% 29/04/2024	USD	2,697,000	2,657,578	0.05
International Flavors & Fragrances, Inc. 5% 26/09/2048	USD	452,000	379,019	0.01	Morgan Stanley 3.875% 27/01/2026	USD	270,000	260,307	0.01
Jersey Central Power & Light Co. 6.15% 01/06/2037	USD	320,000	330,063	0.01	Morgan Stanley 3.625% 20/01/2027	USD	681,000	646,109	0.01
Kellogg Co. 5.25% 01/03/2033	USD	2,219,000	2,223,293	0.05	Morgan Stanley 4.3% 27/01/2045	USD	1,125,000	971,392	0.02
Kinder Morgan Energy Partners LP 4.3% 01/05/2024	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% 01/05/2030	USD	3,500,000	2,887,109	0.06	MPLX LP 4.875% 01/12/2024	USD	1,284,000	1,265,740	0.03
Kroger Co. (The) 5.4% 15/07/2040	USD	114,000	109,357	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
					NN REIT, Inc., REIT 4% 15/11/2025	USD	583,000	554,039	0.01
					NN 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 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 (%)
Occidental Petroleum Corp. 3% 15/02/2027	USD	2,000,000	1,800,826	0.04	Realty Income Corp., REIT 3.875% 15/04/2025	USD	255,000	247,429	0.00
Ohio Edison Co. 6.875% 15/07/2036	USD	350,000	384,896	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% 15/01/2031	USD	1,480,000	1,291,433	0.03
ONEOK Partners LP 6.65% 01/10/2036	USD	910,000	932,653	0.02	Reliance Steel & Aluminum Co. 2.15% 15/08/2030	USD	3,330,000	2,708,327	0.06
ONEOK, Inc. 2.2% 15/09/2025	USD	2,750,000	2,544,686	0.05	Republic Services, Inc. 5% 01/04/2034	USD	980,000	973,085	0.02
Oracle Corp. 4.9% 06/02/2033	USD	2,450,000	2,364,023	0.05	Resolution Funding Corp Discount Notes Zero Cpn 0% 15/04/2030	USD	200,000	148,461	0.00
Oracle Corp. 3.6% 01/04/2040	USD	1,800,000	1,383,105	0.03	Resolution Funding Corp. 0% 15/01/2030	USD	4,000,000	3,008,825	0.06
Oracle Corp. 4% 15/07/2046	USD	1,070,000	813,105	0.02	Safehold GL Holdings LLC, REIT 2.8% 15/06/2031	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% 15/05/2055	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% 15/11/2023	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% 01/03/2026	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 3.25% 13/09/2049	USD	1,518,000	1,012,687	0.02
Pacific Gas and Electric Co. 4.3% 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. 3.65% 01/03/2028	USD	800,000	746,580	0.02
Pacific Gas and Electric Co. 6.75% 15/01/2053	USD	1,000,000	977,304	0.02	Southern California Edison Co. 6% 15/01/2034	USD	150,000	154,980	0.00
PacifiCorp 4.15% 15/02/2050	USD	1,600,000	1,225,965	0.03	Southern California Edison Co. 5.55% 15/01/2036	USD	530,000	524,838	0.01
PacifiCorp 5.5% 15/05/2054	USD	98,000	90,998	0.00	Southern California Edison Co. 4.05% 15/03/2042	USD	900,000	722,980	0.01
Packaging Corp. of America 4.05% 15/12/2049	USD	1,565,000	1,238,054	0.03	Southern California Edison Co. 5.875% 01/12/2053	USD	2,797,000	2,823,027	0.06
Parker-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. 1.9% 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. 5.25% 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% 15/06/2035	USD	250,000	227,982	0.00	Southern Natural Gas Co. LLC 8% 01/03/2032	USD	624,000	715,664	0.01
Precision Castparts Corp. 4.375% 15/06/2045	USD	250,000	222,073	0.00					
Progress Energy, Inc. 7% 30/10/2031	USD	300,000	327,969	0.01					
Prologis LP, REIT 2.125% 15/10/2050	USD	525,000	292,292	0.01					
Public Storage, REIT 1.95% 09/11/2028	USD	1,264,000	1,084,527	0.02					
Public Storage, REIT 2.25% 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	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 (%)
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	520,165	0.01	US Treasury 1.75% 31/12/2026	USD	18,861,000	17,265,551	0.36
Tennessee Valley Authority 5.88% 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% 15/09/2060	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% 15/09/2065	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	13,212,596	0.27
T-Mobile USA, Inc. 3.75% 15/04/2027	USD	2,000,000	1,888,944	0.04	US Treasury 2.25% 15/11/2027	USD	40,000,000	36,815,625	0.76
T-Mobile USA, Inc. 3.875% 15/04/2030	USD	8,485,000	7,807,954	0.16	US Treasury 3.875% 30/11/2027	USD	15,000,000	14,777,051	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
Truist Financial Corp. 4% 01/05/2025	USD	408,000	394,115	0.01	US Treasury 1.25% 31/03/2028	USD	20,065,000	17,542,375	0.36
UDR, Inc., REIT 2.95% 01/09/2026	USD	276,000	252,490	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	1,261,335	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. 7.75% 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. 2.95% 15/06/2027	USD	715,000	665,419	0.01	US Treasury 2.625% 31/07/2029	USD	12,035,000	11,101,817	0.23
Union Pacific Corp. 3.95% 15/08/2059	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	2,109,974	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% 15/02/2053	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% 15/04/2053	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 1.375% 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	9,432,617	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	592,054	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	7,106,336	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	6,714,805	0.14
					US Treasury 1.875% 15/02/2041	USD	33,400,000	24,089,098	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% 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	101,765,000	83,057,731	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	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(%)
US Treasury 3.625% 15/08/2043	USD	22,000,000	20,499,531	0.42	Virginia Electric and Power Co. 6% 15/05/2037	USD	200,000	208,038	0.00
US Treasury 3.625% 15/02/2044	USD	9,348,000	8,689,623	0.18	Virginia Electric and Power Co. 3.8% 15/09/2047	USD	700,000	545,522	0.01
US Treasury 3% 15/11/2044	USD	634,000	531,916	0.01	VMware, Inc. 1.8% 15/08/2028	USD	1,512,000	1,265,576	0.03
US Treasury 2.875% 15/08/2045	USD	495,000	404,914	0.01	Wells Fargo & Co. 5.375% 02/11/2043	USD	284,000	266,276	0.01
US Treasury 2.25% 15/08/2046	USD	2,450,000	1,773,092	0.04	Wells Fargo & Co. 5.606% 15/01/2044	USD	2,640,000	2,519,229	0.05
US Treasury 3% 15/02/2047	USD	488,000	407,270	0.01	Wells Fargo & Co. 4.9% 17/11/2045	USD	359,000	313,132	0.01
US Treasury 3% 15/02/2048	USD	1,330,000	1,111,641	0.02	Welltower OP LLC, REIT 2.7% 15/02/2027	USD	2,462,000	2,228,326	0.05
US Treasury 2.875% 15/05/2049	USD	22,296,000	18,257,463	0.38	Welltower OP LLC, REIT 4.95% 01/09/2048	USD	1,372,000	1,216,494	0.02
US Treasury 2.25% 15/08/2049	USD	1,880,000	1,352,645	0.03	Williams Cos., Inc. (The) 2.6% 15/03/2031	USD	1,140,000	939,689	0.02
US Treasury 2.375% 15/11/2049	USD	19,005,000	14,052,564	0.29	WP Carey, Inc., REIT 4.25% 01/10/2026	USD	4,400,000	4,226,677	0.09
US Treasury 2% 15/02/2050	USD	12,454,000	8,450,963	0.17	WP Carey, Inc., REIT 2.4% 01/02/2031	USD	1,975,000	1,585,126	0.03
US Treasury 1.25% 15/05/2050	USD	12,378,000	6,883,812	0.14	WP Carey, Inc., REIT 2.25% 01/04/2033	USD	3,000,000	2,243,012	0.05
US Treasury 1.375% 15/08/2050	USD	2,615,000	1,503,319	0.03	WRKCo, Inc. 3.9% 01/06/2028	USD	315,000	293,274	0.01
US Treasury 1.625% 15/11/2050	USD	14,815,000	9,104,859	0.19	Xylem, Inc. 3.25% 01/11/2026	USD	166,000	155,987	0.00
US Treasury 1.875% 15/02/2051	USD	30,489,000	19,984,587	0.41	Zoetis, Inc. 2% 15/05/2030	USD	1,630,000	1,357,216	0.03
US Treasury 2.375% 15/05/2051	USD	8,990,000	6,620,643	0.14				1,848,912,703	38.10
US Treasury 2% 15/08/2051	USD	9,200,000	6,208,203	0.13	英ヴァージン諸島				
US Treasury 1.875% 15/11/2051	USD	16,095,000	10,514,562	0.22	China Southern Power Grid				
US Treasury 2.25% 15/02/2052	USD	51,870,000	37,122,508	0.76	International Finance BVI Co. Ltd., 144A 3.5% 08/05/2027	USD	1,751,000	1,671,474	0.04
US Treasury 2.875% 15/05/2052	USD	4,445,000	3,649,849	0.08	TSMC Global Ltd., 144A 4.625% 22/07/2032	USD	1,129,000	1,118,342	0.02
US Treasury 3% 15/08/2052	USD	24,055,000	20,263,988	0.42				2,789,816	0.06
US Treasury 4% 15/11/2052	USD	20,000,000	20,359,375	0.42	債券合計			2,054,908,817	42.34
US Treasury 3.625% 15/02/2053	USD	10,000,000	9,509,375	0.20	証券取引所に上場を承認されている譲渡性 有価証券および短期金融市場商品合計			2,054,908,817	42.34
US Treasury Inflation Indexed, FRN 1.75% 15/01/2028	USD	1,500,000	2,142,533	0.04	その他の規制市場で取引される譲渡性有価証券および短期金融市場商品 債券				
US Treasury Inflation Indexed, FRN 2.5% 15/01/2029	USD	1,000,000	1,451,801	0.03	オーストラリア				
US Treasury STRIP 0% 15/11/2023	USD	3,287,000	3,230,378	0.07	APA Infrastructure Ltd., 144A 4.25% 15/07/2027	USD	895,000	852,759	0.02
Valero Energy Corp. 2.15% 15/09/2027	USD	1,277,000	1,131,006	0.02	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 144A 4.4% 19/05/2026	USD	2,130,000	2,022,726	0.04
Valero Energy Corp. 7.5% 15/04/2032	USD	251,000	282,280	0.01	Commonwealth Bank of Australia, 144A 3.305% 11/03/2041	USD	765,000	530,511	0.01
Ventas Realty LP, REIT 3.75% 01/05/2024	USD	300,000	294,003	0.01	GAF Bond Issuer Pty. Ltd., REIT, 144A 3.4% 30/09/2026	USD	826,000	766,999	0.02
Ventas Realty LP, REIT 4.125% 15/01/2026	USD	43,000	41,083	0.00	Macquarie Bank Ltd., FRN, 144A 3.052% 03/03/2036	USD	1,565,000	1,186,298	0.02
Ventas Realty LP, REIT 3.25% 15/10/2026	USD	108,000	98,914	0.00	Macquarie Group Ltd., 144A 6.207% 22/11/2024	USD	2,527,000	2,524,356	0.05
Ventas Realty LP, REIT 3.85% 01/04/2027	USD	369,000	345,339	0.01					
Verizon Communications, Inc. 0.85% 20/11/2025	USD	9,198,000	8,295,123	0.17					
Verizon Communications, Inc. 2.1% 22/03/2028	USD	745,000	652,360	0.01					
Verizon Communications, Inc. 3.15% 22/03/2030	USD	2,915,000	2,582,833	0.05					
Verizon Communications, Inc. 5.05% 09/05/2033	USD	4,185,000	4,122,877	0.08					
Verizon Communications, Inc. 2.65% 20/11/2040	USD	2,481,000	1,710,248	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 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(%)
Macquarie Group Ltd., FRN, 144A 5.033% 15/01/2030	USD	4,000,000	3,914,638	0.08	Brookfield Finance, Inc. 3.9% 25/01/2028	USD	422,000	391,063	0.01
National Australia Bank Ltd., 144A 2.332% 21/08/2030	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., FRN, 144A 3.933% 02/08/2034	USD	1,795,000	1,539,097	0.03	Canadian Imperial Bank of Commerce 3.1% 02/04/2024	USD	500,000	488,786	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	2,366,850	0.05
Newcrest Finance Pty. Ltd., 144A 3.25% 13/05/2030	USD	955,000	844,759	0.02	Element Fleet Management Corp., 144A 6.271% 26/06/2026	USD	6,745,000	6,722,122	0.14
Scentre Group Trust 1, REIT, 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
Scentre Group Trust 2, REIT, FRN, 144A 4.75% 24/09/2080	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 3.375% 30/04/2025	USD	1,200,000	1,149,502	0.02	Nutrien Ltd. 4.125% 15/03/2035	USD	500,000	437,673	0.01
Westpac Banking Corp. 3.133% 18/11/2041	USD	1,789,000	1,205,143	0.03	Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust, 144A 3.875% 20/03/2027	USD	804,000	742,011	0.01
Westpac Banking Corp., FRN 4.322% 23/11/2031	USD	3,920,000	3,630,676	0.07	Province of Quebec Canada 6.35% 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				36,044,949	0.74
バミューダ					ケイマン諸島				
Triton Container International Ltd., 144A 1.15% 07/06/2024	USD	2,005,000	1,899,457	0.04	Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 5.25% 15/05/2024	USD	2,915,000	2,862,260	0.06
			1,899,457	0.04	Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 2.875% 15/02/2025	USD	3,209,000	2,984,983	0.06
カナダ					Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 5.5% 15/01/2026	USD	10,316,000	9,992,753	0.21
Air Canada Pass-Through Trust 'A', 144A 3.6% 15/09/2028	USD	4,073,736	3,770,021	0.08	Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 2.125% 21/02/2026	USD	1,380,000	1,225,480	0.03
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2013-1 'A', 144A 4.125% 15/11/2026	USD	546,904	519,559	0.01	Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 4.25% 15/04/2026	USD	1,830,000	1,707,866	0.03
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2017-1 'A', 144A 3.55% 15/07/2031	USD	1,930,157	1,664,760	0.03	Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 4.375% 01/05/2026	USD	605,000	564,883	0.01
Air Canada Pass-Through Trust, Series 2017-2 'A', 144A 3.3% 15/07/2031	USD	630,302	564,229	0.01	Avolon Holdings Funding Ltd., 144A 2.528% 18/11/2027	USD	13,361,000	11,272,797	0.23
Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 3.439% 13/05/2041	USD	1,190,000	853,903	0.02	HERO Funding Trust, Series 2017-1A 'A2', 144A 4.46% 20/09/2047	USD	1,607,467	1,449,384	0.03
Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 3.8% 25/01/2050	USD	2,525,000	1,823,263	0.04	Park Aerospace Holdings Ltd., 144A 5.5% 15/02/2024	USD	368,000	363,886	0.01
Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 3.625% 13/05/2051	USD	1,325,000	904,332	0.02	Renew, Series 2017-1A 'A', 144A 3.67% 20/09/2052	USD	770,791	669,887	0.01
Bank of Montreal 3.3% 05/02/2024	USD	1,200,000	1,181,893	0.02				33,094,179	0.68
Bank of Montreal 1.85% 01/05/2025	USD	1,950,000	1,821,448	0.04	デンマーク				
Bank of Montreal 5.3% 05/06/2026	USD	2,700,000	2,692,512	0.05	Danske Bank A/S, FRN, 144A 6.466% 09/01/2026	USD	4,090,000	4,081,618	0.08
Bank of Montreal, FRN 3.803% 15/12/2032	USD	433,000	380,983	0.01				4,081,618	0.08
Bank of Nova Scotia (The) 4.85% 01/02/2030	USD	3,064,000	2,956,794	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 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 (%)
フィンランド					TotalEnergies Capital International SA 2.98% 29/06/2041	USD	2,750,000	2,079,215	0.04
Nordea Bank Abp, 144A 3.6% 06/06/2025	USD	6,300,000	6,031,467	0.13				<u>55,982,583</u>	<u>1.15</u>
Nordea Bank Abp, 144A 5.375% 22/09/2027	USD	3,587,000	3,540,615	0.07					
			<u>9,572,082</u>	<u>0.20</u>	ドイツ				
					Deutsche Bank AG, FRN 2.222% 18/09/2024	USD	3,955,000	3,906,819	0.08
フランス					Deutsche Bank AG, FRN 2.129% 24/11/2026	USD	1,940,000	1,721,306	0.04
Air Liquide Finance SA, 144A 2.25% 27/09/2023	USD	578,000	573,368	0.01	Deutsche Bank AG, FRN 6.72% 18/01/2029	USD	1,050,000	1,050,655	0.02
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 144A 4.935% 26/01/2026	USD	2,250,000	2,207,170	0.04	Deutsche Telekom AG, 144A 3.625% 21/01/2050	USD	799,000	600,986	0.01
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 144A 1.604% 04/10/2026	USD	2,845,000	2,511,840	0.05				<u>7,279,766</u>	<u>0.15</u>
BNP Paribas SA, FRN, 144A 2.219% 09/06/2026	USD	1,422,000	1,315,559	0.03	香港				
BNP Paribas SA, FRN, 144A 1.323% 13/01/2027	USD	848,000	752,361	0.02	ATA Group Ltd., 144A 3.6% 09/04/2029	USD	595,000	550,697	0.01
BNP Paribas SA, FRN, 144A 5.335% 12/06/2029	USD	2,500,000	2,464,423	0.05				<u>550,697</u>	<u>0.01</u>
BNP Paribas SA, FRN, 144A 2.159% 15/09/2029	USD	3,415,000	2,836,433	0.06	アイルランド				
BNP Paribas SA, FRN, 144A 3.132% 20/01/2033	USD	1,438,000	1,177,753	0.02	AIB Group plc, FRN, 144A 4.263% 10/04/2025	USD	4,650,000	4,544,049	0.09
BPCE SA, 144A 4.625% 11/07/2024	USD	1,100,000	1,072,284	0.02	Bank of Ireland Group plc, FRN, 144A 6.253% 16/09/2026	USD	2,366,000	2,350,152	0.05
BPCE SA, 144A 1% 20/01/2026	USD	3,415,000	3,039,938	0.06				<u>6,894,201</u>	<u>0.14</u>
BPCE SA, FRN, 144A 1.652% 06/10/2026	USD	1,734,000	1,556,091	0.03	イスラエル				
BPCE SA, FRN, 144A 5.975% 18/01/2027	USD	8,100,000	8,033,599	0.17	Israel Government Bond 5.5% 18/09/2033	USD	1,680,000	1,841,909	0.04
BPCE SA, FRN, 144A 2.277% 20/01/2032	USD	2,495,000	1,923,914	0.04				<u>1,841,909</u>	<u>0.04</u>
BPCE SA, FRN, 144A 3.116% 19/10/2032	USD	2,890,000	2,222,280	0.05	イタリア				
Credit Agricole SA, 144A 2.811% 11/01/2041	USD	1,355,000	890,679	0.02	Eni SpA, 144A 4% 12/09/2023	USD	320,000	318,668	0.01
Credit Agricole SA, FRN, 144A 1.247% 26/01/2027	USD	6,207,000	5,499,224	0.11	UniCredit SpA, FRN, 144A 2.569% 22/09/2026	USD	2,800,000	2,528,825	0.05
Societe Generale SA, 144A 4.351% 13/06/2025	USD	5,000,000	4,834,888	0.10	UniCredit SpA, FRN, 144A 1.982% 03/06/2027	USD	510,000	446,119	0.01
Societe Generale SA, 144A 3% 22/01/2030	USD	364,000	304,520	0.01	UniCredit SpA, FRN, 144A 5.861% 19/06/2032	USD	1,400,000	1,272,658	0.03
Societe Generale SA, FRN, 144A 1.488% 14/12/2026	USD	9,442,000	8,298,404	0.17	UniCredit SpA, FRN, 144A 7.296% 02/04/2034	USD	710,000	667,327	0.01
Societe Generale SA, FRN, 144A 1.792% 09/06/2027	USD	865,000	756,489	0.02				<u>5,233,597</u>	<u>0.11</u>
Societe Generale SA, FRN, 144A 2.889% 09/06/2032	USD	2,085,000	1,632,151	0.03	日本				
					Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., FRN 5.242% 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 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 (%)
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., FRN 5.441% 22/02/2034	USD	1,870,000	1,858,863	0.04	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A 2.35% 15/10/2026	USD	500,000	459,824	0.01
Mizuho Financial Group, Inc., FRN 2.555% 13/09/2025	USD	3,000,000	2,866,214	0.06	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A 4.4% 27/05/2045	USD	250,000	229,175	0.01
Mizuho Financial Group, Inc., FRN 2.226% 25/05/2026	USD	1,675,000	1,553,470	0.03				<u>14,807,596</u>	<u>0.31</u>
Mizuho Financial Group, Inc., FRN 2.869% 13/09/2030	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
Mizuho Financial Group, Inc., FRN 5.739% 27/05/2031	USD	3,210,000	3,196,565	0.07				<u>609,832</u>	<u>0.01</u>
ORIX Corp. 3.7% 18/07/2027	USD	500,000	470,707	0.01					
Sumitomo Life Insurance Co., FRN, 144A 4% 14/09/2077	USD	1,000,000	923,712	0.02	ノルウェー Aker BP ASA, 144A 2% 15/07/2026	USD	701,000	630,347	0.01
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 5% 26/11/2028	USD	2,065,000	2,045,948	0.04	DNB Bank ASA, FRN, 144A 5.896% 09/10/2026	USD	4,200,000	4,165,914	0.09
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.025% 09/07/2040	USD	3,175,000	2,385,766	0.05				<u>4,796,261</u>	<u>0.10</u>
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3.175% 09/07/2050	USD	1,490,000	1,037,738	0.02	パナマ Banco Nacional de Panama, 144A 2.5% 11/08/2030	USD	3,050,000	2,403,512	0.05
			<u>18,960,060</u>	<u>0.39</u>				<u>2,403,512</u>	<u>0.05</u>
ジャージー Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 144A 2.94% 30/09/2040	USD	2,279,640	1,834,763	0.04	国際機関 NXP BV 2.5% 11/05/2031	USD	2,975,000	2,419,305	0.05
			<u>1,834,763</u>	<u>0.04</u>	NXP BV 3.25% 11/05/2041	USD	3,060,000	2,211,366	0.05
					NXP BV 3.25% 30/11/2051	USD	1,565,000	1,033,907	0.02
ルクセンブルク nVent Finance SARL 4.55% 15/04/2028	USD	900,000	841,826	0.02				<u>5,664,578</u>	<u>0.12</u>
Swiss Re Finance Luxembourg SA, FRN, 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
			<u>1,792,707</u>	<u>0.04</u>				<u>1,959,049</u>	<u>0.04</u>
オランダ ABN AMRO Bank NV, FRN, 144A 2.47% 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, FRN, 144A 2.193% 05/06/2026	USD	1,070,000	984,400	0.02
Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 144A 5.564% 28/02/2029	USD	6,500,000	6,407,315	0.13	UBS Group AG, FRN, 144A 1.305% 02/02/2027	USD	2,000,000	1,741,250	0.04
Cooperatieve Rabobank UA 4.375% 04/08/2025	USD	501,000	483,778	0.01	UBS Group AG, FRN, 144A 3.091% 14/05/2032	USD	1,860,000	1,494,845	0.03
Cooperatieve Rabobank UA 3.75% 21/07/2026	USD	1,257,000	1,170,654	0.02				<u>4,768,033</u>	<u>0.10</u>
EDP Finance BV, 144A 3.625% 15/07/2024	USD	2,740,000	2,669,575	0.06					
Enel Finance International NV, 144A 3.5% 06/04/2028	USD	745,000	681,302	0.01	イギリス AstraZeneca plc 6.45% 15/09/2037	USD	520,000	594,189	0.01
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A 3.125% 16/03/2024	USD	700,000	687,526	0.02	AstraZeneca plc 4% 18/09/2042	USD	430,000	379,414	0.01
					AstraZeneca plc 2.125% 06/08/2050	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 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 (%)
Royalty Pharma plc 1.2% 02/09/2025	USD	1,057,000	953,188	0.02	American Homes 4 Rent Trust, Series				
Vodafone Group plc 4.875% 19/06/2049	USD	2,550,000	2,240,140	0.05	2014-SFR3 'A', 144A 3.678% 17/12/2036	USD	12,267,363	11,838,883	0.24
			4,911,633	0.10	American Homes 4 Rent Trust, Series				
					2015-SFR1 'A', 144A 3.467% 17/04/2052	USD	6,098,486	5,834,646	0.12
アメリカ					American Homes 4 Rent Trust, Series				
7-Eleven, Inc., 144A 1.8% 10/02/2031	USD	1,230,000	971,039	0.02	2015-SFR2 'A', 144A 3.732% 17/10/2052	USD	1,365,781	1,309,835	0.03
7-Eleven, Inc., 144A 2.5% 10/02/2041	USD	1,258,000	836,084	0.02	American Homes 4 Rent Trust, Series				
AbbVie, Inc. 4.55% 15/03/2035	USD	500,000	473,008	0.01	2014-SFR3 'B', 144A 4.201% 17/12/2036	USD	750,000	727,465	0.02
Activision Blizzard, Inc. 1.35% 15/09/2030	USD	1,062,000	845,175	0.02	American Homes 4 Rent Trust 'B', 144A 3.813% 17/04/2052	USD	3,000,000	2,881,657	0.06
Advocate Health & Hospitals Corp. 2.21% 15/06/2030	USD	1,300,000	1,089,240	0.02	American Homes 4 Rent Trust, Series				
AEP Transmission Co. LLC 4% 01/12/2046	USD	467,000	389,835	0.01	2014-SFR2 'C', 144A 4.705% 17/10/2036	USD	1,300,000	1,269,481	0.03
AEP Transmission Co. LLC 3.8% 15/06/2049	USD	615,000	490,679	0.01	American Homes 4 Rent Trust, Series				
AIG SunAmerica Global Financing X, 144A 6.9% 15/03/2032	USD	650,000	693,000	0.01	2014-SFR3 'C', 144A 4.596% 17/12/2036	USD	500,000	486,486	0.01
Air Lease Corp. 3.875% 03/07/2023	USD	925,000	925,000	0.02	American Homes 4 Rent Trust, Series				
Alexander Funding Trust, 144A 1.841% 15/11/2023	USD	2,000,000	1,956,432	0.04	2015-SFR2 'C', 144A 4.691% 17/10/2052	USD	1,893,000	1,833,735	0.04
Alternative Loan Trust, Series 2005-54CB '1A11' 5.5% 25/11/2035	USD	98,789	77,120	0.00	American Homes 4 Rent Trust, Series				
Alternative Loan Trust, Series 2005-28CB '1A4' 5.5% 25/08/2035	USD	84,143	72,378	0.00	2014-SFR3 'D', 144A 5.04% 17/12/2036	USD	523,000	509,405	0.01
Alternative Loan Trust, Series 2004-2CB '1A9' 5.75% 25/03/2034	USD	248,720	245,820	0.01	American Homes 4 Rent Trust, Series				
Alternative Loan Trust, Series 2004-28CB '3A1' 6% 25/01/2035	USD	20,205	17,951	0.00	2015-SFR1 'D', 144A 4.407% 17/04/2052	USD	7,618,000	7,343,743	0.15
Alternative Loan Trust, IO, FRN, Series 2005-20CB '3A8' 0% 25/07/2035	USD	390,929	15,210	0.00	American Homes 4 Rent Trust, Series				
Amazon.com, Inc. 3.875% 22/08/2037	USD	1,000,000	906,901	0.02	2014-SFR2 'E', 144A 5.036% 17/10/2052	USD	4,103,000	3,995,990	0.08
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2014-1 'A' 3.7% 01/04/2028	USD	1,379,207	1,230,942	0.03	American Homes 4 Rent Trust, Series				
American Airlines Pass-Through Trust 'AA' 3.6% 22/03/2029	USD	5,988,204	5,524,118	0.11	2014-SFR3 'E', 144A 6.418% 17/12/2036	USD	7,475,000	7,386,180	0.15
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-2 'AA' 3.2% 15/12/2029	USD	5,994,200	5,394,780	0.11	American Homes 4 Rent Trust, Series				
American Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-3 'AA' 3% 15/04/2030	USD	737,038	655,964	0.01	2015-SFR1 'E', 144A 5.639% 17/04/2052	USD	7,664,000	7,497,031	0.15
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				
American Express Co., FRN 4.99% 01/05/2026	USD	4,200,000	4,148,294	0.09	2015-SFR2 'E', 144A 6.07% 17/10/2052	USD	2,800,000	2,736,990	0.06
American Homes 4 Rent Trust, Series 2014-SFR2 'A', 144A 3.786% 17/10/2036	USD	9,715,004	9,425,235	0.19	American Municipal Power, Inc. 'B' 7.49% 15/02/2050	USD	715,000	884,753	0.02
					Amgen, Inc. 1.65% 15/08/2028	USD	1,190,000	1,014,228	0.02
					Amgen, Inc. 5.25% 02/03/2033	USD	2,915,000	2,907,061	0.06
					Amgen, Inc. 3.15% 21/02/2040	USD	625,000	473,842	0.01
					Amgen, 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 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 (%)
Amgen, Inc. 4.663% 15/06/2051	USD	2,350,000	2,076,395	0.04	Bank of America Corp., FRN 1.658%	USD	2,510,000	2,257,344	0.05
Amgen, Inc. 5.65% 02/03/2053	USD	1,550,000	1,551,913	0.03	11/03/2027				
Analog Devices, Inc. 2.8% 01/10/2041	USD	1,854,000	1,367,660	0.03	Bank of America Corp., FRN 1.734%	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., FRN 3.705%	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 2.532% 15/11/2029	USD	1,770,000	1,521,515	0.03	Bank of America Corp., FRN 4.376%	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., FRN 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., FRN 3.97%	USD	409,000	382,044	0.01
Athene Global Funding, 144A 1.45% 08/01/2026	USD	2,770,000	2,430,630	0.05	Bank of America Corp., FRN 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	Bank of America Corp., FRN 2.087%	USD	1,091,000	929,495	0.02
Aviation Capital Group LLC, 144A 5.5% 15/12/2024	USD	2,094,000	2,049,794	0.04	Bank of America Corp., FRN 2.592%	USD	3,045,000	2,549,803	0.05
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2018-2A 'A', 144A 4% 20/03/2025	USD	7,000,000	6,933,383	0.14	Bank of America Corp., FRN 1.898%	USD	1,675,000	1,328,466	0.03
Baltimore Gas and Electric Co. 3.5% 15/08/2046	USD	385,000	289,302	0.01	Bank of America Corp., FRN 2.687%	USD	2,635,000	2,173,423	0.05
Baltimore Gas and Electric Co. 3.2% 15/09/2049	USD	885,000	637,239	0.01	Bank of America Corp., FRN 2.572%	USD	1,190,000	964,334	0.02
Baltimore Gas and Electric Co. 2.9% 15/06/2050	USD	1,000,000	664,157	0.01	Bank of America Corp., FRN 5.288%	USD	4,000,000	3,952,026	0.08
Baltimore Gas and Electric Co. 5.4% 01/06/2053	USD	3,020,000	3,034,233	0.06	Bank of America Corp., FRN 2.676%	USD	6,636,000	4,594,746	0.10
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust, FRN 'A', 144A 4.091% 10/08/2038	USD	5,275,000	4,631,364	0.10	Bank of New York Mellon Corp. (The), FRN 3.43% 13/06/2025	USD	5,000,000	4,877,345	0.10
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 'B', 144A 3.49% 14/04/2033	USD	9,676,000	8,851,962	0.18	BB-UBS Trust, Series 2012-SHOW 'A', 144A 3.43% 05/11/2036	USD	3,850,000	3,603,133	0.07
Banc of America Funding Trust, Series 2004-2 'ICBI' 5.75% 20/09/2034	USD	18,874	18,547	0.00	Bear Stearns ARM Trust, FRN, Series 2004-2 '14A' 3.866% 25/05/2034	USD	16,486	15,258	0.00
Banc of America Funding Trust, Series 2005-6 '2A1' 5.5% 25/10/2035	USD	68,806	58,088	0.00	Bear Stearns ARM Trust, FRN, Series 2003-7 '3A' 4.571% 25/10/2033	USD	3,208	2,972	0.00
Banc of America Funding Trust, PO, Series 2004-2 '30PO' 0% 20/09/2034	USD	7,033	5,098	0.00	Bear Stearns ARM Trust, FRN, Series 2003-4 '3A1' 4.405% 25/07/2033	USD	26,505	25,193	0.00
Banc of America Funding Trust, PO, Series 2005-7 '30PO' 0% 25/11/2035	USD	9,024	8,836	0.00	Bear Stearns ARM Trust, FRN, Series 2006-1 'A1' 6.8% 25/02/2036	USD	30,857	29,650	0.00
Bank of America Corp., FRN 3.458% 15/03/2025	USD	500,000	490,136	0.01	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust, IO, FRN, Series 2005-PWR8 'X1', 144A 0.716%	USD	1,620	2	0.00
Bank of America Corp., FRN 3.366% 23/01/2026	USD	1,000,000	958,170	0.02	11/06/2041				
Bank of America Corp., FRN 5.08% 20/01/2027	USD	2,564,000	2,524,642	0.05	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust, IO, FRN, Series 2007-T26 'X1', 144A 1.169%	USD	40,896	88	0.00
					12/01/2045				

