

平成 26 年 4 月吉日

投資家の皆様へ

J P モルガン・アセット・マネジメント株式会社

「J P M 北米高配当・成長株ファンド」

投資信託に係る運用報告書の訂正ならびにお詫び

拝啓 時下ますますご清祥のこととお慶び申し上げます。平素は格別のお引き立てを賜りまして厚く御礼申し上げます。

さて、弊社が作成しております追加型投資信託「J P M 北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3 ヶ月決算型）」「J P M 北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3 ヶ月決算型）」「J P M 北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年 2 回決算型）」「J P M 北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年 2 回決算型）」の初回運用報告書（設定日から平成 25 年 8 月 26 日）の記載内容の一部に下記の通り誤りがございましたことにお詫び申し上げます。

弊社はこの度の事態を真摯に受け止め、今後このような過誤が起らないよう再発防止に向けて万全の措置を取る所存でございますので、何卒ご理解を賜りますよう宜しくお願い申し上げます。

敬具

記

過誤の内容と対応

各ファンドの運用報告書に記載している「設定以来の運用実績」および「当作成期中/当期中の基準価額と市況等の推移」に記載の設定日の S&P 5 0 0 指数（税引後配当込み、円ベース）（参考指数）およびその値を元に計算を行った指数の期中騰落率の一部に別紙のとおり誤ったデータが記載されていたため、該当ページの記載を全て正しく訂正しておりますので、弊社ホームページに掲載の運用報告書<訂正版>の該当ページのご確認をお願い致します。

J P M 北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、3 ヶ月決算型）	1 ページ
J P M 北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、3 ヶ月決算型）	9 ページ
J P M 北米高配当・成長株ファンド（為替ヘッジなし、年 2 回決算型）	17 ページ
J P M 北米高配当・成長株ファンド（米ドル対円ヘッジあり、年 2 回決算型）	24 ページ

なお、JPM 北米高配当株式マザーファンド（適格機関投資家専用）については、記載内容

に誤りはありませんでした。

また、訂正前運用報告書は弊社ウェブサイトにて平成 25 年 10 月 11 日から平成 26 年 4 月 3 日の間掲載されておりましたので、併せてお知らせ致します。

<お問い合わせ先>

J P モルガン・アセット・マネジメント

TEL 03-6736-2350

(受付時間は営業日の午前 9 時～午後 5 時)

以上

## ◎設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S&P 500指数 (税引後配当込み、円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
(設定日)	円	円	%	(正)10,000	%	%	%	百万円
2013年4月11日	10,000	—	—	10,170	(正) —	—	—	2,422
1期(2013年5月27日)	10,569	0	5.7	10,714	7.1 5.3	93.7	—	8,807
2期(2013年8月26日)	10,055	500	△0.1	10,615	△0.9	98.9	—	14,242

(注1) 設定日の欄には、設定時の数値を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注3) 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4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注5) 参考指数は、設定日の前営業日を10,000として指数化しています(以下同じ)。

(注6) S&P 500指数は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービズ・エル・エル・シーが発表しており、著作権はスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービズ・エル・エル・シーに帰属しております。

## ◎当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準価額		S&P 500指数 (税引後配当込み、円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率			
第1期	(設定日)2013年4月11日	円	%	(正)10,000	%	%	%
	4月末	10,000	—	10,170	(正) —	—	—
	(期 末)2013年5月27日	9,972	△0.3	10,032	0.3△1.4	88.0	—
第2期	(期 末)2013年5月27日	10,569	5.7	10,714	7.1 5.3	93.7	—
	(期 首)2013年5月27日	10,569	—	10,714	—	93.7	—
	5月末	10,652	0.8	10,781	0.6	94.2	—
	6月末	10,273	△2.8	10,254	△4.3	94.6	—
	7月末	10,651	0.8	10,671	△0.4	97.2	—
(期 末)2013年8月26日	10,555	△0.1	10,615	△0.9	98.9	—	

(注1) 設定日の欄には、設定時の数値を記載しています。

(注2) 期末基準価額は当該期の分配金込み、期首の基準価額は分配金落後です。また、騰落率は期首比です。

(注3) 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4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

## ◎設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S&P 500指数 (税引後配当込み、為替ヘッジあり、円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
(設定日)	円	円	%	(正)10,000	%	%	%	百万円
2013年4月11日	10,000	—	—	10,122	(正) —	—	—	64
1期(2013年5月27日)	10,376	0	3.8	10,534	5.3 4.1	94.6	—	168
2期(2013年8月26日)	10,099	500	2.1	10,657	1.2	100.2	—	262

