

---

Ungeprüfter Halbjahresbericht

# JPMorgan Liquidity Funds

---

Société d'Investissement à Capital Variable, Luxembourg

31. Mai 2024



Diese Seite wurde absichtlich freigelassen

## JPMorgan Liquidity Funds

Ungeprüfter Halbjahresbericht

zum 31. Mai 2024

---

### Inhalt

<b>Verwaltungsrat</b>	1
<b>Management und Verwaltung</b>	2
<b>Ungeprüfter Zwischenabschluss und statistische Angaben</b>	
<i>Kombinierte Aufstellung des Nettovermögens</i>	3
<i>Kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens</i>	7
<i>Aufstellung der Veränderung der Anzahl der Aktien</i>	11
<i>Statistische Angaben</i>	13
<b>Erläuterungen zum ungeprüften Zwischenabschluss</b>	15
<b>Wertpapierbestand</b>	
<b>Teilfonds - Unternehmensanleihen</b>	
<i>JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund</i>	21
<i>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund</i>	23
<i>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund</i>	28
<i>JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund</i>	33
<i>JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund</i>	35
<i>JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund</i>	39
<i>JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund</i>	42
<i>JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund</i>	50
<b>Teilfonds - Staatsanleihen</b>	
<i>JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund</i>	57
<i>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund</i>	59
<b>Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben</b>	
1. <i>Gesamtkostenquoten</i>	60
2. <i>Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds</i>	63
3. <i>Wertentwicklung und Volatilität</i>	63
4. <i>Haben- und Sollzinssätze auf Bankkonten</i>	65
5. <i>Portfolio Turnover Ratio</i>	65
6. <i>Berechnung des Risikopotenzials</i>	65
7. <i>Erhaltene Sicherheiten</i>	66
8. <i>Wertpapierfinanzierungsgeschäfte</i>	70
9. <i>OGAW - Angaben zur Vergütung</i>	74
10. <i>Offenlegungsverordnung</i>	75

Weitere Informationen finden Sie unter: [www.jpmgloballiquidity.com](http://www.jpmgloballiquidity.com).

---

Dieser Bericht ist weder ein Angebot noch ein Verkauf oder eine Aufforderung zur Zeichnung oder zum Kauf von Aktien. Auf der Grundlage dieses Berichts dürfen keine Zeichnungen entgegengenommen werden. Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Grundlage des aktuellen ausführlichen Verkaufsprospekts und der aktuellen wesentlichen Informationen vorgenommen werden, wobei beide Dokumente durch den letzten geprüften Jahresbericht und, soweit anschließend veröffentlicht, durch den letzten ungeprüften Halbjahresbericht ergänzt werden.

Der aktuelle Verkaufsprospekt, die aktuellen wesentlichen Informationen sowie der ungeprüfte Halbjahresbericht und gegebenenfalls der geprüfte Jahresbericht sind kostenlos am eingetragenen Sitz der SICAV und bei den örtlichen Zahlstellen, wie aus diesem Bericht ersichtlich, verfügbar.

Informationen über den/die Anlageverwalter einzelner Teilfonds sind aus dem Verkaufsprospekt ersichtlich und von der Verwaltungsgesellschaft am eingetragenen Sitz oder unter [www.jpmgloballiquidity.com](http://www.jpmgloballiquidity.com) erhältlich.

---

**Vorsitzender**

*Peter Thomas Schwicht*

6, route de Trèves  
L-2633 Senningerberg  
Großherzogtum Luxemburg

**Mitglieder des Verwaltungsrates**

*Jacques Elvinger*

Elvinger Hoss Prussen, société anonyme  
2, place Winston Churchill  
B.P. 425, L-2014 Luxembourg  
Großherzogtum Luxemburg

*Massimo Greco*

Via Cordusio, 3  
Milan, IT-25, 20123  
Italien

*John Li How Cheong*

The Directors' Office  
19, rue de Bitbourg  
L-1273 Luxembourg  
Großherzogtum Luxemburg

**Gesellschaftssitz**

6, route de Trèves  
L-2633 Senningerberg  
Großherzogtum Luxemburg

*Marion Mulvey*

6, route de Trèves  
L-2633 Senningerberg  
Großherzogtum Luxemburg

*Martin Porter*

6, route de Trèves  
L-2633 Senningerberg  
Großherzogtum Luxemburg

*Daniel Watkins*

JP Morgan Asset Management (Asia Pacific) Limited  
19th Floor, Chater House  
8 Connaught Road  
Central Hongkong 99077

**Verwaltungsgesellschaft, Register-, Transfer-,  
Hauptvertriebs- und Domizilstelle**

JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l.  
6, route de Trèves  
L-2633 Senningerberg  
Großherzogtum Luxemburg

**Anlageverwalter**

JPMorgan Asset Management (UK) Limited  
60 Victoria Embankment  
London EC4Y 0JP  
Großbritannien

J.P. Morgan Investment Management Inc.  
383 Madison Avenue  
New York, NY 10179  
Vereinigte Staaten von Amerika

JP Morgan Asset Management (Asia Pacific) Limited  
19th Floor, Chater House  
8 Connaught Road  
Central Hongkong

**Verwahr- und Zahlstelle, Aktienregisterführer und Listing Agent**

J.P. Morgan SE - Luxembourg Branch  
6, route de Trèves  
L-2633 Senningerberg  
Großherzogtum Luxemburg

**Abschlussprüfer**

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
2, rue Gerhard Mercator  
B.P. 1443, L-1014 Luxembourg  
Großherzogtum Luxemburg

**Rechtsberater in Luxemburg**

Elvinger Hoss Prussen, société anonyme  
2, place Winston Churchill  
B.P. 425, L-2014 Luxembourg  
Großherzogtum Luxemburg

**JPMorgan Liquidity Funds**  
*Kombinierte Aufstellung des Nettovermögens*  
zum 31. Mai 2024

	Kombiniert USD
<b>Aktiva</b>	
Wertpapierbestand zu Einstandspreisen	170.610.782.658
Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	(25.715.966)
Wertpapierbestand zum Marktwert	170.585.066.692
Guthaben bei Banken und Brokern	5.896.914.288
Termineinlagen	25.132.038.889
Forderungen aus Zeichnungen*	8.770.270
Forderungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften	41.715.334.511
Forderungen aus Zinsen	459.828.955
Honorarverzicht**	105.812
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften	39.379
<b>Aktiva insgesamt</b>	<b>243.798.098.796</b>
<b>Passiva</b>	
Verpflichtungen gegenüber Brokern	489
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen	5.105.809.991
Zinsaufwendungen	140.694
Verbindlichkeiten aus Dividendenausschüttungen	877.037.156
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	35.889.296
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen*	5.358.150
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften	111.886
Andere Passiva***	73.522.836
<b>Passiva insgesamt</b>	<b>6.097.870.498</b>
<b>Nettovermögen insgesamt</b>	<b>237.700.228.298</b>

\* Siehe Erläuterung 2g).

\*\* Siehe Erläuterungen 4a), 4b), 4d) und 4e). Überschreiten die tatsächlichen Betriebskosten den Prozentsatz mit Obergrenze, wird der von der Verwaltungsgesellschaft übernommene Betrag in der kombinierten Aufstellung des Nettovermögens und der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens gesondert als „Honorarverzicht“ ausgewiesen.

\*\*\* Andere Passiva umfasst hauptsächlich die Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrates, die Abschlussprüfungs- und Steuerberatungsgebühren und -auslagen, die Kosten für die Registrierung, die Veröffentlichung, den Versand, den Druck sowie die Rechts- und Marketingkosten.

Die beigefügten Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

## JPMorgan Liquidity Funds

Kombinierte Aufstellung des Nettovermögens (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund AUD	JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund EUR	JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund EUR	JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund SGD
909.332.221 (166.807)	16.028.964.224 (1.136.117)	4.096.985.916 628.980	1.215.227.824 (198.939)
909.165.414	16.027.828.107	4.097.614.896	1.215.028.885
180.422.363	997.773.418	139.098.171	50.121.122
146.000.000	2.055.000.000	275.100.000	340.000.000
80.939	413.313	20.000	31.851
450.000.000	6.041.462.108	40.000.000	380.000.000
3.370.915	47.950.514	6.416.483	3.593.961
8.364	10.312	7.973	18.829
-	-	36.232	-
<b>1.689.047.995</b>	<b>25.170.437.772</b>	<b>4.558.293.755</b>	<b>1.988.794.648</b>
-	-	450	-
-	2.213.226.741	60.217.553	-
147	-	916	-
4.653.567	14.141.782	-	4.577.475
232.799	3.085.064	346.714	264.371
-	-	-	-
-	-	102.945	-
74.912.850	2.630.495	230.985	4.123.987
<b>79.799.363</b>	<b>2.233.084.082</b>	<b>60.899.563</b>	<b>8.965.833</b>
<b>1.609.248.632</b>	<b>22.937.353.690</b>	<b>4.497.394.192</b>	<b>1.979.828.815</b>

## JPMorgan Liquidity Funds

Kombinierte Aufstellung des Nettovermögens (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

JPMorgan Liquidity Funds -  
GBP Liquidity  
LVNAV Fund  
GBP

<b>Aktiva</b>	
Wertpapierbestand zu Einstandspreisen	9.259.951.061
Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	(3.534.536)
Wertpapierbestand zum Marktwert	9.256.416.525
Guthaben bei Banken und Brokern	686.969.929
Termineinlagen	850.000.000
Forderungen aus Zeichnungen*	384.012
Forderungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften	4.863.800.000
Forderungen aus Zinsen	27.324.335
Honorarverzicht**	8.962
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften	-
<b>Aktiva insgesamt</b>	<b>15.684.903.763</b>
<b>Passiva</b>	
Verpflichtungen gegenüber Brokern	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen	1.427.926.248
Zinsaufwendungen	109.426
Verbindlichkeiten aus Dividendenausschüttungen	62.519.346
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	1.776.088
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen*	4.200.000
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften	-
Andere Passiva***	432.071
<b>Passiva insgesamt</b>	<b>1.496.963.179</b>
<b>Nettovermögen insgesamt</b>	<b>14.187.940.584</b>

\* Siehe Erläuterung 2g).

\*\* Siehe Erläuterungen 4a), 4b), 4d) und 4e). Überschreiten die tatsächlichen Betriebskosten den Prozentsatz mit Obergrenze, wird der von der Verwaltungsgesellschaft übernommene Betrag in der kombinierten Aufstellung des Nettovermögens und der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens gesondert als „Honorarverzicht“ ausgewiesen.

\*\*\* Andere Passiva umfasst hauptsächlich die Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrates, die Abschlussprüfungs- und Steuerberatungsgebühren und -auslagen, die Kosten für die Registrierung, die Veröffentlichung, den Versand, den Druck sowie die Rechts- und Marketingkosten.

Die beigefügten Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.



## JPMorgan Liquidity Funds

Kombinierte Aufstellung des Nettovermögens (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund GBP	JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund USD	JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund USD	JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund USD	JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1) EUR
600.508.116 (247.742)	93.856.355.551 (17.583.363)	8.294.555.478 (2.497.649)	32.332.225.614 -	154.659.670 -
600.260.374 23.451.764 - - 68.000.000 2.166.478 26.506 -	93.838.772.188 1.812.865.677 20.903.371.000 4.562.360 3.000.000.000 269.251.286 1.710 -	8.292.057.829 101.083.408 262.671.000 - - 42.972.536 9.609 -	32.332.225.614 1.682.678.127 - 3.112.590 24.771.731.345 45.837.616 1.841 -	154.659.670 896.662 - 52.381 424.000.000 135.308 7.370 -
<b>693.905.122</b>	<b>119.828.824.221</b>	<b>8.698.794.382</b>	<b>58.835.587.133</b>	<b>579.751.391</b>
- 2.466.430 - 75.933 - 66.069 2.608.432	- 48.878.248 - 505.635.142 18.062.045 - 15.251.592 587.827.027	- 49.225.012 - 1.466.604 - 400.900 51.092.516	- 690.607.650 - 268.428.396 9.913.714 - 1.111.298 970.061.058	- 19.673.970 - 1.244.316 3.136 - 23.848 20.945.270
<b>691.296.690</b>	<b>119.240.997.194</b>	<b>8.647.701.866</b>	<b>57.865.526.075</b>	<b>558.806.121</b>

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

## JPMorgan Liquidity Funds

Kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens  
für den Berichtszeitraum vom 1. Dezember 2023 bis zum 31. Mai 2024

	Kombiniert USD
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums*	235.371.555.485
<b>Erträge</b>	
Zinserträge aus Anlagen nach Abzug von Quellensteuern	6.488.699.492
Bankzinsen	85.751.658
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>6.574.451.150</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühren	221.377.399
Gebühren der Verwahrstelle, der Verwaltungsgesellschaft, der Verwaltungs- und der Domizilierungsstelle	10.772.236
Gebühren der Register- und der Transferstelle	3.426.120
Taxe d'abonnement	2.881.104
Sonstige Aufwendungen**	1.609.904
Abzüglich: Honorarverzicht***	(600.144)
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>239.466.619</b>
<b>Nettoanlageerträge/(-verluste)</b>	<b>6.334.984.531</b>
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus:	
dem Verkauf von Vermögensanlagen	1.237.705
Finanztermingeschäften	143.651
Devisentermingeschäften	(478.113)
Devisen	99.071
<b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtszeitraum</b>	<b>1.002.314</b>
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns/(Verlusts) aus:	
Anlagen	(56.756.287)
Devisentermingeschäften	44.192
Devisen	(21.246)
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns/(Verlusts) im Berichtszeitraum</b>	<b>(56.733.341)</b>
<b>Erhöhung/(Verminderung) des Nettovermögens infolge von Transaktionen</b>	<b>6.279.253.504</b>
Zeichnungen	1.305.779.786.572
Rücknahmen	(1.304.570.015.033)
<b>Erhöhung/(Verminderung) des Nettovermögens infolge von Veränderungen des Aktienkapitals</b>	<b>1.209.771.539</b>
Ausschüttung	(5.160.352.230)
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>	<b>237.700.228.298</b>

\* Der Eröffnungsbestand wurde anhand der Wechselkurse zum 31. Mai 2024 bestimmt. Bei der Verwendung der Wechselkurse zum 30. November 2023 spiegelt dasselbe Nettovermögen einen Betrag von USD 235.283.524.879 wider.