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 (%)
Blackstone Secured Lending Fund 3.65% 14/07/2023	USD	1,860,000	1,857,954	0.04	Capital One Financial Corp., FRN 2.618% 02/11/2032	USD	1,365,000	1,049,399	0.02
Bon Secours Mercy Health, Inc. 3.205% 01/06/2050	USD	1,980,000	1,363,574	0.03	Charter Communications Operating LLC 4.908% 23/07/2025	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% 15/06/2039	USD	936,000	847,296	0.02	Charter Communications Operating LLC 6.384% 23/10/2035	USD	275,000	267,532	0.01
Bristol-Myers Squibb Co. 4.55% 20/02/2048	USD	777,000	719,107	0.02	Charter Communications Operating LLC 5.375% 01/04/2038	USD	400,000	339,441	0.01
British Airways Pass-Through Trust, Series 2013-1 'A', 144A 4.125% 20/03/2033	USD	1,266,218	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 2018-1 'AA', 144A 3.8% 20/03/2033	USD	543,649	500,456	0.01	Charter Communications Operating LLC 4.8% 01/03/2050	USD	2,585,000	1,934,915	0.04
British Airways Pass-Through Trust, Series 2019-1 'AA', 144A 3.3% 15/06/2034	USD	1,049,826	916,237	0.02	Charter Communications Operating LLC 3.7% 01/04/2051	USD	2,570,000	1,611,108	0.03
Brixmor Operating Partnership LP, REIT 2.5% 16/08/2031	USD	765,000	592,589	0.01	Charter Communications Operating LLC 6.834% 23/10/2055	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 '1A5' 4.872% 25/05/2033	USD	92,198	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 '1A7' 4.846% 25/11/2034	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 2007-A1 '1A3' 4.213%	USD	141,959	138,620	0.00
Brooklyn Union Gas Co. (The), 144A 3.865% 04/03/2029	USD	785,000	714,933	0.02	Chase Mortgage Finance Trust, FRN, Series 2007-A1 '2A1' 4.108%	USD	13,393	12,634	0.00
Brooklyn Union Gas Co. (The), 144A 4.273% 15/03/2048	USD	760,000	579,776	0.01	Chase Mortgage Finance Trust, FRN, Series 2007-A2 '2A1' 4.136%	USD	51,768	50,193	0.00
Buckeye Partners LP 5.85% 15/11/2043	USD	450,000	334,373	0.01	Chase Mortgage Finance Trust, FRN, Series 2007-A1 '7A1' 4.305%	USD	7,307	7,214	0.00
BXP Trust, Series 2017-0M 'A', 144A 3.379% 13/06/2039	USD	14,000,000	12,557,320	0.26	Chase Mortgage Finance Trust, FRN, Series 2007-A1 '9A1' 4.292%	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. 3.9% 15/11/2024	USD	400,000	392,840	0.01
Camillo LLC, Series 2016-SFR 1.5% 05/12/2023	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 4.166% 09/05/2025	USD	8,910,000	8,682,923	0.18	Children's Hospital Corp. (The) 2.585% 01/02/2050	USD	1,387,000	883,492	0.02
Capital One Financial Corp., FRN 4.985% 24/07/2026	USD	2,860,000	2,770,226	0.06	Children's National Medical Center 2.928% 15/07/2050	USD	1,580,000	1,025,190	0.02
Capital One Financial Corp., FRN 6.312% 08/06/2029	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 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 (%)
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-5 '1A4' 5.5% 25/06/2034	USD	64,946	63,847	0.00	Citigroup, Inc., FRN 2.52% 03/11/2032	USD	1,740,000	1,397,361	0.03
CHL Mortgage Pass-Through Trust, FRN, Series 2004-7 '2A1' 4.598% 25/06/2034	USD	13,517	12,640	0.00	Citigroup, Inc., FRN 3.057% 25/01/2033	USD	569,000	473,667	0.01
CHL Mortgage Pass-Through Trust, FRN, Series 2005-22 '2A1' 3.504% 25/11/2035	USD	105,278	83,668	0.00	Citigroup, Inc., FRN 6.174% 25/05/2034	USD	2,279,000	2,292,109	0.05
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-3 'A26' 5.5% 25/04/2034	USD	93,342	89,181	0.00	Citigroup, Inc., FRN 3.878% 24/01/2039	USD	200,000	166,691	0.00
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2004-3 'A4' 5.75% 25/04/2034	USD	46,671	44,454	0.00	City of Los Angeles Department of Airports 6.582% 15/05/2039	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), 14A 3.3% 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	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% 01/11/2034	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 '1A2' 6% 25/08/2036	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% 15/07/2036	USD	850,000	694,770	0.01
Citicorp Mortgage Securities, Inc., Series 2004-3 'A5' 5.25% 25/05/2034	USD	140,839	133,865	0.00	Comcast Corp. 3.9% 01/03/2038	USD	2,000,000	1,729,590	0.04
Citigroup Global Markets Mortgage Securities VII, Inc., FRN, Series 2003-HYB1 'A' 4.24% 25/09/2033	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 2003-UP2 'P01' 0% 25/06/2033	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-UST1 'A3' 4.279% 25/08/2034	USD	8,007	7,663	0.00	Comcast Corp. 2.887% 01/11/2051	USD	1,439,000	955,563	0.02
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-2 '2A11' 5.5% 25/05/2035	USD	47,035	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' 5.25% 25/10/2033	USD	4,454	4,073	0.00	COMM Mortgage Trust, FRN, Series 2018-HOME 'A', 14A 3.815% 10/04/2033	USD	13,840,000	12,439,619	0.26
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2003-1 '3A4' 5.25% 25/09/2033	USD	13,101	12,231	0.00	COMM Mortgage Trust, Series 2015-CR25 'A4' 3.75% 10/08/2048	USD	1,250,000	1,187,092	0.02
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2003-TP3 'A3' 7% 25/09/2033	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	1,047,957	0.02
Citigroup, Inc., FRN 3.52% 27/10/2028	USD	750,000	695,897	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	1,403,414	0.03
					Constellation Energy Generation LLC 3.25% 01/06/2025	USD	1,230,000	1,169,923	0.02
					Constellation Energy Generation LLC 5.8% 01/03/2033	USD	2,417,000	2,468,869	0.05
					Constellation Energy Generation LLC 6.25% 01/10/2039	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 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 (%)
Corebridge Financial, Inc. 3.85% 05/04/2029	USD	985,000	886,603	0.02	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, PO, Series 2005-10 'AP' 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 OA LLC 'A2', 144A 3.953% 15/09/2037	USD	13,175,000	11,388,246	0.24
Cox Communications, Inc., 144A 3.35% 15/09/2026	USD	503,000	470,818	0.01	CSMC OA LLC, Series 2014-USA 'D', 144A 4.373% 15/09/2037	USD	6,000,000	4,366,716	0.09
Cox Communications, Inc., 144A 3.5% 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 2.95% 01/10/2050	USD	1,485,000	924,890	0.02	CSX Corp. 4.1% 15/03/2044	USD	165,000	141,135	0.00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 5% 25/08/2042	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 '1M' 5.25% 25/09/2033	USD	38,871	36,978	0.00	CSX Corp. 3.35% 15/09/2049	USD	230,000	168,695	0.00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., FRN, Series 2004-AR2 '2A1' 4.158% 25/03/2034	USD	11,501	11,292	0.00	CVS Pass-Through Trust, 144A 5.298% 11/01/2027	USD	85,746	83,957	0.00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., PO, Series 2003-21 'AP' 0% 25/09/2033	USD	8,984	6,161	0.00	CVS Pass-Through Trust, 144A 7.507% 10/01/2032	USD	861,170	898,004	0.02
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., PO, Series 2004-3 'AP' 0% 25/06/2034	USD	11,120	6,949	0.00	CVS Pass-Through Trust, 144A 5.773% 10/01/2033	USD	471,650	461,666	0.01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp., FRN, Series 2003-1 'DB1' 6.655% 25/02/2033	USD	21,899	21,375	0.00	CVS Pass-Through Trust, 144A 5.926% 10/01/2034	USD	479,139	466,013	0.01
CRH America Finance, Inc., 144A 3.4% 09/05/2027	USD	298,000	278,722	0.01	CVS Pass-Through Trust, Series 2009, 144A 8.353% 10/07/2031	USD	229,729	240,328	0.01
CRH America, Inc., 144A 3.875% 18/05/2025	USD	1,700,000	1,637,180	0.03	CVS Pass-Through Trust, Series 2014, 144A 4.163% 11/08/2036	USD	351,657	315,399	0.01
CRH America, Inc., 144A 5.125% 18/05/2045	USD	200,000	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 2004-8 '1M' 5.5% 25/12/2034	USD	76,704	74,477	0.00	Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust, Series 2004-1 '3A6' 5.24% 25/12/2033	USD	1,100	1,058	0.00
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-4 '2M' 5.5% 25/09/2034	USD	41,112	39,812	0.00	Devon Energy Corp. 5.25% 15/09/2024	USD	1,300,000	1,289,948	0.03
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Trust, Series 2003-27 '3M' 5.25% 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, PO, Series 2003-27 'AP' 0% 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 3.616% 01/08/2027	USD	1,350,000	1,212,670	0.03
					Duquesne Light Holdings, Inc., 144A 2.532% 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% 15/06/2046	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 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(%)
Equinix, Inc., REIT 1.45% 15/05/2026	USD	2,120,000	1,892,596	0.04	FHLMC, Series K065 'AM' 3.326%	USD	1,600,000	1,515,419	0.03
Equinix, Inc., REIT 2.9% 18/11/2026	USD	2,850,000	2,613,714	0.05	25/05/2027				
ERAC USA Finance LLC, 144A 7% 15/10/2037	USD	510,000	581,017	0.01	FHLMC, Series 3928 'D' 4%	USD	2,112,489	1,919,532	0.04
ERAC USA Finance LLC, 144A 5.625% 15/03/2042	USD	96,000	95,609	0.00	15/09/2041				
Exelon Corp. 5.3% 15/03/2033	USD	1,500,000	1,491,011	0.03	FHLMC, Series 4900 'D' 3%	USD	1,734,611	1,540,312	0.03
F&G Global Funding, 144A 1.75% 30/06/2026	USD	1,575,000	1,395,112	0.03	25/07/2049				
Fells Point Funding Trust, 144A 3.046% 31/01/2027	USD	4,370,000	4,016,471	0.08	FHLMC, FRN, Series 264 'F1' 5.657%	USD	781,808	763,492	0.02
FHLMC 4% 01/07/2048	USD	4,061,250	3,869,430	0.08	15/07/2042				
FHLMC, IO, Series 233 '11' 5% 15/09/2035	USD	25,684	4,986	0.00	FHLMC, FRN, Series 270 'F1' 5.607%	USD	240,790	234,456	0.01
FHLMC, IO, Series 233 '13' 5% 15/09/2035	USD	66,455	11,538	0.00	15/08/2042				
FHLMC, Series T-54 '2A' 6.5% 25/02/2043	USD	14,416	15,000	0.00	FHLMC, IO, FRN, Series 3202 'HI' 1.543% 15/08/2036	USD	194,680	15,501	0.00
FHLMC, FRN, Series T-76 '2A' 2.02% 25/10/2037	USD	239,881	204,767	0.00	FHLMC, Series 24 'J' 6.25% 25/11/2023	USD	372	371	0.00
FHLMC, Series 262 '35' 3.5% 15/07/2042	USD	1,246,429	1,163,074	0.02	FHLMC 'KT' 1.5% 25/06/2050	USD	5,416,427	4,196,655	0.09
FHLMC, FRN, Series T-41 '3A' 4.31% 25/07/2032	USD	9,218	8,687	0.00	FHLMC, Series 29 'L' 7.5% 25/04/2024	USD	2,811	2,802	0.00
FHLMC, Series T-54 '3A' 7% 25/02/2043	USD	18,346	19,183	0.00	FHLMC 'NE' 1.5% 25/10/2051	USD	3,576,148	2,953,584	0.06
FHLMC, FRN, Series K048 'A2' 3.284% 25/06/2025	USD	3,000,000	2,895,883	0.06	FHLMC, IO, FRN, Series 239 'S30' 2.593% 15/08/2036	USD	115,943	14,238	0.00
FHLMC, Series K054 'A2' 2.745% 25/01/2026	USD	4,000,000	3,785,984	0.08	FHLMC, Series 2763 'ZA' 6% 15/03/2034	USD	2,653,393	2,694,455	0.06
FHLMC, Series K065 'A2' 3.243% 25/04/2027	USD	2,983,000	2,831,828	0.06	FHLMC, Series 2945 'ZB' 5.5% 15/03/2035	USD	1,083,564	1,061,648	0.02
FHLMC, Series K088 'A2' 3.69% 25/01/2029	USD	1,156,000	1,105,996	0.02	FHLMC, Series 2779 'ZC' 6% 15/04/2034	USD	1,630,064	1,661,675	0.03
FHLMC, FRN 'A2' 3.71% 25/09/2032	USD	7,960,000	7,483,151	0.15	FHLMC, Series 2691 'ZU' 5.5% 15/09/2033	USD	857,162	862,146	0.02
FHLMC, FRN 'A2' 3.8% 25/10/2032	USD	9,600,000	9,088,442	0.19	FHLMC, FRN 1A1082 5.79% 01/07/2036	USD	16,835	17,183	0.00
FHLMC, Series K152 'A2' 3.08% 25/01/2031	USD	3,761,000	3,417,320	0.07	FHLMC, FRN 1A1085 6.016% 01/08/2036	USD	27,293	27,628	0.00
FHLMC, FRN 'A2' 3.82% 25/01/2060	USD	10,000,000	9,474,376	0.20	FHLMC, FRN 1A1096 6.315% 01/10/2036	USD	40,910	41,613	0.00
FHLMC, Series KJ26 'A2' 2.606% 25/07/2027	USD	8,456,872	7,934,392	0.16	FHLMC, FRN 1A1097 6.569% 01/10/2036	USD	47,979	48,132	0.00
FHLMC, Series T-42 'A5' 7.5% 25/02/2042	USD	181,242	183,194	0.00	FHLMC, FRN 1B1665 4.819% 01/04/2034	USD	6,232	6,055	0.00
FHLMC, Series T-56 'A5' 5.231% 25/05/2043	USD	540,886	520,776	0.01	FHLMC, FRN 1G2557 4.353% 01/06/2036	USD	65,483	66,385	0.00
FHLMC, FRN, Series W5FX 'AFX' 3.214% 25/04/2028	USD	2,228,000	2,067,695	0.04	FHLMC, FRN 1J1399 4.375% 01/12/2036	USD	3,645	3,577	0.00
					FHLMC, FRN 1J1418 3.94% 01/12/2036	USD	17,632	17,234	0.00
					FHLMC, FRN 1J1516 4.074% 01/02/2037	USD	18,631	18,692	0.00
					FHLMC, FRN 1J2945 4% 01/11/2037	USD	9,311	9,140	0.00
					FHLMC, FRN 1K0046 4.48% 01/10/2036	USD	33,851	33,241	0.00
					FHLMC, FRN 1L1286 5.25% 01/05/2036	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 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 (%)
FHLMC, FRN 1N0206 5.995% 01/08/2036	USD	10,062	10,187	0.00	FHLMC U63546 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 U69030 4.5% 01/01/2046	USD	1,793,527	1,767,446	0.04
FHLMC, FRN 1N1463 4.803% 01/05/2037	USD	5,616	5,449	0.00	FHLMC U90673 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 U90690 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 U90975 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 U91253 4% 01/04/2043	USD	1,961,878	1,875,881	0.04
FHLMC, FRN 782760 4.304% 01/11/2036	USD	24,379	24,874	0.00	FHLMC U91305 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 U91484 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 U93007 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 U93024 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 U93089 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 U93090 3.5% 01/11/2045	USD	476,006	446,750	0.01