(注1) 設定日の欄には、設定時の数値を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注3) 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4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注5) 参考指数は、設定日の前営業日を10,000として指数化しています(以下同じ)。

(注6) S&P 500指数は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービズ・エル・エル・シーが発表しており、著作権はスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービズ・エル・エル・シーに帰属しております。

## ◎当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準価額		S&P 500指数 (税引後配当込み、為替ヘッジあり、円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率
			騰落率	(参考指数)	騰落率		
第1期	(設定日)2013年4月11日	円	%	(正)10,000	%	%	%
	4月末	10,092	0.9	10,122	(正) —	—	—
	(期末)2013年5月27日	10,376	3.8	10,534	5.3 4.1	94.6	—
第2期	(期首)2013年5月27日	10,376	—	10,534	—	94.6	—
	5月末	10,431	0.5	10,567	0.3	95.2	—
	6月末	10,337	△0.4	10,314	△2.1	94.1	—
	7月末	10,769	3.8	10,786	2.4	95.2	—
	(期末)2013年8月26日	10,599	2.1	10,657	1.2	100.2	—

(注1) 設定日の欄には、設定時の数値を記載しています。

(注2) 期末基準価額は当該期の分配金込み、期首の基準価額は分配金落後です。また、騰落率は期首比です。

(注3) 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4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

## ◎設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			S & P 500 指数 (税引後配当込み、円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	純資産 総 額
	税込み 分配金	期 中 騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率				
(設 定 日)	円	円	%	(正)10,000	%	%	%	百万円
2013年4月11日	10,000	—	—	10,170	(正) —	—	—	3,048
1期(2013年8月26日)	10,555	0	5.6	10,615	6.2 4.4	94.3	—	21,575

(注1) 設定日の欄には、設定時の数値を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注3) 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4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注5) 参考指数は、設定日の前営業日を10,000として指数化しています(以下同じ)。

(注6) S & P 500 指数は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービスズ・エル・エル・シーが発表しており、著作権はスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービスズ・エル・エル・シーに帰属しております。

## ◎当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 500 指数 (税引後配当込み、円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	騰落率	(参考指数)	騰落率			
(設 定 日)	円	%	(正)10,000	%	%	%
2013年4月11日	10,000	—	10,170	(正) —	—	—
4月末	9,972	△0.3	10,032	0.3 △1.4	88.0	—
5月末	10,652	6.5	10,781	7.8 6.0	94.3	—
6月末	10,273	2.7	10,254	2.5 0.8	94.8	—
7月末	10,651	6.5	10,671	6.7 4.9	97.3	—
(期 末)						
2013年8月26日	10,555	5.6	10,615	6.2 4.4	94.3	—

(注1) 設定日の欄には、設定時の数値を記載しています。

(注2) 騰落率は期首比です。

(注3) 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4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

## ◎設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S&P 500指数 (税引後配当込み、為替ヘッジあり、円ベース) (参考指数)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
(設定日)	円	円	%	(正)10,000	%	%	%	百万円
2013年4月11日	10,000	—	—	10,122	(正) —	—	—	84
1期(2013年8月26日)	10,629	0	6.3	10,657	6.6 5.3	95.6	—	297

(注1) 設定日の欄には、設定時の数値を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注3) 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4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注5) 参考指数は、設定日の前営業日を10,000として指数化しています(以下同じ)。

(注6) S&P 500指数は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービスズ・エル・エル・シーが発表しており、著作権はスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービスズ・エル・エル・シーに帰属しております。

## ◎当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		S&P 500指数 (税引後配当込み、為替ヘッジあり、円ベース) (参考指数)		株式 組入比率	株式 先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(設定日)	円	%	(正)10,000	%	%	%
2013年4月11日	10,000	—	10,122	(正) —	—	—
4月末	10,099	1.0	10,162	1.6 0.4	87.2	—
5月末	10,457	4.6	10,567	5.7 4.4	95.6	—
6月末	10,361	3.6	10,314	3.1 1.9	94.1	—
7月末	10,795	8.0	10,786	7.9 6.6	95.3	—
(期末)						
2013年8月26日	10,629	6.3	10,657	6.6 5.3	95.6	—

(注1) 設定日の欄には、設定時の数値を記載しています。

(注2) 騰落率は期首比です。

(注3) 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4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。