\*\* Andere Aufwendungen umfassen hauptsächlich die Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrates, die Abschlussprüfungs- und Steuerberatungsgebühren und -auslagen, die Kosten für die Registrierung, die Veröffentlichung, den Versand, den Druck sowie die Rechts- und Marketingkosten.

\*\*\* Siehe Erläuterungen 4a), 4b) und 4c). Überschreiten die tatsächlichen Betriebskosten den Prozentsatz mit Obergrenze, wird der von der Verwaltungsgesellschaft übernommene Betrag in der kombinierten Aufstellung des Nettovermögens und der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens gesondert als „Honorarverzicht“ ausgewiesen.

Die beigefügten Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

## JPMorgan Liquidity Funds

Kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens (Fortsetzung)

für den Berichtszeitraum vom 1. Dezember 2023 bis zum 31. Mai 2024

JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund AUD	JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund EUR	JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund EUR	JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund SGD
1.389.496.210	21.010.191.951	3.336.670.539	2.034.188.717
32.602.688 1.766.795	474.496.336 195.289	81.742.125 12.058	34.267.400 1.452.227
34.369.483	474.691.625	81.754.183	35.719.627
1.372.117 201.162 64.973 19.882 129.198 (65.058)	19.260.155 1.766.693 240.734 303.473 169.381 (52.984)	1.994.472 489.963 276.293 214.771 101.592 (50.601)	1.568.586 316.103 71.856 27.009 130.571 (97.099)
1.722.274	21.687.452	3.026.490	2.017.026
32.647.209	453.004.173	78.727.693	33.702.601
- - - -	- - - -	456.596 73.763 (439.907) 91.154	- - - -
-	-	181.606	-
63.013 - -	(392.531) - -	678.272 40.661 (19.548)	(231.166) - -
63.013	(392.531)	699.385	(231.166)
32.710.222	452.611.642	79.608.684	33.471.435
2.669.741.026 (2.456.786.000)	60.806.446.383 (59.254.309.453)	2.574.741.371 (1.493.626.402)	5.629.822.826 (5.693.683.263)
212.955.026	1.552.136.930	1.081.114.969	(63.860.437)
(25.912.826)	(77.586.833)	-	(23.970.900)
1.609.248.632	22.937.353.690	4.497.394.192	1.979.828.815

## JPMorgan Liquidity Funds

Kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens (Fortsetzung)

für den Berichtszeitraum vom 1. Dezember 2023 bis zum 31. Mai 2024

	JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund GBP
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums*</b>	<b>13.990.440.084</b>
<b>Erträge</b>	
Zinserträge aus Anlagen nach Abzug von Quellensteuern	398.343.840
Bankzinsen	31.934
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>398.375.774</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühren	10.666.144
Gebühren der Verwahrstelle, der Verwaltungsgesellschaft, der Verwaltungs- und der Domizilierungsstelle	1.143.048
Gebühren der Register- und der Transferstelle	390.004
Taxe d'abonnement	217.846
Sonstige Aufwendungen**	124.119
Abzüglich: Honorarverzicht***	(72.320)
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>12.468.841</b>
<b>Nettoanlageerträge/(-verluste)</b>	<b>385.906.933</b>
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus:	
dem Verkauf von Vermögensanlagen	-
Finanztermingeschäften	-
Devisentermingeschäften	-
Devisen	-
<b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust) im Berichtszeitraum</b>	<b>-</b>
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns/(Verlusts) aus:	
Anlagen	(5.326.435)
Devisentermingeschäften	-
Devisen	-
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns/(Verlusts) im Berichtszeitraum</b>	<b>(5.326.435)</b>
<b>Erhöhung/(Verminderung) des Nettovermögens infolge von Transaktionen</b>	<b>380.580.498</b>
Zeichnungen	61.792.578.048
Rücknahmen	(61.616.634.856)
<b>Erhöhung/(Verminderung) des Nettovermögens infolge von Veränderungen des Aktienkapitals</b>	<b>175.943.192</b>
Ausschüttung	(359.023.190)
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>	<b>14.187.940.584</b>

\* Der Eröffnungsbestand wurde anhand der Wechselkurse zum 31. Mai 2024 bestimmt. Bei der Verwendung der Wechselkurse zum 30. November 2023 spiegelt dasselbe Nettovermögen einen Betrag von USD 235.283.524.879 wider.

\*\* Andere Aufwendungen umfassen hauptsächlich die Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrates, die Abschlussprüfungs- und Steuerberatungsgebühren und -auslagen, die Kosten für die Registrierung, die Veröffentlichung, den Versand, den Druck sowie die Rechts- und Marketingkosten.

\*\*\* Siehe Erläuterungen 4a), 4b) und 4c). Überschreiten die tatsächlichen Betriebskosten den Prozentsatz mit Obergrenze, wird der von der Verwaltungsgesellschaft übernommene Betrag in der kombinierten Aufstellung des Nettovermögens und der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens gesondert als „Honorarverzicht“ ausgewiesen.

Die beigefügten Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichts.

## JPMorgan Liquidity Funds

Kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens (Fortsetzung)

für den Berichtszeitraum vom 1. Dezember 2023 bis zum 31. Mai 2024

JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund GBP	JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund USD	JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund USD	JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund USD	JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1) EUR
596.532.852	124.184.557.977	5.872.962.792	57.810.508.351	-
18.182.323 1.012	3.478.779.276 48.032.583	201.418.532 2.440.601	1.624.083.061 32.757.828	1.265.886 -
<b>18.183.335</b>	<b>3.526.811.859</b>	<b>203.859.133</b>	<b>1.656.840.889</b>	<b>1.265.886</b>
432.542 169.970 48.790 34.033 75.778 (138.692)	113.965.326 3.801.653 1.419.283 1.320.200 431.447 (9.145)	7.246.649 692.157 289.665 381.256 120.939 (74.571)	60.823.908 1.782.488 498.921 251.683 311.363 (11.355)	4.973 - - 9.311 12.701 (7.371)
<b>622.421</b>	<b>120.928.764</b>	<b>8.656.095</b>	<b>63.657.008</b>	<b>19.614</b>
<b>17.560.914</b>	<b>3.405.883.095</b>	<b>195.203.038</b>	<b>1.593.183.881</b>	<b>1.246.272</b>
50.750 49.760 -	- - -	676.709 - -	- - -	- - -
<b>100.510</b>	<b>-</b>	<b>676.709</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
(526.040) -	(44.106.208) -	(5.365.128) -	- -	- -
<b>(526.040)</b>	<b>(44.106.208)</b>	<b>(5.365.128)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>17.135.384</b>	<b>3.361.776.887</b>	<b>190.514.619</b>	<b>1.593.183.881</b>	<b>1.246.272</b>
274.906.152 (197.277.698)	606.648.357.604 (611.925.872.135)	10.336.368.395 (7.752.143.940)	534.080.271.167 (534.064.636.150)	641.357.660 (82.553.495)
<b>77.628.454</b>	<b>(5.277.514.531)</b>	<b>2.584.224.455</b>	<b>15.635.017</b>	<b>558.804.165</b>
-	(3.027.823.139)	-	(1.553.801.174)	(1.244.316)
<b>691.296.690</b>	<b>119.240.997.194</b>	<b>8.647.701.866</b>	<b>57.865.526.075</b>	<b>558.806.121</b>

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

## JPMorgan Liquidity Funds

Aufstellung der Veränderung der Anzahl der Aktien

für den Berichtszeitraum vom 1. Dezember 2023 bis zum 31. Mai 2024

	Aktien im Umlauf am Anfang des Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Zurückgenommene Aktien	Aktien im Umlauf am Ende des Berichtszeitraums
<b>JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund</b>				
JPM AUD Liquidity LVNAV A (acc.)	3.109,474	1.967,042	1.055,070	4.021,446
JPM AUD Liquidity LVNAV Agency (dist.)	57.036.042,150	281.790.613,670	255.634.990,330	83.191.665,490
JPM AUD Liquidity LVNAV B (acc.)	5,618	1,554	-	7,172
JPM AUD Liquidity LVNAV C (acc.)	17.193,902	12.363,239	8.970,416	20.586,725
JPM AUD Liquidity LVNAV C (dist.)	21.794.262,110	93.677.290,290	36.398.043,440	79.073.508,960
JPM AUD Liquidity LVNAV E (acc.)	974,615	3.581,866	1.848,384	2.708,097
JPM AUD Liquidity LVNAV E (dist.)	17.579.751,080	1.575.406,320	11.680.618,450	7.474.538,950
JPM AUD Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	1.017.748.570,380	2.064.521.459,290	1.999.850.472,950	1.082.419.556,720
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund</b>				
JPM EUR Liquidity LVNAV A (acc.)	13.427,929	7.642,464	9.208,523	11.861,870
JPM EUR Liquidity LVNAV A (acc.)	118.497,020	54.500,288	72.225,932	100.771,376
JPM EUR Liquidity LVNAV Capital (dist.)	358.699.009,410	2.280.801.162,810	2.079.956.182,740	559.543.989,480
JPM EUR Liquidity LVNAV D (acc.)	536,517	425,035	437,369	524,183
JPM EUR Liquidity LVNAV E (acc.)	169.795,241	267.365,913	169.747,503	267.413,651
JPM EUR Liquidity LVNAV E (dist.)	57.718.424,490	177.373.929,950	113.391.625,606	121.700.728,834
JPM EUR Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	2.113.490.612,500	12.104.105.212,990	10.657.091.270,186	3.560.504.555,304
JPM EUR Liquidity LVNAV Institutional (TO acc.)	1.252.313,165	3.426.168,722	3.466.460,770	1.212.021,117
JPM EUR Liquidity LVNAV W (acc.)	64.372,531	52.672,736	86.493,101	30.552,166
JPM EUR Liquidity LVNAV W (dist.)	-	10.221.971,300	-	10.221.971,300
JPM EUR Liquidity LVNAV X (acc.)	239,098	1,951	10,430	230,619
JPM EUR Liquidity LVNAV X (dist.)	307.790.344,110	1.252.747.020,060	1.233.606.732,500	326.930.631,670
JPM EUR Liquidity LVNAV X (TO acc.)	178.952,092	601.317,183	621.237,644	159.031,631
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund</b>				
JPM EUR Standard Money Market VNAV A (acc.)	16.901,762	4.264,793	6.030,869	15.135,686
JPM EUR Standard Money Market VNAV B (acc.)	71,899	-	28,899	43,000
JPM EUR Standard Money Market VNAV C (acc.)	24.539,842	16.010,660	13.461,767	27.088,735
JPM EUR Standard Money Market VNAV Capital (acc.)	225,981	728,526	714,522	239,985
JPM EUR Standard Money Market VNAV D (acc.)	782,236	54,193	259,877	576,552
JPM EUR Standard Money Market VNAV E (acc.)	175.923,683	184.537,815	70.116,358	290.345,140
JPM EUR Standard Money Market VNAV Institutional (acc.)	60.157,506	41.483,502	46.315,344	55.325,664
JPM EUR Standard Money Market VNAV R (acc.)	7.220,390	210,995	1.701,008	5.730,377
JPM EUR Standard Money Market VNAV S (acc.)	33.076,472	-	-	33.076,472
JPM EUR Standard Money Market VNAV W (acc.)	6.651,617	2.096,473	4.623,225	4.124,865
JPM EUR Standard Money Market VNAV X (acc.)	1.379,395	466,823	1.529,503	316,715
<b>JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund</b>				
JPM SGD Liquidity LVNAV Agency (dist.)	20.613.335,470	9.956.074,450	13.052.414,850	17.516.995,070
JPM SGD Liquidity LVNAV C (acc.)	42.302,662	51.480,964	53.144,066	40.639,560
JPM SGD Liquidity LVNAV C (dist.)	56.335.113,440	32.568.037,920	27.569.269,474	61.333.881,886
JPM SGD Liquidity LVNAV E (acc.)	5,000	-	-	5,000
JPM SGD Liquidity LVNAV E (dist.)	52.310,340	812.753,520	811.797,480	53.266,380
JPM SGD Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	1.492.481.317,246	5.017.096.384,350	5.062.893.024,543	1.446.684.677,053
<b>JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund</b>				
JPM GBP Liquidity LVNAV A (acc.)	379,464	326,625	180,143	525,946
JPM GBP Liquidity LVNAV Agency (dist.)	54.722.242,070	193.404.675,170	191.463.205,280	56.663.711,960
JPM GBP Liquidity LVNAV C (acc.)	24.452,449	10.264,791	15.854,083	18.863,157
JPM GBP Liquidity LVNAV C (dist.)	61.944.884,265	31.453.586,360	27.540.298,597	65.858.172,028
JPM GBP Liquidity LVNAV Capital (dist.)	2.372.687.784,071	25.550.640.969,820	25.307.696.025,576	2.615.632.728,315
JPM GBP Liquidity LVNAV D (acc.)	121,985	188,116	11,871	298,230
JPM GBP Liquidity LVNAV E (acc.)	13.558,721	27.725,996	11.137,139	30.147,578
JPM GBP Liquidity LVNAV E (dist.)	2.666.617.292,683	2.171.931.215,477	1.921.149.638,241	2.917.398.869,919
JPM GBP Liquidity LVNAV G (acc.)	11.530,513	6.523,611	3.930,189	14.123,935
JPM GBP Liquidity LVNAV G (dist.)	118.301.616,980	102.175.983,720	47.694.259,220	172.783.341,480
JPM GBP Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	7.098.698.767,770	28.609.478.373,820	29.095.955.647,577	6.612.221.494,013
JPM GBP Liquidity LVNAV Premier (dist.)	14.723.554,170	159.407.550,670	155.165.877,450	18.965.227,390
JPM GBP Liquidity LVNAV R (acc.)	5,000	5,056	-	10,056
JPM GBP Liquidity LVNAV R (dist.)	64.246.338,560	1.989.206,210	57.693.440,640	8.542.104,130
JPM GBP Liquidity LVNAV Reserves (dist.)	170.609,587	24.112,650	114,620	194.607,617
JPM GBP Liquidity LVNAV W (acc.)	10.273,826	4.436,623	6.075,017	8.635,432
JPM GBP Liquidity LVNAV W (dist.)	50.402.244,302	2.186.988.951,770	2.124.600.141,290	112.791.054,782
JPM GBP Liquidity LVNAV X (acc.)	32.565,482	4.086,815	2.556,423	34.095,874
JPM GBP Liquidity LVNAV X (dist.)	495.355.086,600	2.197.271.339,740	2.251.175.683,330	441.450.743,010
<b>JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund</b>				
JPM GBP Standard Money Market VNAV A (acc.)	4.582,164	790,423	1.077,647	4.294,940
JPM GBP Standard Money Market VNAV B (acc.)	72,980	3,602	20,954	55,628
JPM GBP Standard Money Market VNAV C (acc.)	7.328,030	1.610,500	2.408,067	6.530,463
JPM GBP Standard Money Market VNAV Capital (acc.)	5,000	-	-	5,000
JPM GBP Standard Money Market VNAV D (acc.)	434,435	39,083	73,551	399,967
JPM GBP Standard Money Market VNAV E (acc.)	32.999,585	7.365,711	3.812,789	36.552,507
JPM GBP Standard Money Market VNAV Institutional (acc.)	470,919	11.117,394	5.642,068	5.946,245
JPM GBP Standard Money Market VNAV Morgan (acc.)	5,598	-	-	5,598
JPM GBP Standard Money Market VNAV R (acc.)	253,949	30,698	27,011	257,636
JPM GBP Standard Money Market VNAV W (acc.)	2.645,727	615,251	348,623	2.912,355
JPM GBP Standard Money Market VNAV X (acc.)	152,309	1.664,592	1.815,748	1,153