FHLMC, FRN 848431 4.352% 01/02/2036	USD	58,905	58,981	0.00	FHLMC U93143 3.5% 01/04/2046	USD	517,851	485,959	0.01
FHLMC, FRN 848699 4.02% 01/07/2040	USD	34,355	34,863	0.00	FHLMC U93154 3.5% 01/05/2046	USD	57,530	53,489	0.00
FHLMC, FRN 972200 4.155% 01/03/2036	USD	15,018	14,683	0.00	FHLMC U99051 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 U99134 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 V85515 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 Z40024 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 'AI' 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 3607 'AO' 0% 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 'AZ' 6.5% 15/07/2036	USD	116,878	120,970	0.00
FHLMC G02436 6.5% 01/09/2036	USD	57,603	60,247	0.00	FHLMC REMICS, Series 3453 'B' 5.5% 15/05/2038	USD	9,342	9,255	0.00
FHLMC G04077 6.5% 01/03/2038	USD	44,460	46,739	0.00	FHLMC REMICS, Series 3957 '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 2694 'BA' 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 'BC' 5.5% 15/02/2036	USD	80,651	81,086	0.00
FHLMC G06493 4.5% 01/05/2041	USD	896,109	884,126	0.02	FHLMC REMICS, PO, Series 3607 'BO'	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 3621 'BO' 0% 15/04/2036	USD	37,887	31,654	0.00
FHLMC G60214 5% 01/07/2035	USD	3,717,037	3,741,747	0.08	FHLMC REMICS, PO, Series 3621 'BO' 0% 15/01/2040	USD	37,887	31,654	0.00
FHLMC L10224 6% 01/12/2034	USD	102,232	102,158	0.00	FHLMC REMICS, FRN, Series 3632 'BS' 0.475% 15/02/2040	USD	89,748	84,501	0.00
FHLMC Q42657 3.5% 01/08/2046	USD	1,969,197	1,823,298	0.04	FHLMC REMICS, Series 3501 'CB' 5.5% 15/01/2039	USD	124,245	125,156	0.00
FHLMC Q49329 4.5% 01/07/2047	USD	417,374	411,677	0.01	FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 3260 'CS' 1.033% 15/01/2037	USD	18,973	1,452	0.00
FHLMC Q52834 4% 01/12/2047	USD	2,055,945	1,950,834	0.04	FHLMC REMICS, Series 3684 'CV' 4.5% 15/06/2025	USD	91,301	90,197	0.00
FHLMC RE0011 2.5% 01/12/2049	USD	4,441,141	3,909,302	0.08	FHLMC REMICS, IO, Series 3219 'DI' 6% 15/04/2036	USD	19,423	3,656	0.00
					FHLMC REMICS, FRN, Series 3051 'DP' 5.555% 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 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 (%)
FHLMC REMICS, Series 3704 'DT' 7.5% 15/11/2036	USD	108,676	115,441	0.00	FHLMC REMICS, PO, Series 3171 'MO' 0% 15/06/2036	USD	12,874	11,401	0.00
FHLMC REMICS, PO, Series 3117 'EO' 0% 15/02/2036	USD	9,150	7,714	0.00	FHLMC REMICS, Series 3966 'NA' 4% 15/12/2041	USD	552,839	530,030	0.01
FHLMC REMICS, PO, Series 3153 'EO' 0% 15/05/2036	USD	46,883	39,230	0.00	FHLMC REMICS, Series 2410 'NG' 6.5% 15/02/2032	USD	4,076	4,178	0.00
FHLMC REMICS, PO, Series 4280 'EO' 0% 15/12/2043	USD	419,953	312,840	0.01	FHLMC REMICS, PO, Series 3134 0% 15/03/2036	USD	2,312	2,000	0.00
FHLMC REMICS, Series 3704 'ET' 7.5% 15/12/2036	USD	94,070	100,528	0.00	FHLMC REMICS, PO, Series 3138 0% 15/04/2036	USD	10,560	8,820	0.00
FHLMC REMICS, Series 2388 'EZ' 8.5% 15/06/2031	USD	9,473	10,165	0.00	FHLMC REMICS, PO, Series 3151 0% 15/05/2036	USD	47,084	37,902	0.00
FHLMC REMICS, FRN, Series 3549 'FA' 6.307% 15/07/2039	USD	6,603	6,596	0.00	FHLMC REMICS, PO, Series 3200 0% 15/08/2036	USD	44,470	36,166	0.00
FHLMC REMICS, FRN, Series 2388 'FB' 5.707% 15/01/2029	USD	11,350	11,355	0.00	FHLMC REMICS, PO, Series 3607 0% 15/05/2037	USD	112,876	91,350	0.00
FHLMC REMICS, FRN, Series 4048 'FJ' 4.035% 15/07/2037	USD	523,712	510,394	0.01	FHLMC REMICS, PO, Series 3611 0% 15/07/2034	USD	12,386	10,519	0.00
FHLMC REMICS, FRN, Series 3275 'FL' 5.547% 15/02/2037	USD	5,822	5,690	0.00	FHLMC REMICS, PO, Series 3621 0% 15/01/2040	USD	62,646	49,653	0.00
FHLMC REMICS, Series 2544 'HC' 6% 15/12/2032	USD	16,486	16,797	0.00	FHLMC REMICS, Series 3047 'OD' 5.5% 15/10/2035	USD	77,488	76,788	0.00
FHLMC REMICS, Series 2483 'HZ' 4.5% 15/08/2032	USD	299,192	294,447	0.01	FHLMC REMICS, Series 3064 'OE' 5.5% 15/11/2035	USD	179,371	180,342	0.00
FHLMC REMICS, IO, Series 3714 'IP' 5% 15/08/2040	USD	57,680	3,985	0.00	FHLMC REMICS, PO, Series 3117 'OG' 0% 15/02/2036	USD	23,549	20,051	0.00
FHLMC REMICS, Series 1621 'J' 6.4% 15/11/2023	USD	3,095	3,085	0.00	FHLMC REMICS, PO, Series 3122 'OH' 0% 15/03/2036	USD	24,386	20,796	0.00
FHLMC REMICS, PO, Series 3316 'JO' 0% 15/05/2037	USD	6,443	5,002	0.00	FHLMC REMICS, PO, Series 3117 'OK' 0% 15/02/2036	USD	10,942	9,143	0.00
FHLMC REMICS, PO, Series 3393 'JO' 0% 15/09/2032	USD	241,650	207,795	0.00	FHLMC REMICS, Series 2720 'PC' 5% 15/12/2023	USD	869	865	0.00
FHLMC REMICS, Series 1578 'K' 6.9% 15/09/2023	USD	138	138	0.00	FHLMC REMICS, Series 2165 'PE' 6% 15/06/2029	USD	74,202	74,423	0.00
FHLMC REMICS, Series 2283 'K' 6.5% 15/12/2023	USD	581	580	0.00	FHLMC REMICS, Series 2110 'PG' 6% 15/01/2029	USD	17,000	17,032	0.00
FHLMC REMICS, PO, Series 3288 'LO' 0% 15/03/2037	USD	34,557	28,658	0.00	FHLMC REMICS, Series 2075 'PH' 6.5% 15/08/2028	USD	4,105	4,148	0.00
FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 3802 'LS' 0% 15/01/2040	USD	151,209	6,192	0.00	FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 3424 'PI' 1.693% 15/04/2038	USD	48,116	4,336	0.00
FHLMC REMICS, Series 2484 'LZ' 6.5% 15/07/2032	USD	8,190	8,309	0.00	FHLMC REMICS, Series 3614 'QB' 4% 15/12/2024	USD	180,417	177,792	0.00
FHLMC REMICS, Series 3461 'LZ' 6% 15/06/2038	USD	17,463	17,867	0.00	FHLMC REMICS, Series 2172 'QC' 7% 15/07/2029	USD	29,705	30,668	0.00
FHLMC REMICS, Series 2575 'ME' 6% 15/02/2033	USD	21,404	21,798	0.00	FHLMC REMICS, FRN, Series 3852 'QN' 5.5% 15/05/2041	USD	112,862	108,127	0.00
FHLMC REMICS, PO, Series 3152 'MO' 0% 15/03/2036	USD	97,170	81,885	0.00	FHLMC REMICS, PO, Series 3671 'QO' 0% 15/12/2036	USD	103,033	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 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 (%)
FHLMC REMICS, FRN, Series 2671 'S' 5.395% 15/09/2033	USD	7,808	7,966	0.00	FHLMC REMICS, FRN, Series 3852 'TP' 5.5% 15/05/2041	USD	116,667	118,257	0.00
FHLMC REMICS, FRN, Series 2967 'S' 5.734% 15/04/2025	USD	3,723	3,376	0.00	FHLMC REMICS, Series 3578 'VZ' 5.5% 15/08/2036	USD	85,300	86,138	0.00
FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 3194 'SA' 1.993% 15/07/2036	USD	5,156	608	0.00	FHLMC REMICS, FRN, Series 3085 'WF' 5.907% 15/08/2035	USD	123,046	124,341	0.00
FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 3387 'SA' 1.313% 15/11/2037	USD	82,504	5,632	0.00	FHLMC REMICS, FRN, Series 2990 'WP' 3.851% 15/06/2035	USD	670	660	0.00
FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 3511 'SA' 0.893% 15/02/2039	USD	48,456	2,784	0.00	FHLMC REMICS, Series 1863 'Z' 6.5% 15/07/2026	USD	930	928	0.00
FHLMC REMICS, FRN, Series 2631 'SA' 5.486% 15/06/2033	USD	12,986	13,464	0.00	FHLMC REMICS, Series 2061 'Z' 6.5% 15/06/2028	USD	2,299	2,328	0.00
FHLMC REMICS, FRN, Series 2733 'SB' 3.413% 15/10/2033	USD	222,153	207,084	0.00	FHLMC REMICS, Series 3035 'Z' 5.85% 15/09/2035	USD	317,027	321,209	0.01
FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 3404 'SC' 0.893% 15/01/2038	USD	143,747	9,087	0.00	FHLMC REMICS, Series 3220 'Z' 6% 15/09/2036	USD	6,158	6,087	0.00
FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 3740 'SC' 0.893% 15/10/2040	USD	106,562	9,120	0.00	FHLMC REMICS, Series 3461 'Z' 6% 15/06/2038	USD	272,435	273,985	0.01
FHLMC REMICS, FRN, Series 2725 'SC' 1.524% 15/11/2033	USD	3,737	3,674	0.00	FHLMC REMICS, Series 1927 'ZA' 6.5% 15/01/2027	USD	12,117	12,230	0.00
FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 3455 'SE' 1.093% 15/06/2038	USD	160,557	16,652	0.00	FHLMC REMICS, Series 2344 'ZD' 6.5% 15/08/2031	USD	16,046	16,330	0.00
FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 4321 'SE' 1.493% 15/03/2044	USD	2,164,248	272,298	0.01	FHLMC REMICS, Series 2259 'ZM' 7% 15/10/2030	USD	4,363	4,517	0.00
FHLMC REMICS, FRN, Series 3064 'SG' 2.975% 15/11/2035	USD	50,483	53,396	0.00	Fifth Third Bancorp, FRN 4.772% 28/07/2030	USD	5,000,000	4,658,760	0.10
FHLMC REMICS, FRN, Series 2416 'SH' 5.785% 17/02/2032	USD	753	715	0.00	Fifth Third Bank NA 3.85% 15/03/2026	USD	200,000	183,705	0.00
FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 3481 'SJ' 0.743% 15/08/2038	USD	39,321	2,754	0.00	Flex Intermediate Holdco LLC, 144A 3.363% 30/06/2031	USD	2,255,000	1,791,046	0.04
FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 3385 'SN' 0.893% 15/11/2037	USD	13,789	755	0.00	Flex Intermediate Holdco LLC, 144A 4.317% 30/12/2039	USD	1,145,000	823,827	0.02
FHLMC REMICS, FRN, Series 3029 'SP' 5.42% 15/09/2035	USD	50,696	54,767	0.00	FNMA 4.56% 01/05/2028	USD	9,070,000	9,065,169	0.19
FHLMC REMICS, IO, FRN, Series 3232 'ST' 1.593% 15/10/2036	USD	33,419	2,551	0.00	FNMA 3.515% 01/07/2029	USD	11,000,000	10,446,185	0.22
FHLMC REMICS, FRN, Series 2571 'SI' 6.342% 15/12/2032	USD	48,343	47,954	0.00	FNMA 1.27% 01/12/2029	USD	4,599,081	3,787,905	0.08
FHLMC REMICS, FRN, Series 3022 'SI' 4.106% 15/08/2025	USD	6,704	6,194	0.00	FNMA 4.41% 01/04/2030	USD	10,360,000	10,289,853	0.21
FHLMC REMICS, Series 2169 'TB' 7% 15/06/2029	USD	5,344	5,469	0.00	FNMA 3.46% 01/08/2030	USD	4,920,602	4,634,793	0.10
FHLMC REMICS, Series 2423 'TB' 6.5% 15/03/2032	USD	38,602	38,778	0.00	FNMA 4.24% 01/12/2030	USD	5,437,000	5,319,384	0.11
FHLMC REMICS, Series 2434 'TC' 7% 15/04/2032	USD	4,684	4,869	0.00	FNMA 1.5% 01/01/2031	USD	10,500,000	8,396,884	0.17
FHLMC REMICS, PO, Series 3077 'TO' 0% 15/04/2035	USD	19,427	18,722	0.00	FNMA 3.99% 01/06/2031	USD	2,265,000	2,161,878	0.04
					FNMA 1.77% 01/11/2031	USD	8,700,000	6,996,714	0.14
					FNMA 3.54% 01/06/2032	USD	10,297,000	9,542,535	0.20
					FNMA 3.765% 01/07/2032	USD	5,122,000	4,828,690	0.10
					FNMA 3.84% 01/07/2032	USD	2,467,383	2,343,133	0.05
					FNMA 3.7% 01/08/2032	USD	9,020,000	8,457,778	0.17
					FNMA 3.41% 01/09/2032	USD	21,383,659	19,890,466	0.41
					FNMA 3.51% 01/09/2032	USD	5,272,000	4,866,882	0.10
					FNMA 3.8% 01/09/2032	USD	7,687,167	7,265,375	0.15
					FNMA 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 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 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	9,748,068	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, FRN, Series 2005-W3 '2AF'	USD	286,924	284,145	0.01
FNMA 1.4% 01/11/2032	USD	12,000,000	9,083,206	0.19	5.37% 25/03/2045				
FNMA 3.54% 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, FRN, Series 2003-W8 '3F1'	USD	37,396	37,106	0.00
FNMA 3.895% 01/02/2033	USD	9,850,000	9,433,782	0.19	5.55% 25/05/2042				
FNMA 4.15% 01/03/2033	USD	6,900,000	6,708,986	0.14	FNMA, IO, FRN, Series 2003-W6 '4I'	USD	1,408,673	24,018	0.00
FNMA 4.19% 01/04/2033	USD	7,766,000	7,578,603	0.16	0.55% 25/09/2042				
FNMA 4.5% 01/04/2033	USD	4,030,000	4,030,461	0.08	FNMA, Series 2009-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' 7.5%	USD	90,778	89,055	0.00
FNMA 5.5% 01/01/2058	USD	5,160,637	5,295,804	0.11	25/11/2040				
FNMA 3.5% 01/03/2061	USD	6,226,917	5,642,681	0.12	FNMA, Series 2001-T7 'A1' 7.5%	USD	81,613	85,929	0.00
FNMA 2.5% 01/07/2061	USD	6,995,261	5,720,217	0.12	25/02/2041				
FNMA 2.5% 01/09/2061	USD	10,961,376	8,963,366	0.19	FNMA, Series 2002-T16 '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, FRN, Series 2007-101 'A2'	USD	52,178	51,602	0.00
FNMA 6% 01/12/2061	USD	9,299,490	9,743,958	0.20	4.839% 27/06/2036				
FNMA 2.5% 01/03/2062	USD	12,789,817	10,514,271	0.22	FNMA, Series 2015-M1 'A2' 2.532%	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 3.5% 01/06/2062	USD	9,267,038	8,339,645	0.17	FNMA, FRN, Series 2015-M10 '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% 25/04/2027				
FNMA, FRN 1.754% 01/03/2032	USD	9,994,806	8,060,345	0.17	FNMA, Series 2015-M7 'A2' 2.59%	USD	2,076,284	1,990,461	0.04
FNMA, PO, Series 293 '1' 0%	USD	3,188	3,153	0.00	25/12/2024				
FNMA, PO, Series 300 '1' 0%	USD	2,677	2,636	0.00	FNMA, Series 2016-M6 'A2' 2.488%	USD	4,096,356	3,830,226	0.08
FNMA, Series 2004-W11 '1A1' 6%	USD	231,586	234,015	0.01	25/05/2026				
FNMA, Series 2021-M3 '1A1' 1%	USD	1,069,553	1,002,656	0.02	FNMA, Series 2016-M7 'A2' 2.499%	USD	1,895,730	1,764,173	0.04
FNMA, Series 2005-W1 '1A2' 6.5%	USD	231,676	237,191	0.01	25/09/2026				
FNMA, Series 2004-T2 '1A4' 7.5%	USD	131,187	133,958	0.00	FNMA, FRN, Series 2017-M1 'A2'	USD	3,223,064	2,993,332	0.06
FNMA, FRN, Series 2007-W7 '1A4'	USD	3,947	4,528	0.00	2.415% 25/10/2026				
FNMA, FRN, Series 2003-W4 '2A'	USD	3,312	3,290	0.00	FNMA, FRN, Series 2017-M12 'A2'	USD	3,361,488	3,171,430	0.07
5.167% 25/10/2042					3.062% 25/06/2027				
FNMA, Series 2006-W3 '2A' 6%	USD	70,920	69,279	0.00	FNMA, FRN, Series 2017-M3 'A2'	USD	946,250	879,100	0.02
25/09/2046					2.471% 25/12/2026				
FNMA, FRN, Series 2002-W6 '2A1' 7%	USD	42,506	40,909	0.00	FNMA, FRN, Series 2017-M4 'A2'	USD	5,632,483	5,242,595	0.11
25/06/2042					2.553% 25/12/2026				
					FNMA, FRN, Series 2017-M5 'A2' 3.07%	USD	3,240,480	3,013,332	0.06
					25/04/2029				
					FNMA, FRN, Series 2017-M8 'A2'	USD	4,168,391	3,916,410	0.08
					3.061% 25/05/2027				
					FNMA, Series 2018-M10 'A2'	USD	4,677,000	4,425,778	0.09
					3.357% 25/07/2028				
					FNMA, FRN, Series 2018-M4 'A2'	USD	1,998,148	1,877,035	0.04
					3.064% 25/03/2028				