## JPMorgan Liquidity Funds

Aufstellung der Veränderung der Anzahl der Aktien (Fortsetzung)  
für den Berichtszeitraum vom 1. Dezember 2023 bis zum 31. Mai 2024

	Aktien im Umlauf am Anfang des Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Zurückgenommene Aktien	Aktien im Umlauf am Ende des Berichtszeitraums
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund</b>				
JPM USD Liquidity LVNAV A (acc.)	26.625,755	22.767,898	23.958,322	25.435,331
JPM USD Liquidity LVNAV Agency (dist.)	737.988.221,276	34.550.314.761,760	34.518.367.386,590	769.935.596,446
JPM USD Liquidity LVNAV C (acc.)	147.910,875	204.656,090	151.283,177	201.283,788
JPM USD Liquidity LVNAV C (dist.)	4.041.865.164,884	26.181.058.498,890	25.309.913.141,063	4.913.010.522,711
JPM USD Liquidity LVNAV Capital (acc.)	1.811,645	182,967	345,355	1.649,257
JPM USD Liquidity LVNAV Capital (dist.)	21.804.544.954,670	142.484.455.986,180	144.629.988.604,670	19.659.012.336,180
JPM USD Liquidity LVNAV D (acc.)	905,453	558,658	739,681	724,430
JPM USD Liquidity LVNAV E (acc.)	109.244,961	164.712,264	115.242,688	158.714,537
JPM USD Liquidity LVNAV E (dist.)	3.069.967.406,643	3.600.622.181,142	2.986.482.000,467	3.684.107.587,318
JPM USD Liquidity LVNAV G (acc.)	61.786,458	24.472,434	24.744,008	61.514,884
JPM USD Liquidity LVNAV G (dist.)	518.306.634,836	2.328.106.556,340	2.220.316.439,046	626.096.752,130
JPM USD Liquidity LVNAV Institutional (acc.)	32.762,269	105.252,297	108.830,883	29.183,683
JPM USD Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	68.007.149.219,266	306.677.059.896,750	314.727.065.569,993	59.957.143.546,023
JPM USD Liquidity LVNAV Morgan (dist.)	73.472.439,339	6.847.104.625,520	6.860.929.024,943	59.648.039,916
JPM USD Liquidity LVNAV Premier (dist.)	3.969.026.738,734	17.480.819.881,940	17.992.366.735,510	3.457.479.885,164
JPM USD Liquidity LVNAV R (acc.)	5,000	568,634	23,949	549,685
JPM USD Liquidity LVNAV R (dist.)	126.447.147,100	21.818.312,720	41.165.216,980	107.100.242,840
JPM USD Liquidity LVNAV Reserves (dist.)	29.788.677,140	47.813.099,720	36.941.423,660	40.660.353,200
JPM USD Liquidity LVNAV W (acc.)	687.582,184	1.026.164,343	936.894,077	776.852,450
JPM USD Liquidity LVNAV W (dist.)	5.316.523.584,418	7.940.532.105,030	6.922.145.594,567	6.334.910.094,881
JPM USD Liquidity LVNAV X (dist.)	4.723.359.641,432	41.138.402.934,320	40.392.508.035,955	5.469.254.539,797
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund</b>				
JPM USD Standard Money Market VNAV A (acc.)	68.542,190	72.619,805	51.405,695	89.756,300
JPM USD Standard Money Market VNAV B (acc.)	4.517,290	22.913,770	14.741,854	12.689,206
JPM USD Standard Money Market VNAV C (acc.)	70.528,872	120.495,767	65.097,615	125.927,024
JPM USD Standard Money Market VNAV Capital (acc.)	4.833,086	6.976,501	1.859,448	9.950,139
JPM USD Standard Money Market VNAV D (acc.)	6.877,081	12.114,321	7.664,547	11.326,855
JPM USD Standard Money Market VNAV E (acc.)	66.542,381	101.401,580	96.050,669	71.893,292
JPM USD Standard Money Market VNAV G (acc.)	15.980,747	3.842,355	811,808	19.011,294
JPM USD Standard Money Market VNAV Institutional (acc.)	23.263,200	66.276,938	18.523,852	71.016,286
JPM USD Standard Money Market VNAV R (acc.)	274,212	3.001,004	271,886	3.003,330
JPM USD Standard Money Market VNAV W (acc.)	200.157,343	258.400,290	227.015,230	231.542,403
JPM USD Standard Money Market VNAV X (acc.)	5.670,701	108.585,524	101.549,584	12.706,641
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund</b>				
JPM USD Treasury CNAV A (acc.)	7.004,056	5.933,300	3.504,373	9.432,983
JPM USD Treasury CNAV Agency (dist.)	1.839.777.035,090	235.822.506.382,310	234.787.802.449,080	2.874.480.968,320
JPM USD Treasury CNAV C (acc.)	67.266,107	70.025,942	39.144,917	98.147,132
JPM USD Treasury CNAV C (dist.)	5.007.641.806,783	32.769.759.359,830	34.145.378.828,060	3.632.022.338,553
JPM USD Treasury CNAV Capital (acc.)	45.809,983	3.422,597	22.643,843	26.588,737
JPM USD Treasury CNAV Capital (dist.)	6.212.875.817,910	38.522.586.237,930	34.349.182.276,760	10.386.279.779,080
JPM USD Treasury CNAV D (acc.)	1.003,061	7,463	342,784	667,740
JPM USD Treasury CNAV E (acc.)	11.473,809	5.566,335	2.426,486	14.613,658
JPM USD Treasury CNAV E (dist.)	441.306.648,644	991.739.246,090	817.751.821,324	615.294.073,410
JPM USD Treasury CNAV Institutional (acc.)	13.259,988	18.556,373	24.409,378	7.406,983
JPM USD Treasury CNAV Institutional (dist.)	40.884.767.398,915	206.039.924.528,912	210.430.803.085,581	36.493.888.842,246
JPM USD Treasury CNAV Morgan (dist.)	104.606.559,400	12.189.943.677,170	12.180.023.245,470	114.526.991,100
JPM USD Treasury CNAV Premier (dist.)	871.162.695,772	6.383.018.073,670	5.852.300.782,770	1.401.879.986,672
JPM USD Treasury CNAV R (acc.)	5,000	28,453	-	33,453
JPM USD Treasury CNAV Reserves (dist.)	25.071.345,350	100.769.276,760	98.525.589,910	27.315.032,200
JPM USD Treasury CNAV W (acc.)	5,000	-	-	5,000
JPM USD Treasury CNAV X (dist.)	859.994.586,802	112.200.680,680	385.719.688,610	586.475.578,872
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)</b>				
JPM EUR Government CNAV C (acc.)	-	50,357	0,001	50,356
JPM EUR Government CNAV Capital (dist.)	-	500.000,000	450.000,000	50.000,000
JPM EUR Government CNAV E (dist.)	-	500.000,000	450.000,000	50.000,000
JPM EUR Government CNAV G (dist.)	-	500.000,000	450.000,000	50.000,000
JPM EUR Government CNAV Institutional (dist.)	-	5.501.500,000	5.451.000,000	50.500,000
JPM EUR Government CNAV S (dist.)	-	602.800.201,000	44.800.100,000	558.000.101,000
JPM EUR Government CNAV W (TO acc.)	-	50,000	44,917	5,083
JPM EUR Government CNAV X (dist.)	-	500.000,000	450.000,000	50.000,000

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

JPMorgan Liquidity Funds  
Statistische Angaben

	Nettoinventarwert pro Aktie in Aktienklassenwahrung		
	NIW pro Aktie zum 31. Mai 2024	NIW pro Aktie zum 30. November 2023	NIW pro Aktie zum 30. November 2022
<b>JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund</b>			
JPM AUD Liquidity LVNAV A (acc.)	12.871,76	12.623,50	12.225,74
JPM AUD Liquidity LVNAV Agency (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM AUD Liquidity LVNAV B (acc.)	13.022,51	12.764,90	12.350,27
JPM AUD Liquidity LVNAV C (acc.)	13.431,16	13.149,48	12.691,92
JPM AUD Liquidity LVNAV C (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM AUD Liquidity LVNAV E (acc.)	10.690,90	10.461,40	10.087,25
JPM AUD Liquidity LVNAV E (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM AUD Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	1,00	1,00	1,00
<b>Nettovermogen insgesamt in AUD</b>	<b>1.609.248.632</b>	<b>1.389.496.210</b>	<b>666.781.137</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund</b>			
JPM EUR Liquidity LVNAV A (acc.)	10.453,46	10.271,87	10.015,15
JPM EUR Liquidity LVNAV C (acc.)	10.274,70	10.078,88	9.793,63
JPM EUR Liquidity LVNAV Capital (dist.)	1,00	1,00	-
JPM EUR Liquidity LVNAV D (acc.)	10.436,41	10.260,31	10.013,92
JPM EUR Liquidity LVNAV E (acc.)	10.292,72	10.091,45	9.796,04
JPM EUR Liquidity LVNAV E (dist.)	1,00	1,00	-
JPM EUR Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	1,00	1,00	-
JPM EUR Liquidity LVNAV Institutional (TO acc.)	10.290,41	10.094,30	9.808,62
JPM EUR Liquidity LVNAV W (acc.)	10.491,01	10.288,47	-
JPM EUR Liquidity LVNAV W (dist.)	1,00	-	-
JPM EUR Liquidity LVNAV X (acc.)	10.376,36	10.170,37	9.866,72
JPM EUR Liquidity LVNAV X (dist.)	1,00	1,00	-
JPM EUR Liquidity LVNAV X (TO acc.)	10.350,42	10.143,89	9.839,01
<b>Nettovermogen insgesamt in EUR</b>	<b>22.937.353.690</b>	<b>21.010.191.951</b>	<b>18.064.551.482</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund</b>			
JPM EUR Standard Money Market VNAV A (acc.)	10.478,76	10.292,05	10.012,74
JPM EUR Standard Money Market VNAV B (acc.)	10.498,14	10.305,87	10.016,16
JPM EUR Standard Money Market VNAV C (acc.)	10.399,78	10.196,95	9.900,94
JPM EUR Standard Money Market VNAV Capital (acc.)	10.406,78	10.198,82	9.900,79
JPM EUR Standard Money Market VNAV D (acc.)	10.464,27	10.283,01	10.010,92
JPM EUR Standard Money Market VNAV E (acc.)	10.408,71	10.200,54	9.900,48
JPM EUR Standard Money Market VNAV Institutional (acc.)	10.399,79	10.196,94	9.900,96
JPM EUR Standard Money Market VNAV R (acc.)	10.399,86	10.197,01	9.900,94
JPM EUR Standard Money Market VNAV S (acc.)	10.422,98	10.211,93	9.909,61
JPM EUR Standard Money Market VNAV W (acc.)	10.404,07	10.198,51	9.900,49
JPM EUR Standard Money Market VNAV X (acc.)	10.521,07	10.307,51	10.001,90
<b>Nettovermogen insgesamt in EUR</b>	<b>4.497.394.192</b>	<b>3.336.670.539</b>	<b>1.512.791.673</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund</b>			
JPM SGD Liquidity LVNAV Agency (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM SGD Liquidity LVNAV C (acc.)	11.179,76	10.983,85	10.600,25
JPM SGD Liquidity LVNAV C (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM SGD Liquidity LVNAV E (acc.)	10.685,53	10.492,96	10.116,38
JPM SGD Liquidity LVNAV E (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM SGD Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	1,00	1,00	1,00
<b>Nettovermogen insgesamt in SGD</b>	<b>1.979.828.815</b>	<b>2.034.188.717</b>	<b>1.025.058.167</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund</b>			
JPM GBP Liquidity LVNAV A (acc.)	10.712,99	10.459,65	10.047,61
JPM GBP Liquidity LVNAV Agency (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM GBP Liquidity LVNAV C (acc.)	10.911,07	10.634,69	10.181,09
JPM GBP Liquidity LVNAV C (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM GBP Liquidity LVNAV Capital (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM GBP Liquidity LVNAV D (acc.)	10.695,17	10.447,48	10.045,97
JPM GBP Liquidity LVNAV E (acc.)	10.956,11	10.673,20	10.207,75
JPM GBP Liquidity LVNAV E (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM GBP Liquidity LVNAV G (acc.)	10.956,14	10.673,23	10.207,76
JPM GBP Liquidity LVNAV G (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM GBP Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM GBP Liquidity LVNAV Premier (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM GBP Liquidity LVNAV R (acc.)	10.524,17	10.257,65	-
JPM GBP Liquidity LVNAV R (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM GBP Liquidity LVNAV Reserves (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM GBP Liquidity LVNAV W (acc.)	10.932,72	10.653,11	10.193,45
JPM GBP Liquidity LVNAV W (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM GBP Liquidity LVNAV X (acc.)	10.987,04	10.700,09	10.227,32
JPM GBP Liquidity LVNAV X (dist.)	1,00	1,00	1,00
<b>Nettovermogen insgesamt in GBP</b>	<b>14.187.940.584</b>	<b>13.990.440.084</b>	<b>12.922.890.412</b>



**JPMorgan Liquidity Funds**  
*Statistische Angaben (Fortsetzung)*

	Nettoinventarwert pro Aktie in Aktienklassenwahrung		
	NIW pro Aktie zum 31. Mai 2024	NIW pro Aktie zum 30. November 2023	NIW pro Aktie zum 30. November 2022
<b>JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund</b>			
JPM GBP Standard Money Market VNAV A (acc.)	16.173,79	15.786,42	15.152,72
JPM GBP Standard Money Market VNAV B (acc.)	13.535,98	13.205,07	12.662,22
JPM GBP Standard Money Market VNAV C (acc.)	17.570,35	17.120,05	16.377,06
JPM GBP Standard Money Market VNAV Capital (acc.)	10.750,88	10.472,61	10.013,04
JPM GBP Standard Money Market VNAV D (acc.)	11.144,04	10.882,62	10.456,22
JPM GBP Standard Money Market VNAV E (acc.)	11.022,83	10.734,91	10.258,77
JPM GBP Standard Money Market VNAV Institutional (acc.)	10.742,37	10.467,06	10.012,82
JPM GBP Standard Money Market VNAV Morgan (acc.)	10.722,24	10.467,55	10.051,32
JPM GBP Standard Money Market VNAV R (acc.)	11.113,28	10.828,44	10.358,49
JPM GBP Standard Money Market VNAV W (acc.)	11.019,34	10.734,20	10.263,21
JPM GBP Standard Money Market VNAV X (acc.)	17.634,77	17.148,11	16.377,23
<b>Nettovermogen insgesamt in GBP</b>	<b>691.296.690</b>	<b>596.532.852</b>	<b>612.134.116</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund</b>			
JPM USD Liquidity LVNAV A (acc.)	11.121,03	10.846,86	10.354,66
JPM USD Liquidity LVNAV Agency (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Liquidity LVNAV C (acc.)	11.270,69	10.973,95	10.440,42
JPM USD Liquidity LVNAV C (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Liquidity LVNAV Capital (acc.)	10.883,79	10.594,56	10.074,25
JPM USD Liquidity LVNAV Capital (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Liquidity LVNAV D (acc.)	10.787,45	10.526,83	10.059,21
JPM USD Liquidity LVNAV E (acc.)	11.322,31	11.018,64	10.472,47
JPM USD Liquidity LVNAV E (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Liquidity LVNAV G (acc.)	11.322,25	11.018,58	10.472,49
JPM USD Liquidity LVNAV G (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Liquidity LVNAV Institutional (acc.)	11.270,54	10.973,81	10.440,29
JPM USD Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Liquidity LVNAV Morgan (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Liquidity LVNAV Premier (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Liquidity LVNAV R (acc.)	10.562,03	10.283,94	-
JPM USD Liquidity LVNAV R (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Liquidity LVNAV Reserves (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Liquidity LVNAV W (acc.)	11.293,44	10.993,32	10.453,65
JPM USD Liquidity LVNAV W (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Liquidity LVNAV X (dist.)	1,00	1,00	1,00
<b>Nettovermogen insgesamt in USD</b>	<b>119.240.997.194</b>	<b>124.184.557.977</b>	<b>102.646.306.923</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund</b>			
JPM USD Standard Money Market VNAV A (acc.)	15.182,89	14.799,75	14.102,96
JPM USD Standard Money Market VNAV B (acc.)	14.523,24	14.149,59	13.469,93
JPM USD Standard Money Market VNAV C (acc.)	16.151,63	15.717,01	14.926,20
JPM USD Standard Money Market VNAV Capital (acc.)	10.848,76	10.554,16	10.018,01
JPM USD Standard Money Market VNAV D (acc.)	11.366,37	11.085,15	10.573,81
JPM USD Standard Money Market VNAV E (acc.)	11.553,65	11.237,07	10.661,00
JPM USD Standard Money Market VNAV G (acc.)	11.553,90	11.237,32	10.661,24
JPM USD Standard Money Market VNAV Institutional (acc.)	11.686,36	11.371,89	10.799,71
JPM USD Standard Money Market VNAV R (acc.)	11.692,10	11.377,47	10.805,01
JPM USD Standard Money Market VNAV W (acc.)	11.661,95	11.345,26	10.769,04
JPM USD Standard Money Market VNAV X (acc.)	16.879,22	16.411,73	15.560,99
<b>Nettovermogen insgesamt in USD</b>	<b>8.647.701.866</b>	<b>5.872.962.792</b>	<b>4.278.372.617</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund</b>			
JPM USD Treasury CNAV A (acc.)	10.785,85	10.526,21	10.073,52
JPM USD Treasury CNAV Agency (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Treasury CNAV C (acc.)	11.157,78	10.870,49	10.367,68
JPM USD Treasury CNAV C (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Treasury CNAV Capital (acc.)	10.893,92	10.610,74	10.114,89
JPM USD Treasury CNAV Capital (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Treasury CNAV D (acc.)	10.765,85	10.512,00	10.069,98
JPM USD Treasury CNAV E (acc.)	10.874,26	10.588,91	10.089,03
JPM USD Treasury CNAV E (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Treasury CNAV Institutional (acc.)	10.848,22	10.568,89	10.080,04
JPM USD Treasury CNAV Institutional (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Treasury CNAV Morgan (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Treasury CNAV Premier (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Treasury CNAV R (acc.)	10.552,77	10.281,08	-
JPM USD Treasury CNAV Reserves (dist.)	1,00	1,00	1,00
JPM USD Treasury CNAV W (acc.)	10.548,30	10.274,17	-
JPM USD Treasury CNAV X (dist.)	1,00	1,00	1,00
<b>Nettovermogen insgesamt in USD</b>	<b>57.865.526.075</b>	<b>57.810.508.351</b>	<b>37.451.236.724</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)</b>			
JPM EUR Government CNAV C (acc.)	10.020,26	-	-
JPM EUR Government CNAV Capital (dist.)	1,00	-	-
JPM EUR Government CNAV E (dist.)	1,00	-	-
JPM EUR Government CNAV G (dist.)	1,00	-	-
JPM EUR Government CNAV Institutional (dist.)	1,00	-	-
JPM EUR Government CNAV S (dist.)	1,00	-	-
JPM EUR Government CNAV W (TO acc.)	10.021,57	-	-
JPM EUR Government CNAV X (dist.)	1,00	-	-
<b>Nettovermogen insgesamt in EUR</b>	<b>558.806.121</b>	-	-

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

### 1. Organisation

JPMorgan Liquidity Funds (der „Fonds“ oder die „SICAV“) ist eine am 9. Dezember 1986 mit dem Namen J.P. Morgan Dollar Reserve Fund gegründete Investmentgesellschaft. Am 24. Oktober 1994 änderte die SICAV ihren Namen in J.P. Morgan Luxembourg Funds und wurde als Dachfonds mit mehreren Teilfonds umstrukturiert. Am 31. August 2001 änderte sich der Name in JPMorgan Fleming Liquidity Funds und am 24. November 2005 in JPMorgan Liquidity Funds.

Sie ist nach Teil I des luxemburgischen Gesetzes über Organismen für gemeinsame Anlagen vom 17. Dezember 2010 in seiner geänderten Fassung mit der Rechtsform einer Société Anonyme zugelassen und qualifiziert sich als Kapitalanlagegesellschaft mit variablem Kapital (Société d'Investissement à Capital Variable - SICAV). Zum 31. Mai 2024 besteht sie aus 10 Teilfonds mit jeweils getrennten Investmentportfolios, die sich aus Geldmarktinstrumenten, Barmitteln und anderweitigen Instrumenten zusammensetzen. Zum 3. Dezember 2018 wurde der Fonds gemäß der Verordnung (EU) 2017/1131 (die „Verordnung“) des Europäischen Parlaments und des Rates vom 14. Juni 2017 über Geldmarktfonds („MMF“) als Geldmarktfonds zugelassen.

Die SICAV bestellte JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l. am 25. Mai 2005 zur Verwaltungsgesellschaft. Seit 1. Juli 2011 agiert JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l. als Verwaltungsgesellschaft nach Kapitel 15 gemäß luxemburgischem Gesetz vom 17. Dezember 2010 in seiner geänderten Fassung und erfüllt die OGAW-Bestimmungen.

Die SICAV ist unter Nummer B 25 148 im luxemburgischen Handelsregister (Registre de Commerce et des Sociétés) eingetragen.

Jeder Teilfonds kann Aktien der Klassen A, B, C, D, E, G, R, S, W, X, Agency, Capital, Institutional, Morgan, Premier und Reserves beinhalten. Der JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund und der JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund können ebenfalls die Aktienklasse TO acc. enthalten. Die Aktienklassen können sich bezüglich des Mindestzeichnungsbetrags, Mindestbestands und/oder der jeweils für sie geltenden Anspruchsberechtigung, Referenzwährung, Gebühren und Kosten sowie Ausschüttungspolitik unterscheiden.

### 2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

Der Jahresabschluss wurde gemäß den luxemburgischen Vorschriften für Organismen für gemeinsame Anlagen nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt.

#### a) Bewertung der Vermögensanlagen

Alle Anlagen im Rahmen eines Constant Net Asset Value (CNAV) Teilfonds werden gemäß Artikel 31 und 32 der Verordnung über Geldmarktfonds (Geldmarktfondsverordnung) für Staatsschulden CNAV MMF und Low Volatility Net Asset Value (LVNAV) MMF Teilfonds nach der Methode der fortgeführten Anschaffungskosten bewertet und auf den nächsten Prozentpunkt oder seinen Gegenwert gerundet. Bei dieser Methode werden die Kosten der Anlage für die Amortisierung von Prämien und die Akkumulierung von Rabatten über die Haltedauer der Anlagen an die Erträge angepasst.

Bei einem LVNAV Teilfonds werden alle Anlagen mit einer Laufzeit von höchstens 75 Tagen nach der Methode der amortisierten Kosten bewertet, während Anlagen mit einer Laufzeit von mehr als 75 Tagen nach der Mark-to-Market- oder Mark-to-Model-Methode bewertet werden.

Wird die Methode der fortgeführten Anschaffungskosten angewandt, gelten folgende Regeln:

- Die Mark-to-Market (MTM)-Bewertung auf Instrumentenebene sollte von der Bewertung zu amortisierten Kosten nicht um mehr als 10 Bp. abweichen. Wird dieser Wert überschritten, muss das Instrument unter Verwendung von Mark-to-Market oder Mark-to-Model für die Zwecke des Handels-NIW bewertet werden. Die verbleibenden Vermögenswerte im Portfolio können hingegen zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet werden, und die Anleger handeln weiterhin mit einem NIW mit zwei Dezimalstellen.

- Die MTM-Bewertung auf Portfolioebene darf höchstens 20 Bp. vom handelbaren NIW abweichen. Wenn dieser Schwellenwert überschritten wird, werden die folgenden Zeichnungen und Rücknahmen mit einem NIW abgerechnet, der unter Verwendung der Mark-to-Market- oder Mark-to-Model-Methode berechnet und mit einem NIW mit vier Dezimalstellen herausgegeben wird. In Fällen, in denen die Methode der fortgeführten Anschaffungskosten zur Bewertung eines Wertpapiers nicht als umsichtiger Ansatz erscheint, wird der letzte verfügbare Preis an dem betreffenden Bewertungsstichtag verwendet.

Im Rahmen eines Teilfonds mit variablem Nettoinventarwert (VNAV) werden alle Anlagen zum Mark-to-Market bewertet. Wenn der Wert der Vermögenswerte der Teilfonds nicht nach der Mark-to-Market-Methode berechnet werden kann, wird ihr Wert konservativ mit Hilfe des Mark-to-Models bestimmt.

Der Nettoinventarwert je Aktie einer Klasse wird an jedem Tag, der ein Bewertungstag für den jeweiligen Teilfonds ist, berechnet. Ein „Bewertungstag“ ist ein Geschäftstag, mit Ausnahme – im Hinblick auf die Anlagen eines Teilfonds – eines Tages, an dem eine Börse oder ein Markt, an der beziehungsweise dem ein wesentlicher Teil der Anlagen des betreffenden Teilfonds gehandelt wird, geschlossen ist, oder während eines Zeitraums, in dem der Handel an einer solchen Börse beziehungsweise an einem solchen Markt beschränkt oder ausgesetzt ist. In Abweichung von dem oben Dargelegten kann die Verwaltungsgesellschaft, wenn der Handel an einer solchen Börse bzw. an einem solchen Markt beschränkt oder ausgesetzt ist, unter Berücksichtigung der herrschenden Marktlage oder anderer relevanter Faktoren bestimmen, dass ein solcher Geschäftstag ein Bewertungstag sein soll.