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, Series 2020-M50 'A2' 1.2% 25/10/2030	USD	3,913,398	3,451,144	0.07	FNMA, PO, Series 2006-111 'EO' 0% 25/11/2036	USD	5,439	4,495	0.00
FNMA, FRN 'A2' 1.707% 25/11/2031	USD	7,400,000	5,971,007	0.12	FNMA, PO, Series 2004-46 'EP' 0% 25/03/2034	USD	21,361	20,229	0.00
FNMA, FRN, Series 2007-106 'A7' 6.063% 25/10/2037	USD	39,165	39,850	0.00	FNMA, FRN, Series 2005-90 'ES' 4.03% 25/10/2035	USD	22,926	22,872	0.00
FNMA, Series 2008-56 'AC' 5% 25/07/2038	USD	58,559	56,872	0.00	FNMA, Series 2005-67 'EY' 5.5% 25/08/2025	USD	23,492	23,177	0.00
FNMA, Series 2001-W4 'AF6' 5.11% 25/01/2032	USD	4,580	4,516	0.00	FNMA, FRN, Series 412 'F2' 5.638% 25/08/2042	USD	316,361	316,831	0.01
FNMA, Series 2010-111 'AM' 5.5% 25/10/2040	USD	405,976	415,499	0.01	FNMA, FRN, Series 2007-54 'FA' 5.538% 25/06/2037	USD	16,773	16,438	0.00
FNMA, PO, Series 2006-22 'AO' 0% 25/04/2036	USD	15,910	13,444	0.00	FNMA, FRN, Series 2007-16 'FC' 5.888% 25/03/2037	USD	3,413	3,379	0.00
FNMA, PO, Series 2007-42 'AO' 0% 25/05/2037	USD	4,645	3,997	0.00	FNMA, FRN, Series 2010-43 'FD' 5.738% 25/05/2040	USD	108,462	107,460	0.00
FNMA, PO, Series 2009-113 'AO' 0% 25/01/2040	USD	42,761	34,732	0.00	FNMA, FRN, Series 2003-119 'FH' 5.638% 25/12/2033	USD	70,898	70,829	0.00
FNMA, PO, Series 2006-58 'AP' 0% 25/07/2036	USD	13,107	10,943	0.00	FNMA, FRN, Series 2004-61 'FH' 5.938% 25/11/2032	USD	103,525	104,428	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2007-60 'AX' 2.012% 25/07/2037	USD	181,594	20,564	0.00	FNMA, FRN, Series 2010-40 'FJ' 5.738% 25/04/2040	USD	47,583	47,526	0.00
FNMA, Series 2003-105 'AZ' 5.5% 25/10/2033	USD	410,663	411,706	0.01	FNMA, Series 2007-71 'GB' 6% 25/07/2037	USD	64,137	66,353	0.00
FNMA, Series 2007-76 'AZ' 5.5% 25/08/2037	USD	38,737	38,401	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2006-94 'GI' 1.512% 25/10/2026	USD	48,874	935	0.00
FNMA, Series 2004-97 'B' 5.5% 25/01/2035	USD	2,708,831	2,730,382	0.06	FNMA, Series 2009-69 'GL' 5% 25/09/2039	USD	326,022	322,118	0.01
FNMA, Series 2007-42 'B' 6% 25/05/2037	USD	98,768	100,245	0.00	FNMA, PO, Series 2006-44 'GO' 0% 25/06/2036	USD	9,352	7,926	0.00
FNMA, Series 2001-79 'BA' 7% 25/03/2045	USD	44,580	45,180	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2009-6 'GS' 1.412% 25/02/2039	USD	40,330	3,439	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2008-1 'BI' 0.772% 25/02/2038	USD	59,557	3,988	0.00	FNMA, FRN, Series 2006-124 'HB' 3.95% 25/11/2036	USD	34,599	35,713	0.00
FNMA, FRN, Series 2012-137 'CF' 5.438% 25/08/2041	USD	183,648	182,210	0.00	FNMA, Series 2009-59 'HB' 5% 25/08/2039	USD	141,596	139,719	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2008-53 'CI' 2.062% 25/07/2038	USD	25,504	2,436	0.00	FNMA, Series 2001-81 'HE' 6.5% 25/01/2032	USD	135,097	137,722	0.00
FNMA, FRN, Series 2005-74 'CS' 5.891% 25/05/2035	USD	18,869	18,935	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2007-116 'HI' 0% 25/01/2038	USD	59,961	2,176	0.00
FNMA, FRN, Series 2005-45 'DC' 5.471% 25/06/2035	USD	40,696	39,425	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2008-46 'HI' 0% 25/06/2038	USD	19,693	1,001	0.00
FNMA, FRN, Series 2006-79 'DF' 5.488% 25/08/2036	USD	18,595	18,474	0.00	FNMA, IO, Series 2003-33 'IA' 6.5% 25/05/2033	USD	49,427	8,912	0.00
FNMA 'DN' 2.5% 25/10/2049	USD	2,906,003	2,482,494	0.05	FNMA, IO, Series 2009-86 'IP' 5.5% 25/10/2039	USD	40,465	7,440	0.00
FNMA, PO, Series 2006-79 'DO' 0% 25/08/2036	USD	13,453	11,813	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2008-16 'IS' 1.062% 25/03/2038	USD	24,678	1,473	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2007-72 'EK' 1.262% 25/07/2037	USD	232,412	20,023	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 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, Series 2003-35 'IU' 6% 25/05/2033	USD	45,144	7,783	0.00	FNMA, Series 2009-63 'P' 5% 25/03/2037	USD	5,120	4,967	0.00
FNMA, IO, Series 2003-44 'IU' 7% 25/06/2033	USD	15,423	2,389	0.00	FNMA, PO, Series 2006-44 'P' 0% 25/12/2033	USD	27,247	22,721	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2007-65 'KI' 1.482% 25/07/2037	USD	57,092	4,895	0.00	FNMA, Series 1998-58 'PC' 6.5% 25/10/2028	USD	20,543	20,684	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2010-23 'KS' 1.962% 25/02/2040	USD	59,935	3,646	0.00	FNMA, Series 2005-109 'PC' 6% 25/12/2035	USD	42,711	42,679	0.00
FNMA, Series 2011-118 'LB' 7% 25/11/2041	USD	399,299	421,033	0.01	FNMA, Series 2006-77 'PC' 6.5% 25/08/2036	USD	37,469	38,107	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2011-30 'LS' 0% 25/04/2041	USD	104,652	5,300	0.00	FNMA, Series 1997-39 'PD' 7.5% 20/05/2027	USD	3,341	3,383	0.00
FNMA, FRN, Series 2006-33 'LS' 7.029% 25/06/2036	USD	26,133	29,518	0.00	FNMA, Series 2001-44 'PD' 7% 25/09/2031	USD	1,123	1,163	0.00
FNMA, Series 2005-84 'MB' 5.75% 25/10/2035	USD	22,925	22,830	0.00	FNMA, Series 2001-7 'PF' 7% 25/03/2031	USD	780	816	0.00
FNMA, FRN, Series 2009-103 'MB' 4.407% 25/12/2039	USD	29,134	29,517	0.00	FNMA, Series 2011-52 'PH' 5% 25/06/2041	USD	1,224,055	1,239,258	0.03
FNMA, Series 2011-118 'MT' 7% 25/11/2041	USD	357,659	375,066	0.01	FNMA, IO, FRN, Series 2007-109 'PI' 1.212% 25/12/2037	USD	82,340	3,726	0.00
FNMA, Series 2006-85 'MZ' 6.5% 25/09/2036	USD	17,479	18,011	0.00	FNMA, IO, Series 2009-52 'PI' 5% 25/07/2039	USD	29,570	5,184	0.00
FNMA, Series 2016-38 'NA' 3% 25/01/2046	USD	1,672,953	1,522,214	0.03	FNMA, Series 1994-63 'PR' 7% 25/04/2024	USD	4,022	4,011	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2002-W10 0.915% 25/08/2042	USD	470,970	12,225	0.00	FNMA, Series 1993-203 'PL' 6.5% 25/10/2023	USD	1,091	1,083	0.00
FNMA, PO, Series 2005-90 0% 25/09/2035	USD	4,044	3,868	0.00	FNMA, FRN, Series 2006-11 'PS' 5.727% 25/03/2036	USD	36,585	41,640	0.00
FNMA, PO, Series 2006-110 0% 25/11/2036	USD	10,147	8,439	0.00	FNMA, FRN, Series 2006-62 'PS' 9.072% 25/07/2036	USD	6,438	7,964	0.00
FNMA, PO, Series 2006-36 0% 25/05/2036	USD	166,104	139,296	0.00	FNMA, FRN, Series 2004-T3 'PT1' 9.409% 25/01/2044	USD	85,256	88,413	0.00
FNMA, PO, Series 2006-58 0% 25/07/2036	USD	29,188	24,384	0.00	FNMA, Series 2005-76 'PZ' 5.5% 25/09/2035	USD	357,190	360,596	0.01
FNMA, PO, Series 2007-48 0% 25/05/2037	USD	60,589	51,113	0.00	FNMA, PO, Series 2006-65 'Q0' 0% 25/07/2036	USD	8,571	7,296	0.00
FNMA, PO, Series 2009-69 0% 25/09/2039	USD	51,457	40,449	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2009-17 'QS' 1.512% 25/07/2039	USD	24,859	1,612	0.00
FNMA, PO, Series 2013-92 0% 25/09/2043	USD	203,229	153,040	0.00	FNMA, FRN, Series 2008-28 'QS' 5.286% 25/04/2038	USD	26,167	26,864	0.00
FNMA, Series 2011-118 'NT' 7% 25/11/2041	USD	430,930	449,150	0.01	FNMA, IO, FRN, Series 2005-56 'S' 1.572% 25/07/2035	USD	35,327	2,656	0.00
FNMA, PO, Series 2006-27 'OH' 0% 25/04/2036	USD	15,743	13,547	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 1996-4 'SA' 3.362% 25/02/2024	USD	2,428	23	0.00
FNMA, PO, Series 2006-15 'OP' 0% 25/03/2036	USD	54,690	44,792	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2007-108 'SA' 1.222% 25/12/2037	USD	7,614	421	0.00
FNMA, PO, Series 2009-86 'OT' 0% 25/10/2037	USD	120,535	98,073	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2008-80 'SA' 0.712% 25/09/2038	USD	33,911	2,093	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 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, FRN, Series 2010-125 'SA' 0% 25/11/2040	USD	161,082	3,927	0.00	FNMA, Series 2009-79 'UA' 7% 25/03/2038	USD	7,522	7,688	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2010-68 'SA' 0% 25/07/2040	USD	150,516	7,420	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2006-53 'US' 1.442% 25/06/2036	USD	67,875	5,257	0.00
FNMA, FRN, Series 2004-25 'SA' 5.396% 25/04/2034	USD	2,198	2,245	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2012-134 'US' 1.062% 25/01/2042	USD	1,291,580	60,546	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2003-116 'SB' 2.462% 25/11/2033	USD	12,045	877	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2007-88 'VI' 1.402% 25/09/2037	USD	126,708	11,026	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2008-81 'SB' 0.712% 25/09/2038	USD	66,247	3,293	0.00	FNMA, Series 2004-50 'VZ' 5.5% 25/07/2034	USD	442,001	440,445	0.01
FNMA, IO, FRN, Series 2010-35 'SB' 1.282% 25/04/2040	USD	40,031	2,644	0.00	FNMA, FRN, Series 2010-1 'WA' 6.227% 25/02/2040	USD	58,066	58,825	0.00
FNMA, FRN, Series 2010-49 'SC' 2.384% 25/03/2040	USD	94,675	90,266	0.00	FNMA, FRN, Series 2010-61 'WA' 5.987% 25/06/2040	USD	61,540	62,318	0.00
FNMA, FRN, Series 2007-1 'SD' 8.172% 25/02/2037	USD	20,326	31,919	0.00	FNMA, FRN, Series 2011-43 'WA' 5.836% 25/05/2051	USD	49,390	49,408	0.00
FNMA, FRN, Series 2002-5 'SE' 5.702% 25/02/2032	USD	8,129	8,003	0.00	FNMA, Series 2006-53 'WE' 6% 25/06/2036	USD	368,804	377,398	0.01
FNMA, IO, FRN, Series 2007-7 'SG' 1.362% 25/08/2036	USD	84,673	9,901	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2006-8 'WN' 1.562% 25/03/2036	USD	548,491	48,742	0.00
FNMA, FRN, Series 2006-95 'SG' 5.648% 25/10/2036	USD	14,772	16,501	0.00	FNMA, PO, Series 2006-8 'WQ' 0% 25/03/2036	USD	149,588	118,996	0.00
FNMA, FRN, Series 2007-29 'SG' 5.54% 25/04/2037	USD	16,264	17,290	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2009-84 'WS' 0.762% 25/10/2039	USD	17,967	966	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2007-53 'SH' 0.962% 25/06/2037	USD	56,849	3,399	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2020-M50 'XI' 1.829% 25/10/2030	USD	55,281,582	3,532,703	0.07
FNMA, FRN, Series 2004-61 'SH' 3.446% 25/11/2032	USD	12,941	12,956	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2021-M3 'XI' 1.937% 25/11/2033	USD	12,290,778	1,066,923	0.02
FNMA, FRN, Series 2004-46 'SK' 2.37% 25/05/2034	USD	25,041	23,795	0.00	FNMA, Series 2005-84 'XH' 5.75% 25/10/2035	USD	274,268	273,267	0.01
FNMA, FRN, Series 2005-74 'SK' 6.001% 25/05/2035	USD	18,869	18,935	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2008-10 'XI' 1.092% 25/03/2038	USD	19,223	1,491	0.00
FNMA, FRN, Series 2007-85 'SL' 3.305% 25/09/2037	USD	9,986	9,601	0.00	FNMA, Series 2005-84 'XM' 5.75% 25/10/2035	USD	18,875	18,806	0.00
FNMA, FRN, Series 2008-18 'SP' 3.724% 25/03/2038	USD	11,810	10,322	0.00	FNMA, IO, FRN, Series 2007-92 'YS' 0.642% 25/06/2037	USD	99,906	9,082	0.00
FNMA, IO, FRN, Series 2009-112 'ST' 1.112% 25/01/2040	USD	68,546	5,211	0.00	FNMA, Series 1993-141 'Z' 7% 25/08/2023	USD	484	482	0.00
FNMA, FRN, Series 2005-75 'SV' 3.648% 25/09/2035	USD	28,153	26,986	0.00	FNMA, Series 1993-99 'Z' 7% 25/07/2023	USD	94	94	0.00
FNMA, FRN, Series 2004-74 'SW' 5.277% 25/11/2031	USD	16,908	17,491	0.00	FNMA, Series 1996-48 'Z' 7% 25/11/2026	USD	11,614	11,569	0.00
FNMA, FRN, Series 2003-52 'SX' 7.536% 25/10/2031	USD	3,851	4,152	0.00	FNMA, Series 2002-30 'Z' 6% 25/05/2032	USD	64,678	65,850	0.00
FNMA, PO, Series 2006-72 'TO' 0% 25/08/2036	USD	9,713	8,089	0.00	FNMA, Series 1998-44 'ZA' 6.5% 20/07/2028	USD	170,364	171,265	0.00
FNMA, FRN, Series 2005-56 'TP' 2.736% 25/08/2033	USD	10,287	9,784	0.00	FNMA, Series 2002-50 'ZA' 6% 25/05/2031	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 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, Series 2011-39 'ZA' 6% 25/11/2032	USD	187,024	189,107	0.00	FNMA, FRN 851432 4.365% 01/10/2035	USD	103,684	102,125	0.00
FNMA, Series 2011-47 'ZA' 5.5% 25/07/2038	USD	155,060	156,370	0.00	FNMA, FRN 872502 3.694% 01/06/2036	USD	28,197	28,565	0.00
FNMA, FRN, Series 1993-136 'ZB' 6% 25/07/2023	USD	112	110	0.00	FNMA, FRN 884066 3.811% 01/06/2036	USD	15,389	15,154	0.00
FNMA, Series 1998-36 'ZB' 6% 18/07/2028	USD	655	657	0.00	FNMA, FRN 886558 4.023% 01/08/2036	USD	15,583	15,465	0.00
FNMA, Series 2007-76 'ZG' 6% 25/08/2037	USD	59,629	59,539	0.00	FNMA 888408 6% 01/03/2037	USD	13,720	13,779	0.00
FNMA 252409 6.5% 01/03/2029	USD	1,882	1,892	0.00	FNMA, FRN 888605 4.513% 01/07/2035	USD	1,677	1,639	0.00
FNMA 257172 5.5% 01/04/2038	USD	10,686	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% 01/06/2037	USD	437,098	432,528	0.01
FNMA 257209 5.5% 01/05/2038	USD	14,448	14,505	0.00	FNMA, FRN 896463 4.32% 01/10/2034	USD	28,509	28,751	0.00
FNMA 468571 4.45% 01/07/2026	USD	799,835	789,991	0.02	FNMA 900177 7.5% 01/08/2036	USD	19,368	19,873	0.00
FNMA 650236 5% 01/12/2032	USD	1,102	1,096	0.00	FNMA, FRN 900197 4.325% 01/10/2036	USD	16,744	16,699	0.00
FNMA, FRN 722985 3.902% 01/07/2033	USD	3,853	3,802	0.00	FNMA, FRN 905694 4.077% 01/12/2036	USD	11,461	11,612	0.00
FNMA, FRN 735332 4.351% 01/08/2034	USD	13,808	13,693	0.00	FNMA, FRN 920843 4.784% 01/03/2036	USD	101,390	103,537	0.00
FNMA, FRN 745445 4.461% 01/01/2036	USD	30,968	31,327	0.00	FNMA, FRN 920954 5.343% 01/01/2037	USD	52,139	52,811	0.00
FNMA, FRN 745446 4.555% 01/04/2033	USD	9,469	9,492	0.00	FNMA 932355 6% 01/12/2039	USD	502,534	506,007	0.01
FNMA 754922 5.5% 01/09/2033	USD	5,374	5,345	0.00	FNMA 933032 6% 01/10/2037	USD	7,809	7,628	0.00
FNMA, FRN 766610 3.965% 01/01/2034	USD	3,069	2,987	0.00	FNMA 961192 7% 01/01/2038	USD	24,591	24,646	0.00
FNMA 771959 5.5% 01/02/2034	USD	13,761	13,606	0.00	FNMA, FRN 966946 4.285% 01/01/2038	USD	13,061	12,760	0.00
FNMA, FRN 777132 3.42% 01/06/2034	USD	45,412	45,855	0.00	FNMA 995783 8% 01/11/2037	USD	10,942	11,099	0.00
FNMA, FRN 781309 4.31% 01/07/2034	USD	10,859	10,728	0.00	FNMA AD7270 4.125% 01/07/2040	USD	117,549	112,726	0.00
FNMA, FRN 790235 3.86% 01/08/2034	USD	11,178	10,961	0.00	FNMA AD8548 5.5% 01/01/2033	USD	59,936	58,890	0.00
FNMA, FRN 791961 3.688% 01/09/2034	USD	6,299	6,149	0.00	FNMA AE0346 6% 01/05/2037	USD	52,428	52,635	0.00
FNMA, FRN 801342 3.855% 01/09/2034	USD	31,563	30,955	0.00	FNMA AE4168 4.25% 01/07/2040	USD	103,582	100,432	0.00
FNMA, FRN 810896 5.592% 01/01/2035	USD	19,317	19,564	0.00	FNMA AE4183 4.125% 01/09/2040	USD	92,243	89,442	0.00
FNMA, FRN 816597 4.045% 01/02/2035	USD	9,668	9,431	0.00	FNMA AL2606 4% 01/03/2042	USD	51,408	47,411	0.00
FNMA, FRN 823660 4.217% 01/05/2035	USD	17,170	16,762	0.00	FNMA AL6167 3.5% 01/01/2044	USD	1,300,114	1,206,565	0.03
FNMA, FRN 843026 5.96% 01/09/2035	USD	15,029	15,171	0.00	FNMA, FRN AL6805 3.81% 01/01/2026	USD	957,462	929,119	0.02
FNMA, FRN 843028 5.989% 01/09/2035	USD	9,771	9,901	0.00	FNMA AL7395 5.556% 01/03/2038	USD	1,599,785	1,628,754	0.03
FNMA 847108 6.5% 01/10/2035	USD	50,217	49,718	0.00	FNMA AM4660 3.765% 01/12/2025	USD	949,041	918,908	0.02
FNMA, FRN 849251 5.333% 01/01/2036	USD	41,001	40,471	0.00	FNMA AM5940 3.24% 01/06/2026	USD	833,833	795,167	0.02
					FNMA AM6448 3.25% 01/09/2026	USD	2,739,807	2,610,895	0.05
					FNMA AM7514 3.07% 01/02/2025	USD	6,000,000	5,773,079	0.12
					FNMA AM7649 2.885% 01/01/2025	USD	5,430,109	5,215,250	0.11
					FNMA AM7785 3.17% 01/02/2030	USD	1,806,425	1,676,089	0.03
					FNMA AM7836 3.11% 01/03/2027	USD	2,717,175	2,558,854	0.05
					FNMA AM8544 3.08% 01/04/2030	USD	1,807,658	1,666,886	0.03
					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 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 AM9188 3.12% 01/06/2035	USD	3,000,000	2,645,400	0.05	FNMA ACES, FRN 'PT' 3.239%	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	4,842,887	0.10	FNMA Grantor Trust, Series 2017-T1 '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	2.898% 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	1,255,992	0.03	01/06/2070				
FNMA AN1590 2.4% 01/05/2026	USD	2,561,449	2,389,877	0.05	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series				
FNMA AN2005 2.73% 01/07/2028	USD	1,893,325	1,735,825	0.04	2015-K44 'B', 144A 3.719%	USD	13,563,000	13,009,371	0.27
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	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	8,250,000	7,894,918	0.16
FNMA AN2370 2.44% 01/08/2026	USD	2,951,307	2,748,641	0.06	2015-K45 'B', 144A 3.61% 25/04/2048				
FNMA AN2388 2.64% 01/08/2028	USD	2,416,418	2,212,507	0.05	FREMF Mortgage Trust, FRN 'B', 144A	USD	2,825,000	2,683,362	0.06
FNMA AN2429 2.45% 01/12/2026	USD	3,662,320	3,389,279	0.07	3.587% 25/06/2048				
FNMA AN2444 2.43% 01/08/2026	USD	6,285,284	5,851,077	0.12	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series				
FNMA AN2487 2.86% 01/08/2028	USD	895,300	828,034	0.02	2015-K48 'B', 144A 3.646%	USD	14,935,000	14,254,012	0.29
FNMA AN2906 2.63% 01/10/2031	USD	5,393,632	4,759,223	0.10	25/08/2048				
FNMA AN3134 2.58% 01/10/2028	USD	1,648,720	1,503,752	0.03	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series				
FNMA AN3254 2.8% 01/11/2031	USD	1,553,431	1,411,802	0.03	2015-K49 'B', 144A 3.725%	USD	1,665,000	1,588,411	0.03
FNMA AN3364 2.6% 01/10/2028	USD	4,800,601	4,382,186	0.09	25/10/2048				
FNMA AN3431 2.6% 01/11/2028	USD	3,964,622	3,616,011	0.07	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	7,149,000	6,829,445	0.14
FNMA AN3565 2.94% 01/12/2028	USD	8,646,348	7,944,868	0.16	2015-K51 'B', 144A 3.951% 25/10/2048				
FNMA AN3685 2.69% 01/12/2028	USD	9,548,000	8,679,509	0.18	FREMF Mortgage Trust, FRN 'B', 144A	USD	6,830,000	6,505,756	0.13
FNMA AN3788 2.79% 01/02/2027	USD	2,016,322	1,883,638	0.04	4.053% 25/04/2048				
FNMA AN3881 2.94% 01/12/2026	USD	3,488,547	3,280,763	0.07	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series				
FNMA AN4110 2.95% 01/04/2025	USD	4,920,255	4,705,725	0.10	2016-K55 'B', 144A 4.167%	USD	18,226,000	17,341,520	0.36
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	FREMF Mortgage Trust, FRN 'B', 144A	USD	3,500,000	3,299,539	0.07
FNMA AN5935 3.13% 01/07/2027	USD	1,029,522	976,105	0.02	3.918% 25/08/2049				
FNMA ANG244 3.09% 01/09/2029	USD	7,788,000	7,141,333	0.15	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series				
FNMA A09352 4% 01/07/2042	USD	216,035	206,865	0.00	2016-K58 'B', 144A 3.738%	USD	8,401,442	7,876,914	0.16
FNMA A09999 3% 01/02/2043	USD	926,386	837,497	0.02	25/09/2049				
FNMA ASF712 3.5% 01/04/2036	USD	943,780	882,874	0.02	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	6,179,000	5,757,042	0.12
FNMA BF0464 3.5% 01/03/2060	USD	6,819,276	6,203,812	0.13	2016-K59 'B', 144A 3.58% 25/11/2049				
FNMA BL2595 3.34% 01/07/2028	USD	2,882,002	2,719,631	0.06	FREMF Mortgage Trust, FRN 'B', 144A	USD	3,050,000	2,835,644	0.06
FNMA BL2905 3.07% 01/08/2031	USD	6,208,000	5,541,831	0.11	3.88% 25/01/2050				
FNMA BL3616 2.88% 01/07/2028	USD	11,266,455	10,406,695	0.21	FREMF 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	2017-K70 'B', 144A 3.809%				
FNMA BL4118 2.42% 01/09/2028	USD	4,601,873	4,154,864	0.09	25/12/2049				
FNMA BL4398 2.59% 01/10/2031	USD	1,800,000	1,557,146	0.03	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	6,606,000	6,477,522	0.13
FNMA BL4411 2.47% 01/10/2031	USD	5,445,801	4,696,839	0.10	2017-K725 'B', 144A 3.904%				
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	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series	USD	6,000,000	5,800,860	0.12
FNMA MA2592 3.5% 01/04/2046	USD	1,674,531	1,557,155	0.03	2017-K728 'B', 144A 3.651%				
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	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series				
FNMA ACES, FRN 'A2' 1.532% 25/09/2031	USD	10,000,000	8,018,704	0.17	2017-K729 'B', 144A 3.673%	USD	11,768,052	11,331,305	0.23
					25/11/2049				