Teilfonds, deren Referenzwährung auf:

- AUD lautet, haben außer Samstag oder Sonntag an jedem Tag, an dem die Banken in Sydney geöffnet sind, einen Bewertungstag und an jedem weiteren von der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Tag;

- EUR lautet, haben außer Samstag oder Sonntag an jedem Tag, mit Ausnahme von Tagen, die von der Europäischen Zentralbank als ein TARGET-Feiertag (TARGET closing day) ausgewiesen wurden, einen Bewertungstag und an jedem weiteren von der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Tag;

- GBP lautet, haben an jedem Tag, an dem die Bank of England und die London Stock Exchange geöffnet sind, einen Bewertungstag und an jedem weiteren von der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Tag;

- SGD lautet, haben an jedem Tag, an dem die Monetary Authority of Singapore geöffnet ist, einen Bewertungstag und an jedem weiteren von der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Tag;

- USD lautet, haben an jedem Tag, an dem die Federal Reserve Bank of New York und die New York Stock Exchange geöffnet sind, einen Bewertungstag und an jedem weiteren von der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Tag.

Die SICAV in Luxemburg nimmt an jedem Bewertungstag des betreffenden Teilfonds Anträge zur Zeichnung, Rücknahme, Übertragung und Umwandlung der Aktienklassen entgegen. Eine Liste der Tage, die keine Bewertungstage sind, ist für jeden Teilfonds von der Transferstelle auf Wunsch erhältlich.

#### b) Realisierte und nicht realisierte Gewinne und Verluste aus Anlagen

Wertpapiertransaktionen werden zum Handelstag verbucht (das Ausführungsdatum der Kauf- bzw. Verkauforder).

Realisierte Gewinne und Verluste aus der Veräußerung von Wertpapierbeständen werden auf Grundlage des durchschnittlichen fortgeführten Anschaffungswerts berechnet. Die Wechselkursbewegungen zwischen dem Kauf- und dem Veräußerungsdatum der Wertpapiere werden in den realisierten Gewinnen und Verlusten aus Wertpapieren erfasst. Nicht realisierte Gewinne und Verluste aus Wertpapierbeständen errechnen sich aus den gesamten Anschaffungskosten und enthalten die dazugehörigen nicht realisierten Wechselkursgewinne bzw. -verluste.

Jeder Anlageverwalter darf nach eigenem Ermessen Wertpapiere über Händler kaufen und verkaufen, die dem Anlageverwalter statistische und anderweitige Research- und Analyseinformationen anbieten. Derartige von einem Händler bereitgestellte ergänzende Informationen, die zusätzlich zu den erforderlichen Dienstleistungen durchgeführt und von den Anlageverwaltern entsprechend dem relevanten Anlageverwaltungsvertrag verlangt werden, sowie die Aufwendungen, die den Anlageverwaltern entstehen, während Beratungsdienste der SICAV angeboten werden, führen aufgrund des Erhalts

## JPMorgan Liquidity Funds

### Erläuterungen zum ungeprüften Zwischenabschluss (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

solcher Informationen nicht unbedingt zu einer Reduzierung. Des Weiteren dürfen die Anlageverwalter Transaktionen bzw. Vereinbarungen mit anderen Mitgliedern von JPMorgan Chase & Co. abschließen.

#### c) Erfolgswirksame Verbuchung

Die Zinserträge werden täglich abgegrenzt und enthalten die Ab- und Zuschreibung von Auf- und Abgeldern, falls zutreffend. Bankzinserträge werden periodengerecht erfasst. Negative Einnahmen treten auf, wenn negative Zinsen aufgrund der Marktbedingungen vorherrschen und/oder wenn negative Nettozinsen bei umgekehrten Pensionsgeschäften entstehen, wie in Erläuterung 2 f) dargelegt.

#### d) Umrechnung von Fremdwährungen

Die Bücher und Aufzeichnungen jedes Teilfonds lauten auf die Basiswährung des jeweiligen Teilfonds. Auf andere Währungen lautende Beträge werden nach folgenden Regeln in die Basiswährung umgerechnet: (i) ursprünglich auf andere Währungen lautende Vermögensanlagebewertungen und andere Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden an jedem Geschäftstag anhand der an dem betreffenden Geschäftstag geltenden Wechselkurse in die Basiswährung umgerechnet; (ii) Käufe und Verkäufe ausländischer Anlagen, Erträge und Aufwendungen werden auf der Grundlage des am Tag der jeweiligen Transaktion geltenden Wechselkurses in die Basiswährung umgerechnet.

Falls zutreffend, sind realisierte und nicht realisierte Nettogewinne oder -verluste aus Devisentransaktionen: (i) Devisenkursgewinne und -verluste aus dem Verkauf oder dem Bestand von Devisen und auf Fremdwährung lautende äquivalente Barbestände; (ii) Gewinne und Verluste zwischen dem Handels- und dem Glatstellungdatum bei Wertpapier- und Devisentermingeschäften; (iii) Gewinne und Verluste aus der Differenz zwischen den verbuchten und den tatsächlich eingegangenen Zinsbeträgen; und (iv) Gewinne und Verluste aus der Wechselkursdifferenz zwischen aufgelaufenen Aufwendungen und den tatsächlich gezahlten Beträgen. Die daraus resultierenden Gewinne und Verluste aus der Umrechnung können, sofern zutreffend, unter „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen“ oder unter „Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns/(Verlusts) aus Devisentermingeschäften“ in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen werden.

#### e) Devisentermingeschäfte

Nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus offenen Devisentermingeschäften werden auf der Grundlage der vorliegenden Wechselkurse zum betreffenden Datum bewertet. Die Veränderungen dieser Beträge sind der kombinierten Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter „Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns/(Verlusts) aus Devisentermingeschäften“ zu entnehmen. Bei Glatstellung des Vertrags wird der realisierte Gewinn/(Verlust) unter „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften“ in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die nicht realisierten Gewinne und Verluste werden unter „Nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Devisentermingeschäften“ in der kombinierten Aufstellung des Nettovermögens ausgewiesen.

#### f) Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Zur zusätzlichen Ertragszerzeugung, Kostensenkung oder Risikominimierung darf der Teilfonds Finanztechniken und -instrumente (wie z. B. umgekehrte Pensionsgeschäfte) im maximal zulässigen Umfang im Rahmen der niedergelegten Beschränkungen von (i) Artikel 11 der Bestimmung vom 8. Februar 2008 des Großherzogtums in Bezug auf bestimmte Definitionen des luxemburgischen Gesetzes, (ii) CSSF-Rundschreiben 08/356 in Bezug auf die anwendbaren Bestimmungen für Organismen für gemeinsame Anlagen, wenn sie bestimmte Verfahren und Instrumente bezüglich übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, (iii) CSSF-Rundschreiben 14/592 bezüglich ESMA-Richtlinien über ETF und andere OGAW-Emissionen und (iv) etwaige anderweitige anwendbare Gesetze, Bestimmungen, Rundschreiben bzw. CSSF-Positionen einsetzen.

Bei umgekehrten Pensionsgeschäften kann eine Gebühr für die Verwaltung der Sicherheiten im Rahmen von Servicevereinbarungen gelten, die zwischen Dritten und Fonds, Gegenparteien, Verwalter der Sicherheiten abgeschlossen werden, und die die optimale Übertragung der Sicherheiten zwischen dem Fonds und seinen Gegenparteien gewährleisten. Die Verwaltungsgebühren für Sicherheiten, anderweitige Verwaltungskosten (sofern zutreffend) sowie betreffende Transaktionsgebühren werden von der Verwahrstelle des Fonds berechnet und sind Bestandteil der Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen jeder Aktienklasse. Der Fonds hat aktuell Euroclear Bank, The Bank of New York Mellon, State Street Bank and Trust Company und JPMorgan Chase Bank, N.A für das Management der Sicherheiten bestellt. JPMorgan Chase Bank, N.A ist ein verbundenes Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft. Die Wertpapiere werden täglich zu den Mark-to-Market-Preisen bewertet und die erhaltenen Zinsen aus umgekehrten Pensionsgeschäften werden unter „Zinserträge aus der Anlage, abzüglich der Quellensteuer“ in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die erhaltenen Zinsen aus umgekehrten Pensionsgeschäften werden in der Einnahmen-Ausgaben-Rechnung erfasst.

Teilfonds	Nettozinsen
JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund	AUD 10.756.428
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund	EUR 83.100.197
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund	EUR 1.979.264
JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund	SGD 6.742.479
JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund	GBP 109.728.847
JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund	GBP 1.512.870
JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund	USD 235.411.058
JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund	USD 92.213
JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund	USD 635.086.254
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)	EUR 1.014.877

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

#### g) Fonds-Sammelkonten

Zur effizienten Verbuchung von Zeichnungen und Rücknahmen der Teilfonds führt die SICAV Devisen-Sammelkonten in EUR, USD, GBP, SGD und AUD an der Verwahrstelle im Namen des JPMorgan Liquidity Funds. Diese Devisen-Sammelkonten ermöglichen die tägliche Verbuchung der Zeichnungen und Rücknahmen sowie Dividendenzahlungen zwischen den Teilfonds und den Aktionären. Der Saldo dieser Konten wird gegebenenfalls nicht in der Berechnung des NIW für die betreffenden Teilfonds erfasst.

Bei einer vorzeitigen Bezahlung der Zeichnungen sind die Anleger bis zur Ausgabe der Aktien ungesicherte Gläubiger und genießen in der Zwischenzeit keinerlei Aktionärsrechte. Eine verspätete Bezahlung der Zeichnungen von Aktien kann so lange zu Zinsansprüchen führen, bis der Zahlungsbetrag für die Aktien vom Anleger eingeht; die Aktien sind zugunsten des Teilfonds verpfändet. Erfolgte keine valutagerechte Erfüllung der Bezahlung, können die Aktien durch deren Rücknahme auf Kosten des Anlegers zu einem beliebigen Zeitpunkt nach dem Zahlungsdatum annulliert werden.

Zur Erstellung dieses Abschlusses wurden alle Haben- und wesentlichen Sollsalten dieser Sammelkonten gegebenenfalls in die kombinierte Aufstellung des Nettovermögens der jeweiligen Teilfonds aufgenommen.

## JPMorgan Liquidity Funds

### Erläuterungen zum ungeprüften Zwischenabschluss (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

#### 3. Referenzwährung und Devisenkurse

Die Referenzwährung der SICAV, wie in den kombinierten Abschlüssen angegeben, ist USD. Die wichtigsten Wechselkurse, die zum 31. Mai 2024 zur Ermittlung der kombinierten Werte des Fonds in der Aufstellung des Nettovermögens und der Aufstellung und Entwicklung des Nettovermögens verwendet wurden, sind wie folgt:

1 USD =	1,5003 AUD;
1 USD =	0,9201 EUR;
1 USD =	0,7839 GBP;
1 USD =	1,3502 SGD.

#### 4. Gebühren und Aufwendungen

##### a) Gebührenstrukturen

Die Anlage in die SICAV ist generell über unterschiedliche Gebührenstrukturen möglich, die durch nachstehende Aktienklassen dargestellt werden: A (acc.), B (acc.), C (acc.), D (acc.), E (acc.), G (acc.), R (acc.), S (acc.), W (acc.), X (acc.), Capital (acc.), Institutional (acc.), Morgan (acc.), C (dist.), E (dist.), G (dist.), R (dist.), S (dist.), W (dist.), X (dist.), Agency (dist.), Capital (dist.), Institutional (dist.), Morgan (dist.), Premier (dist.), Reserves (dist.); sowie insbesondere nur für den JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund, G (TO acc.), Premier (TO acc.), Institutional (TO acc.), Agency (TO acc.), Morgan (TO acc.), Reserves (TO acc.), Capital (TO acc.), C (TO acc.), E (TO acc.), R (TO acc.) und W (TO acc.).

Die Aktien der Klasse X sollen einer alternativen Gebührenstruktur Rechnung tragen, bei der von der Verwaltungsgesellschaft oder dem jeweiligen Unternehmen von JPMorgan Chase & Co. auf administrativer Ebene eine Gebühr für die Verwaltung des Teilfonds erhoben und direkt bei dem Aktionär eingezogen wird.

Sämtliche Ausnahmen von den vorgenannten Gebührenstrukturen ergeben sich aus dem Verkaufsprospekt. Die tatsächlichen Gebühren und zu zahlenden Kosten, die jeder Aktienklasse berechnet werden, sind detailliert dem Anhang 1 dieses Berichts zu entnehmen.

##### b) Verwaltungsgebühren

Die SICAV zahlt der Verwaltungsgesellschaft eine Verwaltungsgebühr, die anhand eines Prozentsatzes vom durchschnittlichen täglichen Nettovermögenswert von jedem verwalteten Teilfonds bzw. von jeder Aktienklasse berechnet wird („Verwaltungsgebühren“). Die Verwaltungsgebühren laufen täglich auf und sind monatlich rückwirkend zu dem Höchstsatz zu begleichen, wie im betreffenden Abschnitt des Verkaufsprospekts angegeben. Die Verwaltungsgesellschaft entscheidet mitunter nach eigenem Ermessen (unter bestimmten Umständen täglich), den Satz zwischen dem Höchstsatz und 0,0% zu variieren. Im Verlauf des Berichtszeitraums hat die Verwaltungsgesellschaft die Verwaltungsgebühren für die nachstehenden Teilfonds reduziert:

JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

Die Verwaltungsgebühren des Teilfonds für die Aktienklasse X wird durch die Verwaltungsgesellschaft oder den entsprechenden Rechtsträger von JPMorgan Chase & Co direkt vom Aktionär administrativ erhoben und eingezogen.

Vorbehaltlich der im Verkaufsprospekt beschriebenen Anlagebeschränkungen können Teilfonds in andere von der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageverwaltern oder anderen Mitgliedern von JPMorgan Chase & Co. verwaltete Geldmarktfonds investieren. Gemäß dem Prospekt erfolgt keine Doppelbelastung von Gebühren. Die Vermeidung einer doppelten Belastung der jährlichen Verwaltungsgebühr zu Lasten der in solche Geldmarktfonds investierten Vermögenswerte wird in diesem Fall erreicht entweder durch a) die Ausnahme der Vermögenswerte von dem Nettovermögen, auf Grundlage dessen die jährlichen Verwaltungsgebühren berechnet werden, oder b) durch die Anlage in Geldmarktfonds über Aktienklassen, bei denen keine jährliche Verwaltungsgebühr sowie sonstigen vergleichbaren Gebühren, die an die Unternehmensgruppe des jeweiligen Anlageverwalters zahlbar sind, anfallen, oder c) indem die jährliche Verwaltungsgebühr mit einem dem Fonds oder Teilfonds gewährten Nachlass der jährlichen Verwaltungsgebühr (oder Vergleichbares) verrechnet wird, die den zugrunde liegenden Organismen, in die investiert werden soll, berechnet wird, oder d) indem lediglich die Differenz zwischen der in Anhang III „Einzelheiten zu den Teilfonds“ angegebenen jährlichen Verwaltungsgebühr des betreffenden Fonds oder Teilfonds und der entsprechenden Gebühr, die den zugrunde liegenden Geldmarktfonds in Rechnung gestellt wird, erhoben wird.

Die Verwaltungsgesellschaft kann mitunter im eigenen Ermessen die Gebühren und Kosten, die sie als Provision, Retrozession, Rabatt oder Abzug von einigen oder allen Investoren, Finanzintermediären oder Vertriebsdiensten erhält, auf der Grundlage (aber nicht ausschließlich) von Größe, Art, Timing oder Engagement des Investments ganz oder teilweise bezahlen.

##### c) Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen

Die SICAV übernimmt die gesamten üblichen Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen der im Verkaufsprospekt niedergelegten Sätze, um alle festen und variablen Kosten, Gebühren, Abgaben und sonstigen Kosten zu bestreiten, die im Zuge des Geschäftsbetriebs und der Verwaltung der SICAV mitunter anfallen.

Die Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen errechnen sich aus einem Prozentsatz des durchschnittlichen täglichen Nettovermögens von jedem Teilfonds oder von jeder Aktienklasse. Sie laufen täglich auf und sind monatlich rückwirkend zu einem Höchstsatz zu begleichen, der im betreffenden Abschnitt des Verkaufsprospekts angegeben ist.

Die Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen umfassen:

i) Aufwendungen, die die SICAV direkt eingegangen ist („Direktaufwendungen“), u. a. Verwahrstellengebühren, Auslagen und Gebühren von Abschlussprüfern, der luxemburgischen „Taxe d'abonnement“, Vergütungen der Verwaltungsratsmitglieder (Verwaltungsratsmitgliedern, die ebenfalls Verwaltungsratsmitglieder oder Mitarbeiter von JPMorgan Chase & Co. sind, wird keine Vergütung gezahlt) sowie angemessene Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder.

ii) Die Verwaltungsgesellschaft erhält eine „Bestandsvergütungsgebühr“, die dem verbleibenden Betrag der Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen nach Abzug der Spesen wie unter Abschnitt i) oben angegeben entspricht. Die Verwaltungsgesellschaft übernimmt alle Kosten in Verbindung mit dem täglichen Betrieb und der Verwaltung der SICAV, u. a. die Gründungskosten, wie zum Beispiel Organisations- und Eintragungskosten; die Buchhaltungskosten für Buchhaltungs- und administrative Dienstleistungen des Fonds; die Kosten der Transferstelle für die Dienstleistungen der Registrier- und Transferstelle; die



## JPMorgan Liquidity Funds

### Erläuterungen zum ungeprüften Zwischenabschluss (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Kosten der Dienste der Verwaltungs- und Domizilstelle; die Gebühren und die angemessenen Spesen und Auslagen der Zahlstelle und deren Vertreter; die Rechtsgebühren und -kosten; die laufenden Registrierungs- und Börsennotierungsgebühren, inklusive Umrechnungskosten; die Kosten für die Veröffentlichung des Aktienpreises sowie für Post, Telefon, Telefax und andere elektronische Kommunikation; und die Kosten und Aufwendungen für die Erstellung, den Druck und den Vertrieb des Verkaufsprospekts, der wesentlichen Anlegerinformationen bzw. etwaiger Zeichnungsdokumente, Finanzausweise sowie anderweitiger Dokumente, die dem Aktionär zur Verfügung gestellt werden.

In den Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen sind keine Transaktionsgebühren sowie außerordentliche Aufwendungen enthalten.

Die Verwaltungsgesellschaft kann im eigenen Ermessen vorübergehend die Direktkosten im Namen eines Teilfonds begleichen und/oder auf die Bestandsvergütungsgebühr ganz oder teilweise verzichten. Während des Berichtszeitraums hat die Verwaltungsgesellschaft vorübergehend die direkten Aufwendungen im Namen eines Teilfonds übernommen bzw. auf die gesamte oder einen Teil der Bestandsvergütungsgebühr der folgenden Teilfonds verzichtet:

JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund  
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

Die Gründungskosten der SICAV sowie die Kosten in Bezug auf die Schaffung neuer Teilfonds dürfen laut luxemburgischem Gesetz über einen Zeitraum von maximal 5 Jahren aktiviert und abgeschrieben werden.

Allgemeine Verwaltungskosten laufen gemäß der geltenden Kostenstruktur der jeweiligen Klasse täglich auf.

Bei allen Aktienklassen aller Teilfonds, mit Ausnahme von Aktien der Klassen X (acc.), X (dist.) und X (TO acc.), werden die Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen zu einem festen im betreffenden Abschnitt des Verkaufsprospekts festgelegten Satz bestimmt, wie in Anhang I dieses Berichts dargestellt. Die Verwaltungsgesellschaft trägt den Anteil an den tatsächlichen Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen, der den festgelegten Maximalsatz übersteigt. Dieser ist in der kombinierten Aufstellung des Nettovermögens und in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Nettovermögens gesondert als „Honorarverzicht“ ausgewiesen. Umgekehrt ist die Verwaltungsgesellschaft berechtigt, denjenigen Betrag, um welchen der feste Satz für Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen dieser Aktienklasse tatsächlich entstandenen Ausgaben übersteigt, einzubehalten.

Die von den Aktien der Klassen X (acc.), X (dist.) und X (TO acc.) aller Teilfonds getragenen Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen entsprechen dem niedrigeren der Werte der tatsächlichen Aufwendungen, die einer Aktienklasse zugewiesen werden, und dem im betreffenden Abschnitt des Verkaufsprospekts festgelegten Maximalsatz. Die Verwaltungsgesellschaft trägt den Anteil an Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen, der den festgelegten Maximalsatz übersteigt. Dieser ist in der kombinierten Aufstellung des Nettovermögens und in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Nettovermögens gesondert als „Honorarverzicht“ ausgewiesen. Wenn die Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen, die den Aktien der Klassen X (acc.) und X (dist.) zugewiesen werden, unter dem festgelegten Maximalsatz liegen, werden die Aufwendungen um den Fehlbetrag reduziert.

## 5. Dividendenpolitik

### a) Thesaurierende Aktienklassen mit dem Zusatz (acc.)

Auf die thesaurierenden Aktienklassen sämtlicher Teilfonds werden keine Ausschüttungen geleistet. Die gesamten Nettoanlageerträge werden wieder angelegt.

### b) Ausschüttende Aktienklassen mit dem Zusatz (dist.)

Dividendenausschüttungen werden entweder automatisch in Aktien derselben Klasse angelegt oder auf Wunsch des Aktionärs einem separaten Konto gutgeschrieben.

In Bezug auf einen bestimmten Teilfonds werden an einem Bewertungstag, an dem die Nettoanlageerträge positiv sind, alle oder im Wesentlichen alle Nettoanlageerträge (falls vorhanden), die auf alle offenen ausschüttenden Aktienklassen (flex) jedes Teilfonds entfallen, täglich als Dividende deklariert und monatlich ausgeschüttet. Der anrechenbare Nettoanlageertrag für derartige Aktien stimmt unter Umständen nicht genau mit dem Nettoanlageertrag überein, der aufgrund der Anlage eines etwaigen Teilfonds an einem Tag entsteht.

Ausschüttende Aktien jedes Teilfonds beginnen mit der Erzeugung von Dividenden an dem Bewertungstag, an dem sie ausgegeben werden. Falls während des Monats alle ausschüttenden Aktien des Teilfonds eines Anlegers zurückgenommen werden, sind aufgelaufene, aber noch nicht ausgeschüttete Dividenden mit den Rücknahmeerlösen zahlbar. Ausschüttende Aktien erzeugen am Bewertungstag, an dem die Rücknahme akzeptiert wird, keine Dividenden.

## 6. Besteuerung

Die SICAV unterliegt in Luxemburg nicht der Besteuerung ihrer Einkünfte, Gewinne oder Erträge. Die SICAV zahlt in Luxemburg keine Vermögenssteuer. Die SICAV führt in Luxemburg lediglich die Zeichnungssteuer („Taxe d’abonnement“) auf der Grundlage des zum Quartalsende betreffenden Nettoinventarwerts jeder Aktienklasse ab und vierteljährlich berechnet und bezahlt wird. Ein vermindelter Steuersatz von 0,01% jährlich vom Nettovermögen gilt für die Aktienklassen, die lediglich von institutionellen Anlegern gekauft und gehalten werden. Der oben beschriebene Steuersatz von 0,01% gilt nicht für den Anteil des Vermögens der SICAV, der in andere Organismen für gemeinsame Anlagen in Luxemburg investiert ist, die bereits der Taxe d’abonnement unterliegen.

Alle Aktienklassen der JPMorgan Liquidity Funds mit Ausnahme der JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund, JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund und JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund profitieren von einem verminderten Steuersatz der Taxe d’abonnement von 0,01%. Die folgenden Aktienklassen: G (dist.), X (dist.), Agency, Capital, Institutional, Morgan, Premier and Reserves sind von der Taxe d’abonnement freigestellt, weil sie die Bedingungen des Artikels 175 b) nach Gesetzen Luxemburgs erfüllen. Alle Aktienklassen der JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund, JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund und JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund entrichten eine Taxe d’abonnement von 0,01%.

In Luxemburg muss keine Stempel-, Gesellschafts- oder sonstige Steuer auf die Ausgabe von Aktien der SICAV gezahlt werden. Auf die realisierte oder nicht realisierte Wertsteigerung des Nettovermögens der SICAV ist im Großherzogtum Luxemburg keine Steuer zu zahlen. Die realisierten lang- oder kurzfristigen Kapitalerträge der SICAV unterliegen voraussichtlich nicht der Steuer in einem anderen Land. Der Aktionär sollte sich jedoch darüber im Klaren sein, dass eine derartige Möglichkeit nicht vollkommen auszuschließen ist. Die regelmäßigen Erträge der SICAV aus einigen ihrer Wertpapiere sowie Zinserträge aus Einlagen in bestimmten Ländern können unterschiedlichen Sätzen der Quellensteuer unterliegen, die normalerweise nicht erstattet wird.

## 7. Veränderungen des Wertpapierbestandes

Auf Anfrage ist am Sitz der SICAV eine Aufstellung kostenlos erhältlich, die für jede Vermögensanlage innerhalb eines Teilfonds alle Käufe und Verkäufe aufführt, die während des Berichtszeitraums erfolgt sind. Aktionäre können am Sitz der SICAV weitere Informationen über Vermögensanlagen innerhalb des Wertpapierbestandes jedes Teilfonds erhalten.

## 8. Erhaltene Sicherheiten in Bezug auf Finanztechniken und Instrumente

Von Gegenparteien erhaltene Vermögenswerte in umgekehrten Pensionsgeschäften stellen die Sicherheit dar.

Die SICAV schließt nur Transaktionen mit Gegenparteien ab, von deren Kreditwürdigkeit die Verwaltungsgesellschaft überzeugt ist. Die genehmigten Gegenparteien haben in der Regel ein öffentliches Rating von A- oder darüber. Die Gegenparteien erfüllen Aufsichtsbestimmungen, die von der CSSF als mit denen des Gemeinschaftsrechts gleichwertig erachtet werden. Die Gegenpartei hat keinen Ermessensspielraum über die Zusammensetzung oder die Verwaltung eines Portfolios eines Teilfonds. Die Genehmigung der Gegenpartei ist im Hinblick auf etwaige Anlageentscheidungen durch den Teilfonds nicht erforderlich.

Die Sicherheit kann mit dem Bruttoengagement der Gegenpartei verrechnet werden, vorausgesetzt sie erfüllt eine Reihe von Standards, inklusive Liquidität, Bewertung, Kreditqualität des Emittenten, Korrelation und Diversifizierung. Bei der Verrechnung der Sicherheit wird der Wert um einen Prozentsatz ("Bewertungsabschlag") reduziert, der u. a. für kurzfristige Wertschwankungen des Engagements und der Sicherheit verwendet wird. Das Sicherheitsniveau wird erhalten, um zu gewährleisten, dass das Nettoengagement der Gegenpartei nicht die Limits pro Gegenpartei überschreitet, wie im betreffenden Abschnitt des Verkaufsprospekts niedergelegt. Eventuelle Sicherheiten werden in Wertpapieren und zahlungswirksam erhalten. Sicherheiten, die nicht zahlungswirksam erhalten werden, werden nicht verkauft, neu angelegt oder verpfändet.

Aus Anhang 7 sind die erhaltenen Sicherheiten für umgekehrte Pensionsgeschäfte ersichtlich.

## 9. Geschäfte mit verbundenen Parteien

Alle Geschäfte mit verbundenen Parteien wurden wie unter unverbundenen Parteien abgeschlossen.

Verwaltungsgesellschaft, Registerführer und Übertragungsstelle, Domizil- und Hauptvertriebsstelle, Anlageverwalter, Depotstelle, Aktienregisterführer und Listing Agent und andere bestimmte Stellen der SICAV werden als verbundene Parteien angesehen, da sie verbundene Rechtsträger von JPMorgan Chase & Co. sind. Darüber hinaus erhält Elvinger Hoss Prussen im Berichtszeitraum für Rechtsdienste eine Vergütung von USD 43.660 von der SICAV. Herr Jacques Elvinger ist nicht nur ein Partner dieses Unternehmens, sondern auch ein Mitglied des Verwaltungsrats der SICAV.