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 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(%)
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2018-K157 'B', 144A 4.299% 25/08/2033	USD	5,150,000	4,471,204	0.09	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2016-K54 'C', 144A 4.053% 25/04/2048	USD	3,000,000	2,837,168	0.06
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2018-K72 'B', 144A 3.994% 25/12/2050	USD	1,933,000	1,785,533	0.04	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2017-K62 'C', 144A 3.88% 25/01/2050	USD	8,016,355	7,342,338	0.15
FREMF Mortgage Trust, FRN 'B', 144A 3.854% 25/02/2051	USD	1,515,000	1,395,811	0.03	FREMF Mortgage Trust, FRN 'C', 144A 3.878% 25/02/2050	USD	1,700,000	1,572,263	0.03
FREMF Mortgage Trust, FRN 'B', 144A 3.795% 25/02/2050	USD	10,000,000	9,598,332	0.20	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2017-K724 'C', 144A 3.486% 25/12/2049	USD	6,325,000	6,224,944	0.13
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2018-K732 'B', 144A 4.051% 25/05/2025	USD	4,910,000	4,704,408	0.10	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2017-K725 'C', 144A 3.904% 25/02/2050	USD	2,255,000	2,205,511	0.05
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2018-K74 'B', 144A 4.094% 25/02/2051	USD	5,660,000	5,182,796	0.11	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2017-K726 'C', 144A 4.009% 25/07/2049	USD	8,409,000	8,199,222	0.17
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2018-K75 'B', 144A 3.977% 25/04/2051	USD	3,000,000	2,764,778	0.06	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2017-K728 'C', 144A 3.651% 25/11/2050	USD	5,540,000	5,323,974	0.11
FREMF Mortgage Trust, FRN 'B', 144A 4.208% 25/06/2051	USD	2,500,000	2,307,001	0.05	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2018-K731 'C', 144A 3.938% 25/02/2025	USD	14,725,000	14,097,884	0.29
FREMF Mortgage Trust, FRN 'B', 144A 4.21% 25/07/2051	USD	3,040,000	2,838,788	0.06	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2018-K733 'C', 144A 4.084% 25/09/2025	USD	2,083,000	1,977,497	0.04
FREMF Mortgage Trust, FRN 'B', 144A 4.173% 25/09/2051	USD	6,526,000	6,046,890	0.12	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2018-K76 'C', 144A 4.208% 25/06/2051	USD	4,061,000	3,736,680	0.08
FREMF Mortgage Trust, FRN 'B', 144A 4.186% 25/10/2028	USD	12,000,000	11,107,528	0.23	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2018-K78 'C', 144A 4.127% 25/06/2051	USD	7,058,000	6,461,279	0.13
FREMF Mortgage Trust, FRN 'B', 144A 4.294% 25/11/2051	USD	2,000,000	1,869,184	0.04	FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2018-KSL1 'C', 144A 3.856% 25/11/2025	USD	8,000,000	7,128,272	0.15
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2018-KF52 'B', 144A 3.856% 25/11/2025	USD	10,000,000	9,186,611	0.19	FREMF Trust, FRN, Series 2018-KW04 'B', 144A 3.925% 25/09/2028	USD	6,775,000	5,776,822	0.12
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2018-KW07 'B', 144A 4.084% 25/10/2031	USD	5,516,000	4,560,641	0.09	General Motors Financial Co., Inc., FRN 6.292% 17/11/2023	USD	2,930,000	2,932,301	0.06
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2017-KGL1 'BFL', 144A 7.562% 25/10/2027	USD	5,252,052	4,969,582	0.10	Gilead Sciences, Inc. 2.6% 01/10/2040	USD	3,070,000	2,206,449	0.05
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2017-KGX1 'BFX', 144A 3.595% 25/10/2027	USD	5,000,000	4,473,551	0.09	Glencore Funding LLC, 144A 4.625% 29/04/2024	USD	700,000	691,839	0.01
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2014-K39 'C', 144A 4.156% 25/08/2047	USD	2,500,000	2,431,335	0.05	Glencore Funding LLC, 144A 2.5% 01/09/2030	USD	5,585,000	4,560,757	0.09
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2014-K40 'C', 144A 4.075% 25/11/2047	USD	3,521,000	3,401,516	0.07	GMACM Mortgage Loan Trust, FRN, Series 2005-AR3 '3A4' 3.605% 19/06/2035	USD	33,750	31,569	0.00
FREMF Mortgage Trust, FRN, Series 2015-K45 'C', 144A 3.61% 25/04/2048	USD	8,598,000	8,204,869	0.17	GNMA, 10, FRN, Series 2019-H17 1.672% 20/11/2069	USD	15,005,344	612,173	0.01
					GNMA 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 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 (%)
GNMA 2.5% 20/10/2051	USD	11,863,605	10,244,523	0.21	GNMA, Series 2005-72 'AZ' 5.5%	USD	284,973	284,146	0.01
GNMA 5% 20/06/2052	USD	2,733,598	2,682,034	0.06	20/09/2035				
GNMA 5% 20/07/2052	USD	1,280,152	1,267,056	0.03	GNMA, FRN, Series 2013-H08 'BF'	USD	649,279	641,260	0.01
GNMA 5% 20/07/2052	USD	1,278,066	1,275,263	0.03	5.258% 20/03/2063				
GNMA 5% 20/07/2052	USD	3,934,519	3,914,996	0.08	GNMA, PO, Series 2010-14 'B0' 0%	USD	62,726	51,250	0.00
GNMA 5% 20/07/2052	USD	5,181,312	5,115,515	0.11	20/11/2035				
GNMA 4% 20/08/2052	USD	17,907,814	16,903,938	0.35	GNMA, FRN, Series 2012-H21 'CF'	USD	4,424	4,361	0.00
GNMA 4.5% 20/09/2052	USD	2,243,616	2,161,678	0.04	4.871% 20/05/2061				
GNMA 4.5% 20/10/2052	USD	3,373,046	3,205,561	0.07	GNMA, FRN 'CF' 6.086% 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	20/08/2035				
GNMA 5.5% 20/10/2052	USD	1,565,859	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, FRN, Series 2012-H21 'DF'	USD	7,889	7,775	0.00
GNMA 5.5% 20/01/2053	USD	5,504,045	5,477,383	0.11	4.871% 20/05/2061				
GNMA 6% 20/01/2053	USD	1,048,064	1,068,750	0.02	GNMA, FRN, Series 2017-H09 'DF'	USD	3,062,928	3,038,988	0.06
GNMA 6% 20/01/2053	USD	2,143,699	2,161,222	0.04	5.654% 20/03/2067				
GNMA 6% 20/02/2053	USD	3,396,033	3,423,792	0.07	GNMA, IO, FRN, Series 2020-H05 'DI'	USD	19,201,265	1,155,625	0.02
GNMA 6% 20/05/2053	USD	1,068,343	1,082,418	0.02	2.674% 20/01/2070				
GNMA 6% 20/05/2053	USD	3,183,149	3,221,105	0.07	GNMA, FRN, Series 2005-68 'DP'	USD	38,075	37,823	0.00
GNMA 6.5% 20/05/2053	USD	1,802,458	1,845,396	0.04	4.004% 17/06/2035				
GNMA 5.5% 20/06/2053	USD	2,621,409	2,634,925	0.05	GNMA, IO, FRN, Series 2008-95 'DS'	USD	119,725	3,960	0.00
GNMA 5.5% 20/06/2053	USD	3,840,036	3,859,835	0.08	2.154% 20/12/2038				
GNMA 5.5% 20/06/2053	USD	12,500,000	12,564,448	0.26	GNMA, IO, FRN, Series 2007-53 'ES'	USD	93,390	10,160	0.00
GNMA 6% 20/06/2053	USD	2,235,169	2,250,645	0.05	1.393% 20/09/2037				
GNMA 6.5% 20/06/2053	USD	2,110,367	2,146,792	0.04	GNMA, FRN, Series 2015-H07 'ES'	USD	751,645	745,593	0.02
GNMA, FRN 6.981% 20/03/2072	USD	6,442,334	6,694,487	0.14	5.328% 20/02/2065				
GNMA, FRN 6.72% 20/04/2072	USD	8,389,945	8,621,191	0.18	GNMA, FRN, Series 2016-H23 'F'	USD	2,148,977	2,140,975	0.04
GNMA, FRN 6.76% 20/04/2072	USD	7,766,343	7,990,268	0.16	5.844% 20/10/2066				
GNMA, FRN 6.68% 20/05/2072	USD	6,916,817	7,095,280	0.15	GNMA, FRN, Series 2012-H10 'FA'	USD	690,321	686,827	0.01
GNMA, FRN 6.845% 20/07/2072	USD	8,370,124	8,688,004	0.18	5.644% 20/12/2061				
GNMA, Series 2019-44 'A' 3.5% 20/04/2049	USD	3,219,315	2,995,895	0.06	GNMA, FRN, Series 2012-H15 'FA' 5.5% 20/05/2062	USD	26	25	0.00
GNMA, Series 2009-104 'AB' 7% 16/08/2039	USD	21,594	21,537	0.00	GNMA, FRN, Series 2012-H24 'FA' 5.5% 20/03/2060	USD	17,259	16,908	0.00
GNMA, FRN, Series 2011-H09 'AF' 5.594% 20/03/2061	USD	313,891	312,163	0.01	GNMA, FRN, Series 2012-H28 'FA' 4.973% 20/09/2062	USD	5,293	5,222	0.00
GNMA, PO, Series 2006-22 'AO' 0% 20/05/2036	USD	25,412	23,029	0.00	GNMA, FRN, Series 2012-H29 'FA' 5.609% 20/10/2062	USD	542,860	539,872	0.01
GNMA, PO, Series 2007-38 'AO' 0% 16/06/2037	USD	347,991	319,963	0.01	GNMA, Series 2013-H01 'FA' 1.65% 20/01/2063	USD	1,112	989	0.00
GNMA, IO, FRN, Series 2008-93 'AS' 0.554% 20/12/2038	USD	54,786	4,198	0.00	GNMA, FRN, Series 2013-H03 'FA' 5.394% 20/08/2060	USD	572	566	0.00
GNMA, IO, FRN, Series 2009-106 'AS' 1.242% 16/11/2039	USD	140,364	9,912	0.00	GNMA, FRN, Series 2015-H06 'FA' 5.574% 20/02/2065	USD	795,418	789,565	0.02
GNMA, FRN, Series 2010-129 'AW' 5.906% 20/04/2037	USD	122,603	123,706	0.00	GNMA, FRN, Series 2015-H12 'FA' 5.574% 20/05/2065	USD	2,264,735	2,248,723	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	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 (%)
GMA, FRN, Series 2015-H23 'FB' 5.614% 20/09/2065	USD	1,130,291	1,122,151	0.02	GMA, FRN, Series 2013-H01 'JA' 5.414% 20/01/2063	USD	344,519	340,914	0.01
GMA, FRN, Series 2014-H17 'FC' 5.594% 20/07/2064	USD	327,269	325,882	0.01	GMA, FRN 'JF' 5.544% 20/07/2071	USD	5,554,278	5,631,738	0.12
GMA, FRN, Series 2015-H05 'FC' 5.574% 20/02/2065	USD	1,428,402	1,412,270	0.03	GMA, IO, FRN, Series 2007-17 'JI' 1.652% 16/04/2037	USD	98,086	7,717	0.00
GMA, FRN, Series 2015-H08 'FC' 5.574% 20/03/2065	USD	2,684,663	2,666,348	0.06	GMA, FRN, Series 2005-7 'JM' 5.372% 18/05/2034	USD	352	346	0.00
GMA, FRN, Series 2015-H10 'FC' 5.574% 20/04/2065	USD	1,471,986	1,466,406	0.03	GMA, IO, FRN, Series 2005-68 'KI' 1.143% 20/09/2035	USD	168,552	12,224	0.00
GMA, FRN, Series 2016-H26 'FC' 6.094% 20/12/2066	USD	1,133,711	1,130,470	0.02	GMA, Series 2003-70 'LG' 5% 20/08/2033	USD	357,030	350,314	0.01
GMA, FRN, Series 2012-H31 'FD' 5.434% 20/12/2062	USD	688,086	682,088	0.01	GMA, FRN, Series 2012-H26 'MA' 4.879% 20/07/2062	USD	2,941	2,893	0.00
GMA, FRN, Series 2016-H11 'FD' 4.869% 20/05/2066	USD	980,871	970,655	0.02	GMA, IO, FRN, Series 2007-73 'MI' 0.843% 20/11/2037	USD	109,293	1,695	0.00
GMA, FRN, Series 2010-H22 'FE' 5.444% 20/05/2059	USD	37,794	37,440	0.00	GMA 'MT' 4.5% 20/04/2053	USD	4,970,549	4,815,659	0.10
GMA, FRN, Series 2012-H24 'FG' 5.524% 20/04/2060	USD	9,856	9,680	0.00	GMA, IO, Series 2009-14 'NI' 6.5% 20/03/2039	USD	38,744	4,175	0.00
GMA, FRN, Series 2015-H26 'FG' 5.614% 20/10/2065	USD	744,789	736,362	0.02	GMA, FRN, Series 2007-16 'NS' 5.263% 20/04/2037	USD	47,593	49,295	0.00
GMA, FRN, Series 2015-H32 'FH' 5.754% 20/12/2065	USD	796,405	792,574	0.02	GMA, PO, Series 2009-79 'OK' 0% 16/11/2037	USD	46,381	39,420	0.00
GMA, FRN, Series 2016-H21 'FH' 4.989% 20/09/2066	USD	4,462,191	4,432,933	0.09	GMA, PO, Series 2010-157 'OP' 0% 20/12/2040	USD	93,322	77,806	0.00
GMA, FRN, Series 2015-H15 'FJ' 5.534% 20/06/2065	USD	994,170	986,304	0.02	GMA, FRN, Series 2012-138 'PT' 3.986% 16/11/2042	USD	288,554	274,894	0.01
GMA, FRN, Series 2020-H05 'FK' 4.157% 20/03/2070	USD	4,685,745	4,576,860	0.09	GMA, FRN, Series 2020-30 'PT' 4.769% 20/03/2048	USD	5,352,566	5,250,048	0.11
GMA, FRN, Series 2015-H16 'FL' 5.534% 20/07/2065	USD	1,613,616	1,600,293	0.03	GMA, Series 2006-57 'PZ' 5.565% 20/10/2036	USD	457,738	453,551	0.01
GMA, FRN, Series 2016-H07 'FQ' 5.794% 20/03/2066	USD	2,175,634	2,166,469	0.04	GMA, IO, FRN, Series 2006-65 'SA' 1.643% 20/11/2036	USD	61,782	735	0.00
GMA, FRN, Series 2012-H08 'FS' 5.794% 20/04/2062	USD	546,681	544,433	0.01	GMA, IO, FRN, Series 2007-27 'SA' 1.054% 20/05/2037	USD	62,013	2,000	0.00
GMA, FRN, Series 2017-H14 'FV' 5.594% 20/06/2067	USD	3,159,212	3,133,544	0.06	GMA, IO, FRN, Series 2007-76 'SA' 1.384% 20/11/2037	USD	53,897	1,332	0.00
GMA, IO, FRN, Series 2020-H10 'GI' 0% 20/06/2070	USD	23,868,424	985,479	0.02	GMA, IO, FRN, Series 2008-40 'SA' 1.242% 16/05/2038	USD	49,967	2,501	0.00
GMA, Series 2017-112 'GZ' 3% 20/07/2047	USD	2,595,573	2,023,385	0.04	GMA, IO, FRN, Series 2009-10 'SA' 0.804% 20/02/2039	USD	81,181	3,145	0.00
GMA, FRN, Series 2013-H07 'HA' 5.504% 20/03/2063	USD	264,633	262,471	0.01	GMA, IO, FRN, Series 2009-22 'SA' 1.124% 20/04/2039	USD	97,023	4,208	0.00
GMA, IO, Series 2020-134 'IH' 3% 20/09/2050	USD	5,688,412	777,058	0.02	GMA, IO, FRN, Series 2009-6 'SA' 0.942% 16/02/2039	USD	33,104	15	0.00
GMA, FRN, Series 2012-H26 'JA' 3.941% 20/10/2061	USD	2,808	2,756	0.00	GMA, IO, FRN, Series 2007-40 'SB' 1.604% 20/07/2037	USD	82,872	3,624	0.00
					GMA, IO, FRN, 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 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 (%)
GNMA, 10, FRN, Series 2007-81 'SB' 1.504% 20/12/2037	USD	138,100	16,739	0.00	GNMA, FRN, Series 2012-H23 'WA' 5.614% 20/10/2062	USD	194,072	192,842	0.00
GNMA, 10, FRN, Series 2009-42 'SC' 0.934% 20/06/2039	USD	82,712	7,261	0.00	GNMA, FRN, Series 2012-141 'WC' 3.714% 20/01/2042	USD	436,376	411,522	0.01
GNMA, 10, FRN, Series 2006-59 'SD' 1.543% 20/10/2036	USD	60,576	5,432	0.00	GNMA, FRN, Series 2015-151 'WX' 4.749% 20/10/2043	USD	704,935	693,379	0.01
GNMA, 10, FRN, Series 2007-76 'SD' 0.654% 20/11/2037	USD	142,602	9,837	0.00	GNMA, 10, FRN, Series 2017-H14 'XI' 1.253% 20/06/2067	USD	5,890,563	224,906	0.00
GNMA, FRN, Series 2003-67 'SD' 5.266% 20/08/2033	USD	34,414	34,032	0.00	GNMA, FRN, Series 2010-H17 'XQ' 5.14% 20/07/2060	USD	2,085	1,674	0.00
GNMA, 10, FRN, Series 2007-36 'SE' 1.312% 16/06/2037	USD	28,860	755	0.00	GNMA, Series 2006-33 'Z' 6.5% 20/07/2036	USD	306,985	313,622	0.01
GNMA, 10, FRN, Series 2004-90 'SI' 0.954% 20/10/2034	USD	120,837	4,926	0.00	GNMA, Series 2003-75 'ZX' 6% 16/09/2033	USD	662,884	661,371	0.01
GNMA, 10, FRN, Series 2007-67 'SI' 1.353% 20/11/2037	USD	57,041	1,487	0.00	GNMA 4285 6% 20/11/2038	USD	7,872	7,968	0.00
GNMA, 10, FRN, Series 2007-74 'SL' 1.382% 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, FRN, Series 2007-40 'SN' 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, FRN, Series 2009-64 'SN' 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, FRN, Series 2005-66 'SP' 3.64% 16/08/2035	USD	31,764	30,264	0.00	GNMA 591882 6.5% 15/07/2032	USD	2,570	2,619	0.00
GNMA, FRN, Series 2007-53 'SW' 4.735% 20/09/2037	USD	20,016	20,158	0.00	GNMA 607645 6.5% 15/02/2033	USD	2,678	2,729	0.00
GNMA, 10, FRN, Series 2007-79 'SY' 1.393% 20/12/2037	USD	72,823	1,827	0.00	GNMA 607728 6% 15/03/2033	USD	952	964	0.00
GNMA, FRN, Series 2013-H01 'TA' 4.694% 20/01/2063	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 'TI' 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, FRN, Series 2009-31 'TS' 1.143% 20/03/2039	USD	53,845	531	0.00	GNMA 742051 4.25% 20/07/2040	USD	523,446	501,798	0.01
GNMA, FRN, Series 2004-94 'TS' 4.244% 20/10/2034	USD	48,642	45,323	0.00	GNMA 742052 4.4% 20/06/2040	USD	274,635	261,550	0.01
GNMA, 10, FRN, Series 2008-76 'US' 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 'UZ' 3.5% 20/10/2048	USD	1,452,602	1,303,657	0.03	GNMA 742155 4.25% 20/07/2040	USD	675,931	641,973	0.01
GNMA, FRN, Series 2014-168 'VB' 3.435% 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, FRN, Series 2015-137 'W' 5.442% 20/10/2040	USD	656,614	663,505	0.01	GNMA 742196 4.4% 20/07/2040	USD	186,883	179,106	0.00
GNMA, FRN, Series 2011-137 'WA' 5.592% 20/07/2040	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, FRN, Series 2011-163 'WA' 5.885% 20/12/2038	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 748766 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	675,008	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	482,938	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 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 (%)
Hyundai Capital America, 144A 5.8% 26/06/2025	USD	12,200,000	12,174,019	0.25	JB Hunt Transport Services, Inc. 3.85% 15/03/2024	USD	1,200,000	1,177,325	0.02
Hyundai Capital America, 144A 1.8% 15/10/2025	USD	1,340,000	1,222,338	0.03	JB Hunt Transport Services, Inc. 3.875% 01/03/2026	USD	860,000	829,973	0.02
Hyundai Capital America, 144A 1.3% 08/01/2026	USD	1,005,000	899,118	0.02	Jersey Central Power & Light Co., 144A 4.3% 15/01/2026	USD	460,000	444,646	0.01
Hyundai Capital America, 144A 1.5% 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. 3.43% 15/06/2027	USD	450,000	424,237	0.01
Hyundai Capital America, 144A 3% 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 2.375% 15/10/2027	USD	1,330,000	1,160,425	0.02	KeyCorp, FRN 4.789% 01/06/2033	USD	400,000	334,748	0.01
Hyundai Capital America, 144A 1.8% 10/01/2028	USD	1,940,000	1,635,486	0.03	KeySpan Gas East Corp., 144A 2.742% 15/08/2026	USD	448,000	406,989	0.01
Impac Secured Assets CMV Owner Trust, Series 2003-2 'A1' 5.5% 25/08/2033	USD	22,339	18,643	0.00	KLA Corp. 3.3% 01/03/2050	USD	1,000,000	744,773	0.02
Independence Plaza Trust, Series 2018-INDP 'A', 144A 3.763% 10/07/2035	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 INDX Mortgage Loan Trust, FRN, Series 2004-AR7 'A1' 5.59% 25/09/2034	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	Lehman Mortgage Trust, Series 2008-2 '1A6' 6% 25/03/2038	USD	215,010	76,352	0.00
Intel Corp. 5.7% 10/02/2053	USD	1,475,000	1,484,633	0.03	Liberty Mutual Group, Inc., 144A 4.569% 01/02/2029	USD	258,000	243,354	0.01
International Flavors & Fragrances, Inc., 144A 1.832% 15/10/2027	USD	1,995,000	1,680,274	0.03	Liberty Mutual Group, Inc., 144A 3.951% 15/10/2050	USD	1,120,000	809,325	0.02
International Flavors & Fragrances, Inc., 144A 2.3% 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 3.268% 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 4.004% 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	MassMutual Global Funding II, 144A 2.75% 22/06/2024	USD	1,000,000	972,643	0.02
J.P. Morgan Mortgage Trust, FRN, Series 2004-A4 'IA1' 3.938% 25/09/2034	USD	3,941	3,655	0.00	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust, FRN, Series 2004-13 '2A1' 4.578% 21/04/2034	USD	42,425	40,475	0.00
J.P. Morgan Mortgage Trust, FRN, Series 2004-A3 '4A1' 4.546% 25/07/2034	USD	1,424	1,392	0.00	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust, FRN, Series 2004-13 '3A7' 4.142% 21/11/2034	USD	127,147	120,240	0.00
J.P. Morgan Mortgage Trust, FRN, Series 2006-A2 '4A1' 4.157% 25/08/2034	USD	17,234	17,258	0.00	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust, FRN, Series 2004-3 '4A2' 3.462% 25/04/2034	USD	6,705	5,981	0.00
J.P. Morgan Mortgage Trust, FRN, Series 2006-A2 '5A3' 4.194% 25/11/2033	USD	31,578	30,538	0.00	MASTR Alternative Loan Trust, Series 2004-4 '10A1' 5% 25/05/2024	USD	4,130	3,941	0.00
					MASTR Alternative Loan Trust 'IA1' 4.5% 25/09/2052	USD	347	327	0.00
					MASTR Alternative Loan Trust, Series 2004-4 'IA1' 5.5% 25/05/2034	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	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 (%)
MSTR Alternative Loan Trust, Series 2005-6 '3A1' 5.5% 25/12/2035	USD	14,254	11,405	0.00	Microchip Technology, Inc. 0.983% 01/09/2024	USD	620,000	585,717	0.01
MSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-6 '7A1' 6% 25/07/2034	USD	25,052	23,838	0.00	Microsoft Corp. 3.5% 12/02/2035	USD	1,907,000	1,777,875	0.04
MSTR Alternative Loan Trust, Series 2004-4 '9A1' 5.5% 31/12/2049	USD	53,043	49,456	0.00	Microsoft Corp. 3.041% 17/03/2062	USD	536,000	386,988	0.01
MSTR Asset Securitization Trust, Series 2004-1 '1A6' 5.25% 26/12/2033	USD	26,223	24,357	0.00	Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC, 144A 4.1% 15/05/2028	USD	410,000	387,403	0.01
MSTR Reperforming Loan Trust, FRN, Series 2005-2 '1A1F', 144A 5.488% 25/05/2035	USD	276,999	147,962	0.00	Morgan Stanley, FRN 2.188% 28/04/2026	USD	2,000,000	1,877,346	0.04
MSTR Seasoned Securitization Trust, FRN, Series 2004-2 'A1' 6.5% 25/08/2032	USD	26,694	25,424	0.00	Morgan Stanley, FRN 2.475% 21/01/2028	USD	264,000	238,156	0.01
MSTR Seasoned Securitization Trust, FRN, Series 2004-2 'A2' 6.5% 25/08/2032	USD	86,310	82,531	0.00	Morgan Stanley, FRN 5.123% 01/02/2029	USD	1,710,000	1,684,420	0.04
Mead Johnson Nutrition Co. 4.125% 15/11/2025	USD	502,000	489,695	0.01	Morgan Stanley, FRN 5.164% 20/04/2029	USD	3,860,000	3,802,528	0.08
Mead Johnson Nutrition Co. 5.9% 01/11/2039	USD	50,000	52,482	0.00	Morgan Stanley, FRN 3.971% 22/07/2038	USD	1,000,000	848,693	0.02