## 10. Kreuzbeteiligungen

Zwischen den Teilfonds gibt es zum 31. Mai 2024 keine Kreuzbeteiligungen.

## 11. Angaben für in Deutschland eingetragene Aktionäre

Auf Anfrage ist am Sitz der SICAV und bei einer Niederlassung der deutschen Zahl- und Informationsstelle J.P. Morgan AG, Taunustor 1, D-60310 Frankfurt am Main, Deutschland, eine Aufstellung kostenlos erhältlich, die für jede Vermögensanlage innerhalb eines Teilfonds alle Käufe und Verkäufe aufführt, die während des Berichtszeitraums erfolgt sind. Den Aktionären werden vom Geschäftssitz der SICAV oder der Niederlassung der deutschen Zahl- und Informationsstelle weitere Informationen über Vermögensanlagen im Wertpapierbestand jedes Teilfonds erteilt.

## 12. Informationen für Anleger in der Schweiz

**Vertreter in der Schweiz:** JPMorgan Asset Management (Switzerland) LLC, Dreikönigstrasse 37, CH-8002 Zürich.

**Zahlstelle in der Schweiz:** J.P. Morgan (Suisse) SA, Rue du Rhône 35, CH-1204 Genf.

Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen (KIID), die Satzung, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie eine Liste der während des Berichtszeitraums von der SICAV getätigten Ankäufe und Verkäufe sind beim Vertreter kostenlos erhältlich.

## 13. Stabiles Nettoinventarwertrisiko

Bei CNAV-Fonds für öffentliche Schuldtitel ist die SICAV bestrebt, für ausschüttende Aktien einen konstanten Nettoinventarwert je Aktie zu erhalten. Der Erhalt eines konstanten Nettoinventarwerts wird jedoch nicht garantiert.

Zeichnungen und Rücknahmen von Aktien von LVNAV-Geldmarktfonds erfolgen zu dem Preis, der dem konstanten NIW der betreffenden Klasse entspricht, vorausgesetzt der konstante NIW des betreffenden Teilfonds weicht höchstens um 20 Basispunkte vom variablen NIW desselben Teilfonds ab. Sofern die Abweichung vom variablen NIW desselben Teilfonds 20 Basispunkte übersteigt, erfolgen Folgezeichnungen oder Rücknahmen zu einem Preis, der dem variablen NIW der betreffenden Aktienklasse entspricht. Im Hinblick auf die relevanten Aktien (dist) bleibt der Zeichnungs- und Rücknahmepreis ggf. bei negativem Nettoanlageertrag nicht stabil. Der negative Nettoanlageertrag kann auflaufen und sich im Nettoinventarwert je Aktie niederschlagen.

Bei VNAV-Fonds strebt die SICAV für ausschüttende Aktien keine Erhaltung eines konstanten Nettoinventarwerts an.

## 14. Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrates

Dem Verwaltungsrat wird ein Jahreshonorar bezahlt. Herr Daniel Watkins und Herr Massimo Greco haben darauf verzichtet. Die gesamte Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrats im Berichtszeitraum betrug USD 199.693, wovon der Vorsitzende des Verwaltungsrats USD 48.203 erhielt.

## 15. Transaktionskosten

Für den am 31. Mai 2024 abgeschlossenen Berichtszeitraum entstanden der SICAV Transaktionskosten, die als Maklergebühren für den Kauf oder Verkauf von übertragbaren Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten oder anderen Instrumenten definiert wurden.

Zudem berechnete die Verwahrstelle der SICAV Transaktionskosten für den Kauf und Verkauf von übertragbaren Wertpapieren wie folgt:

Teilfonds	Basiswährung	Transaktionskosten der Depotbank (Basiswährung)
JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund	AUD	3.448
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund	EUR	73.839
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund	EUR	13.814
JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund	SGD	3.039
JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund	GBP	141.033
JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund	GBP	3.324
JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund	USD	89.812
JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund	USD	12.548
JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund	USD	50.975
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)	EUR	-

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

Die Transaktionskosten von Anleihen sind nicht separat vom Kaufpreis des Wertpapiers feststellbar und können daher nicht getrennt dargelegt werden.

## **JPMorgan Liquidity Funds**

*Erläuterungen zum ungeprüften Zwischenabschluss (Fortsetzung)*

*zum 31. Mai 2024*

---

### **16. Wesentliche Ereignisse während des Berichtszeitraums**

*Auflegung von Teilfonds*

JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

### **17. Wesentliche Ereignisse nach dem Ende des Berichtszeitraums**

Nach dem Ende des Berichtszeitraums haben keine wesentlichen Ereignisse stattgefunden.

JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert AUD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert AUD	% des Netto- vermö- gens
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>Anleihen</b>				
<i>Australien</i>					<i>Australien</i>				
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN 5,116% 16/01/2025	AUD	8.000.000	8.020.215	0,50	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN 4,867% 22/07/2024	AUD	30.000.000	30.008.798	1,86
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Reg. S, FRN 5,113% 29/08/2024	AUD	7.500.000	7.508.549	0,47	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN 4,803% 20/08/2024	AUD	7.000.000	7.002.884	0,44
John Deere Financial Ltd. 1,75% 04/10/2024	AUD	23.260.000	23.020.643	1,43	Commonwealth Bank of Australia, FRN 4,81% 24/11/2024	AUD	5.500.000	5.504.410	0,34
Macquarie Bank Ltd., Reg. S 1,75% 07/08/2024	AUD	22.770.000	22.657.514	1,41	Commonwealth Bank of Australia, Reg. S 3,52% 17/04/2025	AUD	6.000.000	5.935.175	0,37
Macquarie Bank Ltd., Reg. S, FRN 5,218% 07/08/2024	AUD	4.500.000	4.504.045	0,28	PACCAR Financial Pty. Ltd. 0,9% 24/09/2024	AUD	11.590.000	11.453.933	0,71
Westpac Banking Corp., Reg. S 2,25% 16/08/2024	AUD	7.700.000	7.663.677	0,47	Toyota Finance Australia Ltd. 0,85% 09/09/2024	AUD	6.220.000	6.153.745	0,38
Westpac Banking Corp., Reg. S, FRN 5,234% 16/08/2024	AUD	16.000.000	16.019.112	0,99	Toyota Finance Australia Ltd. 0% 20/11/2024	AUD	10.000.000	9.776.104	0,61
			<b>89.393.755</b>	<b>5,55</b>	Toyota Finance Australia Ltd., FRN 4,775% 09/09/2024	AUD	31.650.000	31.635.765	1,97
					Westpac Banking Corp. 2,7% 17/03/2025	AUD	7.200.000	7.084.338	0,44
<i>Kanada</i>					Westpac Banking Corp., FRN 5,044% 17/03/2025	AUD	16.300.000	16.340.820	1,02
Province of Ontario Canada 4,25% 22/08/2024	AUD	16.220.000	16.204.591	1,01	Westpac Banking Corp., Reg. S 1,1% 27/09/2024	AUD	7.387.000	7.295.401	0,45
			<b>16.204.591</b>	<b>1,01</b>				<b>138.191.373</b>	<b>8,59</b>
<i>Deutschland</i>					<i>Kanada</i>				
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, Reg. S 4% 27/02/2025	AUD	15.000.000	14.937.055	0,93	Bank of Nova Scotia (The), FRN 4,947% 22/07/2024	AUD	25.000.000	25.004.669	1,55
Landwirtschaftliche Rentenbank 0,4% 23/09/2024	AUD	3.470.000	3.428.349	0,21				<b>25.004.669</b>	<b>1,55</b>
Landwirtschaftliche Rentenbank, Reg. S 4,25% 09/01/2025	AUD	7.000.000	6.986.083	0,43	<i>Norwegen</i>				
			<b>25.351.487</b>	<b>1,57</b>	Kommunalbanken A/S 0,5% 08/10/2024	AUD	13.000.000	12.816.259	0,80
<i>Norwegen</i>								<b>12.816.259</b>	<b>0,80</b>
Kommunalbanken A/S, Reg. S 5,25% 15/07/2024	AUD	25.900.000	25.917.513	1,61	<i>Supranational</i>				
			<b>25.917.513</b>	<b>1,61</b>	Council of Europe Development Bank 0,6% 08/10/2024	AUD	2.200.000	2.169.279	0,13
<i>Singapur</i>								<b>2.169.279</b>	<b>0,13</b>
DBS Bank Ltd., FRN 4,974% 17/03/2025	AUD	9.250.000	9.266.073	0,58	<i>Schweden</i>				
			<b>9.266.073</b>	<b>0,58</b>	Svensk Exportkredit AB 4,5% 22/11/2024	AUD	4.892.000	4.882.034	0,30
<i>Südkorea</i>					Svenska Handelsbanken AB 2,95% 24/03/2025	AUD	8.000.000	7.866.960	0,49
Korea Development Bank (The), Reg. S 1,5% 29/08/2024	AUD	3.150.000	3.125.767	0,19				<b>12.748.994</b>	<b>0,79</b>
Korea Development Bank (The), Reg. S, FRN 5,122% 29/08/2024	AUD	11.010.000	11.016.124	0,69	<b>Anleihen insgesamt</b>			<b>190.930.574</b>	<b>11,86</b>
			<b>14.141.891</b>	<b>0,88</b>	<b>Einlagenzertifikate</b>				
<i>Supranational</i>					<i>Australien</i>				
African Development Bank, Reg. S 4% 10/01/2025	AUD	5.225.000	5.203.093	0,32	Commonwealth Bank of Australia 0% 29/07/2024	AUD	20.000.000	19.863.912	1,24
International Finance Corp. 1,45% 22/07/2024	AUD	3.000.000	2.988.044	0,19	Commonwealth Bank of Australia 0% 12/08/2024	AUD	14.000.000	13.882.101	0,86
			<b>8.191.137</b>	<b>0,51</b>				<b>33.746.013</b>	<b>2,10</b>
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					<i>Kanada</i>				
Coca-Cola Co. (The), Reg. S 3,25% 11/06/2024	AUD	28.630.000	28.620.988	1,78	Canadian Imperial Bank of Commerce 0% 19/08/2024	AUD	12.000.000	11.881.880	0,74
			<b>28.620.988</b>	<b>1,78</b>	Canadian Imperial Bank of Commerce 0% 06/09/2024	AUD	15.000.000	14.817.791	0,92
<b>Anleihen insgesamt</b>			<b>217.087.435</b>	<b>13,49</b>	Canadian Imperial Bank of Commerce 0% 06/01/2025	AUD	15.000.000	14.573.165	0,91
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>217.087.435</b>	<b>13,49</b>				<b>41.272.836</b>	<b>2,57</b>
					<i>China</i>				
					Agricultural Bank of China Ltd., Reg. S 0% 24/07/2024	AUD	25.000.000	24.842.716	1,54
					Bank of China Ltd. 0% 15/08/2024	AUD	24.000.000	23.781.644	1,48
					China Construction Bank Corp., Reg. S 0% 08/08/2024	AUD	24.000.000	23.794.886	1,48



# JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund

## Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert AUD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert AUD	% des Netto- vermö- gens
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0% 04/06/2024	AUD	20.000.000	19.995.041	1,24	<i>Kanada</i> Royal Bank of Canada 4,26% 03/06/2024	AUD	150.000.000	150.000.000	9,32
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0% 08/07/2024	AUD	10.000.000	9.955.582	0,62					
			<b>102.369.869</b>	<b>6,36</b>					
<i>Japan</i>					<i>Frankreich</i>				
Mizuho Bank Ltd. 0% 28/06/2024	AUD	12.000.000	11.961.154	0,74	BNP Paribas SA 4,26% 03/06/2024	AUD	50.000.000	50.000.000	3,11
Mizuho Bank Ltd. 0% 04/10/2024	AUD	12.000.000	11.809.127	0,73			<b>50.000.000</b>	<b>3,11</b>	
MUFG Bank Ltd. 0% 17/06/2024	AUD	10.000.000	9.981.447	0,62					
MUFG Bank Ltd. 0% 28/06/2024	AUD	12.000.000	11.961.155	0,74	<i>Großbritannien</i>				
MUFG Bank Ltd. 0% 17/09/2024	AUD	15.000.000	14.799.051	0,92	Standard Chartered Bank 4,25% 03/06/2024	AUD	100.000.000	100.000.000	6,22
MUFG Bank Ltd., Reg. S, FRN 4,831% 26/09/2024	AUD	8.180.000	8.183.031	0,51			<b>100.000.000</b>	<b>6,22</b>	
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 17/06/2024	AUD	15.000.000	14.972.171	0,93	<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>			<b>450.000.000</b>	<b>27,97</b>
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 19/06/2024	AUD	15.000.000	14.968.458	0,93	<b>Termineinlagen</b>				
Sumitomo Mitsui Banking Corp., Reg. S 0% 24/10/2024	AUD	10.000.000	9.816.435	0,61	<i>Hongkong</i>				
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., Reg. S 0% 22/07/2024	AUD	25.000.000	24.852.797	1,55	Hongkong and Shanghai Banking Corp. (The) 3,76% 03/06/2024	AUD	96.000.000	96.000.000	5,96
			<b>133.304.826</b>	<b>8,28</b>			<b>96.000.000</b>	<b>5,96</b>	
<i>Niederlande</i>					<i>Niederlande</i>				
Cooperatieve Rabobank UA 0% 20/09/2024	AUD	25.000.000	24.661.745	1,53	ING Bank 4,2% 03/06/2024	AUD	50.000.000	50.000.000	3,11
			<b>24.661.745</b>	<b>1,53</b>			<b>50.000.000</b>	<b>3,11</b>	
<i>Singapur</i>					<b>Termineinlagen insgesamt</b>			<b>146.000.000</b>	<b>9,07</b>
DBS Bank Ltd. 0% 07/06/2024	AUD	10.000.000	9.993.718	0,62	<b>Bankguthaben</b>			<b>180.422.363</b>	<b>11,21</b>
DBS Bank Ltd. 0% 16/07/2024	AUD	15.000.000	14.919.816	0,93	<b>Andere Aktiva/(Passiva)</b>			<b>(76.339.145)</b>	<b>(4,74)</b>
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 0% 04/06/2024	AUD	10.000.000	9.997.589	0,62	<b>Nettovermögen insgesamt</b>			<b>1.609.248.632</b>	<b>100,00</b>
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 0% 01/08/2024	AUD	10.000.000	9.927.812	0,61					
United Overseas Bank Ltd. 0% 01/08/2024	AUD	10.000.000	9.927.885	0,62					
United Overseas Bank Ltd. 0% 24/10/2024	AUD	18.000.000	17.683.471	1,10					
			<b>72.450.291</b>	<b>4,50</b>					
<i>Südkorea</i>									
Keb Hana Bank 0% 04/07/2024	AUD	12.000.000	11.952.597	0,74					
Keb Hana Bank 0% 29/11/2024	AUD	11.000.000	10.740.088	0,67					
Woori Bank, FRN 5,092% 29/11/2024	AUD	15.000.000	15.016.432	0,93					
			<b>37.709.117</b>	<b>2,34</b>					
<b>Einlagenzertifikate insgesamt</b>			<b>445.514.697</b>	<b>27,68</b>					
<b>Commercial Papers</b>									
<i>Kanada</i>									
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 20/06/2024	AUD	16.000.000	15.964.701	0,99					
			<b>15.964.701</b>	<b>0,99</b>					
<i>Frankreich</i>									
BRED Banque Populaire SA 0% 26/07/2024	AUD	20.000.000	19.857.662	1,24					
LMA SA 0% 16/08/2024	AUD	20.000.000	19.810.345	1,23					
			<b>39.668.007</b>	<b>2,47</b>					
<b>Commercial Papers insgesamt</b>			<b>55.632.708</b>	<b>3,46</b>					
<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>692.077.979</b>	<b>43,00</b>					
<b>Wertpapierbestand insgesamt</b>			<b>909.165.414</b>	<b>56,49</b>					
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>									
<i>Australien</i>									
National Australia Bank Ltd. 4,3% 03/06/2024	AUD	150.000.000	150.000.000	9,32					
			<b>150.000.000</b>	<b>9,32</b>					