Mead Johnson Nutrition Co. 4.6% 01/06/2044	USD	500,000	449,882	0.01	Morgan Stanley, FRN 3.217% 22/04/2042	USD	2,000,000	1,506,447	0.03
Memorial Health Services 3.447% 01/11/2049	USD	2,440,000	1,780,885	0.04	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, FRN, Series 2004-3 '4A' 5.651% 25/04/2034	USD	91,429	88,787	0.00
Memorial Sloan-Kettering Cancer Center 4.2% 01/07/2055	USD	334,000	281,713	0.01	Mount Sinai Hospitals Group, Inc. 3.981% 01/07/2048	USD	366,000	290,537	0.01
Mercedes-Benz Finance North America LLC, 144A 3.3% 19/05/2025	USD	355,000	341,371	0.01	MultiCare Health System 2.803% 15/08/2050	USD	1,115,000	672,814	0.01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust, FRN, Series 2003-A4 '2A' 5.311% 25/07/2033	USD	16,846	15,724	0.00	Mylan, Inc. 5.4% 29/11/2043	USD	1,265,000	1,051,700	0.02
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust, FRN, Series 2004-1 '2A1' 3.878% 25/12/2034	USD	74,588	70,024	0.00	Mylan, Inc. 5.2% 15/04/2048	USD	1,500,000	1,160,436	0.02
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust, FRN, Series 2004-A4 'A2' 3.99% 25/08/2034	USD	35,945	33,398	0.00	MyMichigan Health 3.409% 01/06/2050	USD	780,000	555,607	0.01
Met Tower Global Funding, 144A 5.4% 20/06/2026	USD	8,000,000	7,956,924	0.16	Nasdaq, Inc. 5.35% 28/06/2028	USD	4,920,000	4,927,767	0.10
Meta Platforms, Inc. 5.6% 15/05/2053	USD	3,000,000	3,061,083	0.06	Nasdaq, Inc. 5.55% 15/02/2034	USD	1,095,000	1,096,410	0.02
Metropolitan Life Global Funding I, 144A 3% 19/09/2027	USD	1,100,000	1,004,862	0.02	Nationwide Children's Hospital, Inc. 4.556% 01/11/2052	USD	451,000	414,767	0.01
Microchip Technology, Inc. 2.67% 01/09/2023	USD	725,000	722,051	0.02	New York and Presbyterian Hospital (The) 2.606% 01/08/2060	USD	1,330,000	788,958	0.02
Microchip Technology, Inc. 0.972% 15/02/2024	USD	826,000	800,390	0.02	New York Life Global Funding, 144A 2.35% 14/07/2026	USD	503,000	462,055	0.01
					New York Life Insurance Co., 144A 4.45% 15/05/2069	USD	1,040,000	860,927	0.02
					New York State Dormitory Authority 5.6% 15/03/2040	USD	175,000	184,821	0.00
					NGPL PipeCo LLC, 144A 3.25% 15/07/2031	USD	1,755,000	1,445,197	0.03
					Niagara Mohawk Power Corp., 144A 1.96% 27/06/2030	USD	2,250,000	1,795,874	0.04
					Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2003-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 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(%)
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2003-A1 'A2' 6% 25/05/2033	USD	823	800	0.00	Pacific Gas and Electric Co. 3.45% 01/07/2025	USD	1,535,000	1,449,732	0.03
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2003-A1 'A5' 7% 25/04/2033	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. 5.59% 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	1,273,000	1,039,629	0.02	Pacific Life Global Funding II, 144A 1.2% 24/06/2025	USD	1,560,000	1,422,529	0.03
Northern States Power Co. 5.1% 15/05/2053	USD	1,690,000	1,646,315	0.03	Pacific Life Insurance Co., FRN, 144A 4.3% 24/10/2067	USD	627,000	477,972	0.01
Northern Trust Corp., FRN 3.375% 08/05/2032	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 1.7% 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
NRG Energy, Inc., 144A 2% 02/12/2025	USD	1,770,000	1,588,042	0.03	PECO Energy Co. 2.8% 15/06/2050	USD	900,000	590,710	0.01
NRG Energy, Inc., 144A 2.45% 02/12/2027	USD	1,975,000	1,662,819	0.03	Pennsylvania Electric Co., 144A 3.25% 15/03/2028	USD	75,000	67,999	0.00
NRG Energy, Inc., 144A 4.45% 15/06/2029	USD	1,080,000	951,911	0.02	Penske Truck Leasing Co. LP, 144A 5.75% 24/05/2026	USD	11,500,000	11,389,499	0.24
NRZ Excess Spread-Collateralized Notes, Series 2021-FNT2 'A', 144A 3.228% 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
NRZ Excess Spread-Collateralized Notes 'A', 144A 3.474% 25/11/2026	USD	5,468,234	4,915,120	0.10	Pepco Holdings LLC 7.45% 15/08/2032	USD	174,000	189,379	0.00
Nucor Corp. 2.979% 15/12/2055	USD	1,470,000	930,838	0.02	Pepperdine University 3.301% 01/12/2059	USD	1,170,000	816,773	0.02
NYU Langone Hospitals 3.38% 01/07/2055	USD	1,010,000	717,168	0.02	PG&E Wildfire Recovery Funding LLC 4.263% 01/06/2038	USD	815,000	773,972	0.02
Ohio Power Co. 6.6% 01/03/2033	USD	240,000	258,415	0.01	Phillips 66 Co. 3.605% 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. 3.55% 01/10/2026	USD	147,000	137,885	0.00
Ohio State University (The) 4.048% 01/12/2056	USD	325,000	270,068	0.01	Phillips 66 Co. 3.15% 15/12/2029	USD	1,130,000	986,101	0.02
Oncor Electric Delivery Co. LLC 5.75% 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
Oncor Electric Delivery Co. LLC 3.1% 15/09/2049	USD	1,990,000	1,396,481	0.03	Physicians Realty LP, REIT 2.625% 01/11/2031	USD	1,050,000	816,008	0.02
Oncor Electric Delivery Co. LLC 5.35% 01/10/2052	USD	295,000	297,932	0.01	Piedmont Natural Gas Co., Inc. 3.5% 01/06/2029	USD	1,550,000	1,404,603	0.03
Orange Lake Timeshare Trust 'B', 144A 3.35% 08/11/2030	USD	825,926	811,107	0.02	Plains All American Pipeline LP 3.85% 15/10/2023	USD	2,770,000	2,754,914	0.06
O'Reilly Automotive, Inc. 3.6% 01/09/2027	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. 2.056% 05/04/2025	USD	2,000,000	1,885,061	0.04	PNC Financial Services Group, Inc. (The), FRN 5.068% 24/01/2034	USD	2,879,000	2,755,125	0.06
Otis Worldwide Corp. 2.565% 15/02/2030	USD	2,750,000	2,367,931	0.05	Port Authority of New York & New Jersey 5.647% 01/11/2040	USD	285,000	306,374	0.01
					Port Authority of New York & New Jersey 5.647% 01/11/2040	USD	650,000	698,749	0.01
					Port Authority of New York & New Jersey 4.458% 01/10/2062	USD	1,330,000	1,206,065	0.03
					Potomac Electric Power Co. 6.5% 15/11/2037	USD	200,000	222,769	0.00
					Principal Life Global Funding II, 144A 1.25% 23/06/2025	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 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 (%)
Principal Life Global Funding II, 144A 5.5% 28/06/2028	USD	8,500,000	8,446,071	0.17	Seasoned Loans Structured Transaction, Series 2018-1 'A1' 3.5% 25/06/2028	USD	2,359,121	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-CB1 'AF2' 2.86% 25/01/2036	USD	27,363	21,896	0.00
Providence St Joseph Health Obligated Group 2.746% 01/10/2026	USD	280,000	255,908	0.01	Sequoia Mortgage Trust, FRN, Series 10 'IA' 5.948% 20/10/2027	USD	36,369	35,035	0.00
Prudential Insurance Co. of America (The), 144A 8.3% 01/07/2025	USD	1,350,000	1,399,115	0.03	Sequoia Mortgage Trust, FRN, Series 2003-1 'IA' 5.908% 20/04/2033	USD	48,098	43,839	0.00
Public Service Co. of Colorado 6.5% 01/08/2038	USD	135,000	148,053	0.00	Sequoia Mortgage Trust, FRN, Series 2004-12 'A3' 5.986% 20/01/2035	USD	37,330	34,614	0.00
Public Service Co. of Oklahoma 6.625% 15/11/2037	USD	300,000	319,024	0.01	Sierra Timeshare Receivables Funding LLC, Series 2018-3A 'A', 144A 3.69% 20/09/2035	USD	389,006	385,933	0.01
Puget Sound Energy, Inc. 5.448% 01/06/2053	USD	1,235,000	1,235,188	0.03	Sigeco Securitization I LLC 5.026% 15/11/2038	USD	2,239,000	2,233,188	0.05
RAMP Trust, Series 2004-SL2 'A3' 7% 25/10/2031	USD	80,800	80,148	0.00	Sigeco Securitization I LLC 5.172% 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 5.2% 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 4.8% 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 3.706% 15/05/2120	USD	2,540,000	1,685,597	0.04	Southwestern Public Service Co. 4.5% 15/08/2041	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 2017-1AA 'AA' 3.375% 15/08/2031	USD	554,925	478,019	0.01
Roper Technologies, Inc. 4.2% 15/09/2028	USD	450,000	431,847	0.01	Sprint Capital Corp. 6.875% 15/11/2028	USD	6,743,000	7,139,420	0.15
S&P Global, Inc. 2.9% 01/03/2032	USD	1,450,000	1,252,248	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% 15/09/2031	USD	1,547,000	1,230,201	0.03
Sabine Pass Liquefaction LLC 4.5% 15/05/2030	USD	1,200,000	1,136,864	0.02	Structured Asset Mortgage Investments II Trust, FRN, Series 2004-AR5 'IA1' 5.792% 19/10/2034	USD	77,306	72,356	0.00
Sabra Health Care LP, REIT 3.2% 01/12/2031	USD	1,685,000	1,254,963	0.03	Structured Asset Mortgage Investments II Trust, FRN, Series 2005-AR5 'A3' 5.396% 19/07/2035	USD	145,663	132,689	0.00
SCE Recovery Funding LLC 2.51% 15/11/2043	USD	1,140,000	765,895	0.02	Structured Asset Securities Corp., FRN, Series 2003-3AA 'A3' 4.796% 25/11/2033	USD	48,907	48,197	0.00
Schlumberger Holdings Corp., 144A 3.9% 17/05/2028	USD	455,000	428,627	0.01	Structured Asset Securities Corp., Series 2002-AL1 'A3' 3.45% 25/02/2032	USD	24,796	12,758	0.00
Seasoned Credit Risk Transfer Trust, Series 2018-4 'MA' 3.5% 25/03/2058	USD	5,678,468	5,327,361	0.11					
Seasoned Credit Risk Transfer Trust 'MTU' 3.25% 25/11/2061	USD	6,060,726	5,281,736	0.11					
Seasoned Credit Risk Transfer Trust, Series 2018-4 'MZ' 3.5% 25/03/2058	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		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(%)					占める	割合(%)			
Structured Asset Securities Corp., Series 2004-6XS 'A5B' 6.05% 25/03/2034	USD	15,221	15,052	0.00	UMBS 5% 01/03/2053	USD	7,960,571	7,817,254	0.16	UMBS 5.5% 01/05/2053	USD	9,989,125	10,040,002	0.21
Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A 4.9% 15/09/2044	USD	400,000	360,333	0.01	UMBS 5% 01/06/2053	USD	1,327,076	1,304,013	0.03	UMBS 5% 01/06/2053	USD	4,431,910	4,350,735	0.09
Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A 4.27% 15/05/2047	USD	800,000	657,452	0.01	UMBS 5% 01/06/2053	USD	7,110,000	6,961,999	0.14	UMBS 5% 01/06/2053	USD	14,200,000	13,895,539	0.29
Tennessee Valley Authority 0% 01/11/2025	USD	1,150,000	1,027,521	0.02	UMBS 5.5% 01/06/2053	USD	3,320,415	3,326,950	0.07	UMBS 255843 5.5% 01/09/2035	USD	32,108	32,881	0.00
Tennessee Valley Authority 0% 15/03/2032	USD	800,000	534,844	0.01	UMBS 257055 6.5% 01/12/2027	USD	13,294	13,581	0.00	UMBS 257510 7% 01/12/2038	USD	53,201	56,775	0.00
Tennessee Valley Authority 0% 15/06/2035	USD	2,000,000	1,156,662	0.02	UMBS 357639 5.5% 01/11/2034	USD	1,262	1,291	0.00	UMBS 357639 5.5% 01/11/2034	USD	1,262	1,291	0.00
Texas Eastern Transmission LP, 144A 3.5% 15/01/2028	USD	90,000	83,309	0.00	UMBS 598559 6.5% 01/08/2031	USD	3,360	3,496	0.00	UMBS 602589 7% 01/09/2031	USD	11,670	11,633	0.00
Texas Health Resources 2.328% 15/11/2050	USD	1,260,000	734,580	0.02	UMBS 622534 3% 01/09/2031	USD	87,363	77,345	0.00	UMBS 622534 3% 01/09/2031	USD	87,363	77,345	0.00
Texas Health Resources 4.33% 15/11/2055	USD	700,000	611,056	0.01	UMBS 622542 5.5% 01/09/2031	USD	85,215	86,155	0.00	UMBS 622542 5.5% 01/09/2031	USD	85,215	86,155	0.00
Texas Instruments, Inc. 5.05% 18/05/2063	USD	2,280,000	2,252,930	0.05	UMBS 674349 6% 01/03/2033	USD	926	934	0.00	UMBS 674349 6% 01/03/2033	USD	926	934	0.00
Time Warner Cable LLC 6.55% 01/05/2037	USD	400,000	378,758	0.01	UMBS 689977 8% 01/03/2027	USD	4,901	4,936	0.00	UMBS 689977 8% 01/03/2027	USD	4,901	4,936	0.00
Time Warner Cable LLC 6.75% 15/06/2039	USD	1,560,000	1,487,155	0.03	UMBS 695533 8% 01/06/2027	USD	2,924	2,949	0.00	UMBS 725704 6% 01/08/2034	USD	2,207	2,282	0.00
Truist Financial Corp., FRN 6.047% 08/06/2027	USD	1,935,000	1,934,203	0.04	UMBS 725704 6% 01/08/2034	USD	2,207	2,282	0.00	UMBS 745148 5.5% 01/01/2036	USD	26,322	26,466	0.00
Truist Financial Corp., FRN 5.122% 26/01/2034	USD	1,450,000	1,366,630	0.03	UMBS 745148 5.5% 01/04/2036	USD	34,866	35,731	0.00	UMBS 745418 5.5% 01/04/2036	USD	34,866	35,731	0.00
UMBS 4% 01/06/2048	USD	3,423,315	3,252,502	0.07	UMBS 755973 8% 01/11/2028	USD	9,415	9,590	0.00	UMBS 755973 8% 01/11/2028	USD	9,415	9,590	0.00
UMBS 2.5% 01/05/2050	USD	7,907,859	6,749,504	0.14	UMBS 755994 8% 01/10/2028	USD	1,478	1,476	0.00	UMBS 755994 8% 01/10/2028	USD	1,478	1,476	0.00
UMBS 2.5% 01/07/2050	USD	13,920,179	11,804,576	0.24	UMBS 775902 8.5% 01/04/2030	USD	20,270	20,434	0.00	UMBS 775902 8.5% 01/04/2030	USD	20,270	20,434	0.00
UMBS 2.5% 01/10/2051	USD	8,309,135	7,034,619	0.15	UMBS 788150 6% 01/03/2032	USD	10,715	10,797	0.00	UMBS 788150 6% 01/03/2032	USD	10,715	10,797	0.00
UMBS 2.5% 01/10/2051	USD	12,808,792	10,984,183	0.23	UMBS 870770 6.5% 01/07/2036	USD	16,714	17,400	0.00	UMBS 870770 6.5% 01/07/2036	USD	16,714	17,400	0.00
UMBS 3% 01/11/2051	USD	9,229,359	8,141,327	0.17	UMBS 888892 7.5% 01/11/2037	USD	48,176	51,332	0.00	UMBS 888892 7.5% 01/11/2037	USD	48,176	51,332	0.00
UMBS 2.5% 01/12/2051	USD	18,007,335	15,273,376	0.32	UMBS 889519 5.5% 01/12/2035	USD	41,872	42,880	0.00	UMBS 889519 5.5% 01/12/2035	USD	41,872	42,880	0.00
UMBS 2.5% 01/01/2052	USD	7,296,648	6,184,943	0.13	UMBS 889757 5% 01/02/2038	USD	29,848	30,279	0.00	UMBS 889757 5% 01/02/2038	USD	29,848	30,279	0.00
UMBS 3% 01/01/2052	USD	6,827,389	6,003,823	0.12	UMBS 924857 8.5% 01/09/2037	USD	14,718	14,679	0.00	UMBS 924857 8.5% 01/09/2037	USD	14,718	14,679	0.00
UMBS 2.5% 01/02/2052	USD	19,606,724	16,623,811	0.34	UMBS 929560 7% 01/06/2038	USD	52,466	55,356	0.00	UMBS 929560 7% 01/06/2038	USD	52,466	55,356	0.00
UMBS 3% 01/04/2052	USD	14,084,399	12,424,624	0.26	UMBS 945870 6.5% 01/08/2037	USD	26,601	27,838	0.00	UMBS 945870 6.5% 01/08/2037	USD	26,601	27,838	0.00
UMBS 4% 01/05/2052	USD	6,619,260	6,207,273	0.13	UMBS 946338 7% 01/09/2037	USD	45,013	46,354	0.00	UMBS 946338 7% 01/09/2037	USD	45,013	46,354	0.00
UMBS 5% 01/07/2052	USD	7,737,584	7,577,336	0.16	UMBS 960150 6% 01/11/2037	USD	21,471	21,685	0.00	UMBS 960150 6% 01/11/2037	USD	21,471	21,685	0.00
UMBS 4% 01/09/2052	USD	11,397,040	10,687,681	0.22	UMBS 976871 6.5% 01/08/2036	USD	107,015	109,834	0.00	UMBS 976871 6.5% 01/08/2036	USD	107,015	109,834	0.00
UMBS 4% 01/10/2052	USD	10,703,314	10,037,133	0.21	UMBS 995149 6.5% 01/10/2038	USD	57,580	59,940	0.00	UMBS 995149 6.5% 01/10/2038	USD	57,580	59,940	0.00
UMBS 4% 01/12/2052	USD	2,215,116	2,078,630	0.04	UMBS 995456 6.5% 01/02/2024	USD	1,071	1,066	0.00	UMBS 995456 6.5% 01/02/2024	USD	1,071	1,066	0.00
UMBS 4.5% 01/12/2052	USD	7,388,995	7,122,403	0.15	UMBS 995505 8% 01/01/2038	USD	16,373	16,796	0.00	UMBS 995505 8% 01/01/2038	USD	16,373	16,796	0.00
					UMBS AA0922 6% 01/09/2036	USD	68,955	71,489	0.00	UMBS AA0922 6% 01/09/2036	USD	68,955	71,489	0.00
					UMBS AA1019 6% 01/11/2036	USD	46,875	48,203	0.00	UMBS AA1019 6% 01/11/2036	USD	46,875	48,203	0.00
					UMBS AB9551 3% 01/06/2043	USD	1,528,932	1,377,119	0.03	UMBS AB9551 3% 01/06/2043	USD	1,528,932	1,377,119	0.03
					UMBS AC3407 5.5% 01/10/2039	USD	26,489	26,350	0.00	UMBS AC3407 5.5% 01/10/2039	USD	26,489	26,350	0.00
					UMBS AD0133 5% 01/08/2024	USD	1,966	1,952	0.00	UMBS AD0133 5% 01/08/2024	USD	1,966	1,952	0.00
					UMBS AD0753 7% 01/01/2039	USD	51,257	54,531	0.00	UMBS AD0753 7% 01/01/2039	USD	51,257	54,531	0.00
					UMBS AD0755 7% 01/06/2035	USD	2,640,979	2,761,138	0.06	UMBS AD0755 7% 01/06/2035	USD	2,640,979	2,761,138	0.06
					UMBS BH4683 4% 01/06/2047	USD	1,174,722	1,118,834	0.02	UMBS BH4683 4% 01/06/2047	USD	1,174,722	1,118,834	0.02
					UMBS BH4684 4% 01/06/2047	USD	1,692,880	1,610,242	0.03	UMBS BH4684 4% 01/06/2047	USD	1,692,880	1,610,242	0.03
					UMBS BH4685 4% 01/06/2047	USD	1,778,441	1,713,496	0.04	UMBS BH4685 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 (%)					割合 (%)	割合 (%)
UMBS BH7663 4% 01/10/2047	USD	3,166,412	3,040,310	0.06		United Airlines Pass-Through Trust 'AA'	USD	1,853,606	1,696,686	0.04	
UMBS BK0319 4.5% 01/03/2049	USD	493,662	480,572	0.01		3.45% 01/06/2029					
UMBS BK8753 4.5% 01/06/2049	USD	1,377,241	1,338,889	0.03		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-2 'AA' 2.875% 07/04/2030	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 2018-1 'AA' 3.5% 01/09/2031	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 'AA' 4.15% 25/02/2033	USD	1,260,139	1,164,625	0.02	
UMBS BM3254 4% 01/01/2038	USD	2,304,835	2,223,683	0.05		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-2 'AA' 2.7% 01/11/2033	USD	2,004,900	1,712,139	0.04	
UMBS BM3566 4% 01/02/2038	USD	2,787,997	2,691,576	0.06		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-1 'B' 3.65% 07/07/2027	USD	1,146,949	1,057,430	0.02	
UMBS BM5430 5% 01/01/2049	USD	2,917,531	2,902,042	0.06		United Airlines Pass-Through Trust, Series 2018-1 'B' 4.6% 01/09/2027	USD	820,876	776,104	0.02	
UMBS BN5899 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 BN9169 4.5% 01/04/2049	USD	679,596	660,904	0.01		University of Southern California 3.228% 01/10/2120	USD	1,090,000	668,557	0.01	
UMBS B02504 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 B03950 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 B04194 5% 01/09/2049	USD	245,910	249,695	0.01		US Treasury STRIP 0% 15/05/2024	USD	4,150,000	3,968,600	0.08	
UMBS B04199 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 B04200 5% 01/08/2049	USD	1,679,892	1,663,967	0.03		US Treasury STRIP 0% 15/08/2026	USD	100,000	87,168	0.00	
UMBS B04201 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 B04202 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 B04203 5% 01/08/2049	USD	1,653,822	1,685,936	0.04		US Treasury STRIP 0% 15/11/2034	USD	3,600,000	2,288,628	0.05	
UMBS B05594 4% 01/09/2049	USD	2,020,596	1,928,424	0.04		US Treasury STRIP 0% 15/02/2035	USD	1,515,000	953,530	0.02	
UMBS B05625 3.5% 01/08/2049	USD	5,845,215	5,489,257	0.11		US Treasury STRIP 0% 15/05/2035	USD	2,600,000	1,618,109	0.03	
UMBS B06078 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 B06817 3.5% 01/10/2049	USD	1,242,396	1,143,230	0.02		Utah Acquisition Sub, Inc. 3.95% 15/06/2026	USD	1,215,000	1,154,106	0.02	
UMBS B01623 3% 01/08/2050	USD	3,316,405	2,926,620	0.06		Vendee Mortgage Trust, Series 1998-2 '1c' 6.75% 15/06/2028	USD	80,819	82,292	0.00	
UMBS CA1234 4% 01/02/2038	USD	879,851	855,475	0.02		Vendee Mortgage Trust, Series 1998-1 '2E' 7% 15/03/2028	USD	9,900	9,879	0.00	
UMBS CA1238 4% 01/02/2038	USD	969,239	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. 1.68% 30/10/2030	USD	585,000	460,783	0.01	
UMBS FM1219 4% 01/07/2049	USD	799,319	757,580	0.02		Verizon Communications, Inc. 2.355% 15/03/2032	USD	528,000	422,923	0.01	
UMBS FM1758 3.5% 01/09/2049	USD	2,303,075	2,127,517	0.04		Viatis, 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		VND0 Trust, Series 2016-350P 'A', 144A 3.805% 10/01/2035	USD	5,294,000	4,868,110	0.10	
UMBS MA0948 5% 01/11/2031	USD	90,621	90,448	0.00		Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A 1.625% 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. (The) 9.5% 15/07/2024	USD	480,000	497,010	0.01	
UMBS QB1061 3.5% 01/06/2050	USD	711,931	655,287	0.01		Walt Disney Co. (The) 7.7% 30/10/2025	USD	170,000	177,363	0.00	
UMBS RA2008 4% 01/01/2050	USD	2,986,218	2,834,284	0.06							
UMBS SD8089 2.5% 01/07/2050	USD	22,349,176	19,008,398	0.39							
United Airlines Pass-Through Trust 'A' 4.15% 11/10/2025	USD	2,432,931	2,390,355	0.05							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2013-1 'A' 4.3% 15/02/2027	USD	3,207,166	3,103,605	0.06							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2014-1 'A' 4% 11/10/2027	USD	546,641	518,380	0.01							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2014-2 'A' 3.75% 03/03/2028	USD	406,413	385,325	0.01							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2016-2 'A' 3.1% 07/04/2030	USD	2,049,759	1,763,607	0.04							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2018-1 'A' 3.7% 01/09/2031	USD	2,800,062	2,437,143	0.05							
United Airlines Pass-Through Trust, Series 2019-1 'A' 4.55% 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

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 (%)
Walt Disney Co. (The) 7.625% 30/11/2028	USD	200,000	224,053	0.00	Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, IO, Series 2005-3 'CX' 5.5% 25/05/2035	USD	273,070	45,499	0.00
Walt Disney Co. (The) 6.4% 15/12/2035	USD	382,000	427,401	0.01	Workday, Inc. 3.5% 01/04/2027	USD	2,123,000	2,007,296	0.04
Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, Series 2003-S3 '144' 5.5% 25/06/2033	USD	43,263	40,550	0.00	WRKCo, Inc. 3.75% 15/03/2025	USD	800,000	769,911	0.02
Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-S3 '145' 5% 25/07/2034	USD	12,685	12,305	0.00	Xilinx, Inc. 2.375% 01/06/2030	USD	1,700,000	1,464,641	0.03
Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, FRN, Series 2003-AR9 '1A6' 4.155% 25/09/2033	USD	77,571	72,185	0.00	Yale-New Haven Health Services Corp. 2.496% 01/07/2050	USD	1,710,000	1,027,769	0.02
Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-S2 '2A4' 5.5% 25/06/2034	USD	44,246	43,041	0.00				2,412,646,568	49.71
Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-S3 '3A2' 6% 25/07/2034	USD	106,391	105,804	0.00	債券合計			2,669,127,042	55.00
Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, FRN, Series 2003-AR8 'A' 4.163% 25/08/2033	USD	6,239	5,984	0.00	その他の規制市場で取引される譲渡性 有価証券および短期金融市場商品合計			2,669,127,042	55.00
Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, Series 2004-RS2 'A4' 5% 25/11/2033	USD	87,568	77,113	0.00	他の譲渡性有価証券および短期金融市場商品 債券 アメリカ				
Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, Series 2003-S1 'A5' 5.5% 25/04/2033	USD	56,130	55,272	0.00	GAMA, IO, FRN, Series 2006-38 'SW' 1.354% 20/06/2036*	USD	391	1	0.00
Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, FRN, Series 2003-AR11 'A6' 4.224% 25/10/2033	USD	119,031	111,174	0.00				1	0.00
Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, FRN, Series 2003-AR5 'A7' 4.831% 25/06/2033	USD	71,439	71,068	0.00	債券合計			1	0.00
Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, FRN, Series 2003-AR7 'A7' 3.868% 25/08/2033	USD	11,285	10,481	0.00	他の譲渡性有価証券および短期金融市場商品合計			1	0.00
Waldu Mortgage Pass-Through Certificates Trust, Series 2005-4 'CB7' 5.5% 25/06/2035	USD	70,994	62,785	0.00	UCITSと認められたユニットまたは他の集団投資事業 集団投資スキーム - UCITS ルクセンブルク				
					JPMorgan USD Liquidity LVNAV Fund - JPM USD Liquidity LVNAV X (dist.) †	USD	133,902,702	133,902,702	2.76
								133,902,702	2.76
					集団投資スキーム - UCITS合計			133,902,702	2.76
					UCITSと認められたユニットまたは他の集団投資事業合計			133,902,702	2.76
					投資有価証券合計			4,857,938,562	100.10
					現金			10,537,185	0.22
					その他の資産 / (負債)			(15,385,759)	(0.32)
					純資産合計			4,853,089,988	100.00

* 有価証券は取締役会の指示により公正価値で評価されている。

† 利害関係人のファンド

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	1.26
カナダ	1.02
日本	0.86
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	139,404	—
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	0.16
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	11,154,358	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	3,830,602	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	55,952	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	5,195	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	136,580	AUD	206,487	03/08/2023	RBC	(918)	—
USD	824	CHF	744	05/07/2023	Merrill Lynch	(6)	—
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	246,665	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)	—
先渡為替契約未実現損失合計						(562,450)	(0.01)
先渡為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	132,616,148	(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次平均に対する比率で表したものです。

運用にかかる費用の合計には、保管報酬、税金、その他費用が含まれております。

当座貸越利息と実績報酬は計算対象から除いております。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。

<補足情報>

『GIMジャパン・マネープール・ファンドF(適格機関投資家専用)の運用状況

(2022年1月15日～2023年1月16日)』

GIMジャパン・マネープール・ファンドF(適格機関投資家専用)の仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券	
信託期間	無期限	
運用方針	マザーファンドを通じ、円建ての公社債を主要投資対象とし、安定した収益の確保を目指して安定運用を行います。	
主要投資(運用)対象	当ファンド	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ます。
	マザーファンド	円建ての公社債を主要投資対象とします。
組入制限および運用方法	当ファンド	ファミリーファンド方式により、マザーファンドを通じて運用を行います。株式への実質投資割合は、純資産総額の10%以下とします。外貨建資産には投資しません。
	マザーファンド	日本の発行体が発行する円建ての公社債を中心に投資し、元本の安定性と安定した収益の確保を図るとともに、高い流動性の確保に配慮した運用を行います。株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。外貨建資産には投資しません。
分配方針	毎年1回(原則として1月14日)決算日に基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。	

(注) 当報告書における比率は、表示桁未満四捨五入です。

(注) 「GIMマネープール・マザーファンド(適格機関投資家専用)」は「マネープール・マザーファンド」または「マザーファンド」ということがあります。

○損益の状況

(2022年1月15日～2023年1月16日)

項目	当期
	円
(A) 有価証券売買損益	△ 34,901
売買益	1
売買損	△ 34,902
(B) 信託報酬等	△ 7,574
(C) 当期損益金(A+B)	△ 42,475
(D) 前期繰越損益金	△ 17,866
(E) 追加信託差損益金	17,845
(配当等相当額)	(205,138)
(売買損益相当額)	(△187,293)
(F) 計(C+D+E)	△ 42,496
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	△ 42,496
追加信託差損益金	17,845
(配当等相当額)	(205,138)
(売買損益相当額)	(△187,293)
分配準備積立金	112,806
繰越損益金	△173,147

(注) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) 損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 信託財産の運用の指図に関する権限を委託するために要する費用として、純資産総額に年率0.049%を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しています。

(注) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,482円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(205,138円)および分配準備積立金(109,324円)より分配対象収益は317,944円(10,000口当たり510円)ですが、当期に分配した金額はありません。

(注) 当期における信託報酬(消費税相当額を含む)の内訳は以下の通りです。

受託者報酬	1,410円
委託者報酬	4,950円

○組入資産の明細

(2023年1月16日現在)

親投資信託残高			
銘柄	期首(前期末)	当期 末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
マネープール・マザーファンド受益証券	6,129	6,121	6,184

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨てです。

(注) 株式、新株予約権証券及び株式の性質を有するオプション証券等は組入れていません。

○1万口当たりの費用明細 (2022年1月15日～2023年1月16日)

項目	当期	
	金額	比率
	円	%
(a) 信託報酬	10	0.105
(投信会社)	(7)	(0.072)
(販売会社)	(1)	(0.011)
(受託会社)	(2)	(0.022)
(b) その他費用	7	0.073
(監査費用)	(2)	(0.020)
(その他)	(5)	(0.054)
合計	17	0.178

期中の平均基準価額は、9,976円です。

(注) 項目の概要については、前記当ファンドに投資している投資信託の運用報告書「1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

(注) 各項目は簡便法で算出し、円未満は四捨五入です。

(注) 比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

<約款変更のお知らせ>

- ・2022年8月12日付で、計算期間の最初の6か月終了日が休業日の場合は翌営業日を当該終了日とする変更を行うため、また資金動向、市況動向、経済情勢、投資環境等の変化に対応するために、やむを得ない事情がある場合には投資態度にそった運用が行えない場合がある旨の記載を追加するため、信託約款に所要の変更を行っております。

<GIMマネープール・マザーファンド(適格機関投資家専用)>

ご参考として、GIMジャパン・マネープール・ファンドF(適格機関投資家専用)の主たる投資対象であるGIMマネープール・マザーファンド(適格機関投資家専用)の第13期(決算日:2023年1月16日)情報を掲載いたします。

○損益の状況 (2022年1月15日~2023年1月16日) ○1万口当たりの費用明細 (2022年1月15日~2023年1月16日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	11,056
受取利息	11,056
(B) 有価証券売買損益	△42,459
売買損	△42,459
(C) その他費用等	△3,343
(D) 当期損益金(A+B+C)	△34,746
(E) 前期繰越損益金	97,494
(F) 解約差損益金	△112
(G) 計(D+E+F)	62,636
次期繰越損益金(G)	62,636

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注) 損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

項目	当期	
	金額	比率
	円	%
(a) その他費用	5	0.054
(その他)	(5)	(0.054)
合計	5	0.054
期中の平均基準価額は、10,140円です。		

(注) 項目の概要については、前記当ファンドに投資している投資信託の運用報告書「1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

(注) 各項目は簡便法で算出し、円未満は四捨五入です。

(注) 比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○組入資産の明細

(2023年1月16日現在)

下記は、マネープール・マザーファンド全体(6,121千口)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区分	当期				期末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちB B格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	3,350	3,378	54.6	—	11.6	13.9	29.1
合計	3,350	3,378	54.6	—	11.6	13.9	29.1

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

(注) 一印がある場合は組入れなしを表します。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入力しています。

(注) 残存期間が1年以内の公社債は原則としてアキュムレーションまたはアモチゼーションにより評価しています。

(注) 債券の格付については、原則としてS&PまたはMoody'sが提供する格付を使用し、仕組み債等、格付の提供がなされていないものについては、委託会社による判断を基にしております。
なお、上記の格付機関が異なる格付を提供している場合は、低い方を採用しております。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当期			期末	
	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
国債証券	%	千円	千円		
第141回利付国債(5年)	0.1	1,800	1,802	2024/9/20	
第340回利付国債(10年)	0.4	850	857	2025/9/20	
第353回利付国債(10年)	0.1	400	392	2028/12/20	
第116回利付国債(20年)	2.2	150	167	2030/3/20	
第129回利付国債(20年)	1.8	50	54	2031/6/20	
第154回利付国債(20年)	1.2	100	103	2035/9/20	
合計		3,350	3,378		

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

(注) 株式、新株予約権証券及び株式の性質を有するオプション証券等は組入れていません。

<約款変更のお知らせ>

- ・2022年8月12日付で、計算期間の最初の6ヵ月終了日が休業日の場合は翌営業日を当該終了日とする変更を行うため、信託約款に所要の変更を行っております。