Geografische Aufteilung des Wertpapierbestandes zum 31. Mai 2024	% des Netto- vermögens
Australien	25,56
Kanada	15,44
Japan	8,28
China	6,36
Großbritannien	6,22
Hongkong	5,96
Frankreich	5,58
Singapur	5,08
Niederlande	4,64
Südkorea	3,22
Norwegen	2,41
Vereinigte Staaten von Amerika	1,78
Deutschland	1,57
Schweden	0,79
Supranational	0,64
<b>Wertpapierbestand insgesamt und geldnahe Anlagen</b>	<b>93,53</b>
Bankguthaben und andere Aktiva/(Passiva)	6,47
<b>Summe</b>	<b>100,00</b>

# JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund

## Wertpapierbestand

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>Anleihen</b>				
<i>Australien</i>					<i>Australien</i>				
National Australia Bank Ltd., Reg. S, FRN 4,183% 30/11/2024	EUR	220.000.000	220.107.749	0,96	Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 29/08/2024	EUR	70.000.000	69.327.523	0,30
			<b>220.107.749</b>	<b>0,96</b>	Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 30/08/2024	EUR	25.000.000	24.757.208	0,11
<i>Kanada</i>					<i>Kanada</i>				
Bank of Nova Scotia (The), Reg. S, FRN 4,282% 12/07/2024	EUR	150.000.000	150.019.050	0,65	Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 26/09/2024	EUR	49.000.000	48.386.116	0,21
			<b>150.019.050</b>	<b>0,65</b>	Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 27/09/2024	EUR	24.000.000	23.696.832	0,10
					Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 30/09/2024	EUR	50.000.000	49.352.849	0,22
<b>Anleihen insgesamt</b>			<b>370.126.799</b>	<b>1,61</b>	Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 01/10/2024	EUR	28.000.000	27.634.695	0,12
					Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 08/10/2024	EUR	47.000.000	46.352.778	0,20
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>370.126.799</b>	<b>1,61</b>	Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 09/10/2024	EUR	5.000.000	4.930.630	0,02
					Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 01/11/2024	EUR	18.000.000	17.707.707	0,08
					Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 03/12/2024	EUR	44.000.000	43.153.261	0,19
								<b>564.560.037</b>	<b>2,46</b>
<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Einlagenzertifikate</b>					<b>Einlagenzertifikate</b>				
<i>Belgien</i>					<i>Belgien</i>				
KBC Bank NV 0% 08/07/2024	EUR	75.000.000	74.708.602	0,32	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 04/06/2024	EUR	28.000.000	27.993.799	0,12
KBC Bank NV 0% 30/08/2024	EUR	70.000.000	69.332.927	0,30	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 10/06/2024	EUR	29.000.000	28.974.398	0,13
KBC Bank NV 3,92% 30/08/2024	EUR	100.000.000	100.018.937	0,44	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 10/06/2024	EUR	40.000.000	39.964.773	0,17
			<b>244.060.466</b>	<b>1,06</b>	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 12/06/2024	EUR	28.000.000	27.969.672	0,12
<i>Kanada</i>					<i>Kanada</i>				
Bank of Montreal 0% 26/06/2024	EUR	45.000.000	44.884.844	0,20	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 15/07/2024	EUR	27.000.000	26.878.631	0,12
Bank of Montreal 0% 07/10/2024	EUR	147.000.000	145.040.263	0,63	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 16/07/2024	EUR	100.000.000	99.521.696	0,43
Bank of Montreal 0% 09/10/2024	EUR	47.000.000	46.363.735	0,20	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 05/08/2024	EUR	28.000.000	27.821.553	0,12
Bank of Montreal 0% 10/10/2024	EUR	150.000.000	147.953.916	0,65	Mizuho Bank Ltd. 0% 11/06/2024	EUR	20.000.000	19.979.969	0,09
Bank of Montreal, FRN 4,288% 24/06/2024	EUR	150.000.000	150.021.202	0,65	Mizuho Bank Ltd. 0% 12/06/2024	EUR	50.000.000	49.944.402	0,22
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 30/09/2024	EUR	25.000.000	24.681.114	0,11	Mizuho Bank Ltd. 0% 17/06/2024	EUR	99.000.000	98.839.132	0,43
Toronto-Dominion Bank (The), FRN 4,395% 15/07/2024	EUR	200.000.000	200.058.180	0,87	Mizuho Corporate Bank Ltd. 0% 07/06/2024	EUR	98.000.000	97.945.255	0,43
Toronto-Dominion Bank (The), FRN 4,259% 22/07/2024	EUR	200.000.000	200.067.650	0,87	MUFG Bank Ltd. 0% 04/09/2024	EUR	97.000.000	96.007.158	0,42
			<b>959.070.904</b>	<b>4,18</b>	MUFG Bank Ltd. 0% 16/09/2024	EUR	223.000.000	220.438.069	0,96
<i>China</i>					<i>China</i>				
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0% 07/08/2024	EUR	149.000.000	147.935.115	0,65	Norinchukin Bank (The) 0% 08/08/2024	EUR	25.000.000	24.818.699	0,11
			<b>147.935.115</b>	<b>0,65</b>	Norinchukin Bank (The) 0% 13/08/2024	EUR	49.000.000	48.623.298	0,21
<i>Finnland</i>					<i>Finnland</i>				
Nordea Bank Abp 0% 30/08/2024	EUR	98.000.000	97.086.005	0,42	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 10/06/2024	EUR	153.000.000	152.865.146	0,67
Nordea Bank Abp, FRN 4,198% 08/07/2024	EUR	194.000.000	194.020.288	0,85	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 02/07/2024	EUR	30.000.000	29.901.668	0,13
Nordea Bank Abp, FRN 4,119% 15/07/2024	EUR	175.000.000	175.023.417	0,76	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 12/07/2024	EUR	40.000.000	39.823.186	0,17
Nordea Bank Abp, FRN 4,083% 19/08/2024	EUR	100.000.000	100.004.251	0,44	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 12/07/2024	EUR	88.000.000	87.611.008	0,38
			<b>566.133.961</b>	<b>2,47</b>	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 22/07/2024	EUR	131.000.000	130.294.532	0,57
<i>Frankreich</i>					<i>Frankreich</i>				
Credit Agricole SA 0% 17/06/2024	EUR	53.500.000	53.412.123	0,23	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 25/07/2024	EUR	80.000.000	79.543.958	0,35
			<b>53.412.123</b>	<b>0,23</b>	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 31/07/2024	EUR	73.000.000	72.537.373	0,32
<i>Irland</i>					<i>Irland</i>				
Bank of America Europe DAC 0% 14/11/2024	EUR	78.000.000	76.677.023	0,33	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0% 06/06/2024	EUR	68.000.000	67.970.000	0,30
Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 03/06/2024	EUR	48.000.000	47.994.772	0,21	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0% 16/07/2024	EUR	100.000.000	99.522.946	0,43
Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 05/06/2024	EUR	13.000.000	12.995.759	0,06	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0% 09/08/2024	EUR	98.000.000	97.268.780	0,42
Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 10/06/2024	EUR	5.000.000	4.995.663	0,02				<b>1.793.059.101</b>	<b>7,82</b>
Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 10/06/2024	EUR	18.000.000	17.984.386	0,08	<i>Niederlande</i>				
Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 15/08/2024	EUR	49.000.000	48.612.835	0,21	ABN AMRO Bank NV 0% 04/06/2024	EUR	97.000.000	96.978.597	0,43
					ABN AMRO Bank NV 0% 12/06/2024	EUR	46.000.000	45.949.508	0,20
					ABN AMRO Bank NV 0% 09/09/2024	EUR	40.000.000	39.579.984	0,17
								<b>182.508.089</b>	<b>0,80</b>
					<i>Norwegen</i>				
					DNB Bank ASA, FRN 4,339% 05/11/2024	EUR	150.000.000	150.128.629	0,65
								<b>150.128.629</b>	<b>0,65</b>

JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens
<i>Singapur</i>					<i>Finnland</i>				
DBS Bank Ltd. 0% 12/08/2024	EUR	24.000.000	23.826.193	0,11	OP Corporate Bank plc 0% 25/11/2024	EUR	49.000.000	48.103.950	0,21
DBS Bank Ltd. 0% 13/09/2024	EUR	24.000.000	23.743.320	0,10	OP Corporate Bank plc 0% 28/04/2025	EUR	14.000.000	13.537.161	0,06
			<b>47.569.513</b>	<b>0,21</b>	OP Corporate Bank plc 0% 05/05/2025	EUR	100.000.000	96.628.593	0,42
					OP Corporate Bank plc 0% 13/05/2025	EUR	100.000.000	96.554.035	0,42
<i>Südkorea</i>								<b>254.823.739</b>	<b>1,11</b>
Keb Hana Bank 0% 16/09/2024	EUR	30.000.000	29.649.349	0,13	<i>Frankreich</i>				
Keb Hana Bank 0% 26/09/2024	EUR	20.000.000	19.744.076	0,09	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 05/06/2024	EUR	149.000.000	148.947.664	0,65
Keb Hana Bank 0% 07/10/2024	EUR	40.000.000	39.439.255	0,17	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 13/06/2024	EUR	190.000.000	189.756.536	0,83
Keb Hana Bank 0% 14/11/2024	EUR	30.000.000	29.451.601	0,13	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 13/06/2024	EUR	200.000.000	199.743.722	0,87
Keb Hana Bank 0% 18/11/2024	EUR	27.000.000	26.494.231	0,11	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 14/06/2024	EUR	150.000.000	149.806.293	0,65
Kookmin Bank 0% 15/10/2024	EUR	13.000.000	12.815.837	0,06	Agence Francaise De Developpement 0% 05/09/2024	EUR	75.000.000	74.242.916	0,32
Kookmin Bank 0% 04/11/2024	EUR	75.000.000	73.786.409	0,32	Agence Francaise De Developpement, FRN 4,058% 07/06/2024	EUR	40.000.000	40.000.139	0,17
			<b>231.380.758</b>	<b>1,01</b>	Agence Francaise de Developpement Principal Certificate, FRN 4,071% 28/06/2024	EUR	85.400.000	85.402.476	0,37
<i>Großbritannien</i>									
Goldman Sachs International Bank 0% 18/09/2024	EUR	78.000.000	77.109.464	0,34	Agence Francaise de Developpement Principal Certificate, FRN 3,993% 02/12/2024	EUR	60.000.000	60.000.000	0,26
Goldman Sachs International Bank 0% 21/11/2024	EUR	72.000.000	70.712.458	0,31	Antalis SA 0% 15/08/2024	EUR	160.000.000	158.722.114	0,69
Mizuho International plc 0% 08/10/2024	EUR	80.000.000	78.919.237	0,34	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0% 23/08/2024	EUR	40.000.000	39.650.394	0,17
National Westminster Bank plc 0% 10/06/2024	EUR	134.000.000	133.883.661	0,58	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0% 06/09/2024	EUR	100.000.000	98.980.307	0,43
National Westminster Bank plc 0% 04/07/2024	EUR	96.000.000	95.674.445	0,42	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0% 06/09/2024	EUR	137.000.000	135.603.021	0,59
National Westminster Bank plc 0% 08/07/2024	EUR	84.000.000	83.680.366	0,36	Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN 4,235% 01/08/2024	EUR	148.000.000	148.035.638	0,65
			<b>539.979.631</b>	<b>2,35</b>	BPCE SA 0% 30/09/2024	EUR	45.000.000	44.430.910	0,19
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>									
Citibank NA 0% 11/09/2024	EUR	95.000.000	93.982.663	0,41	BPCE SA 0% 01/10/2024	EUR	20.000.000	19.745.040	0,09
Citibank NA 0% 07/11/2024	EUR	130.000.000	127.857.301	0,56	BPCE SA 0% 04/11/2024	EUR	64.500.000	63.456.312	0,28
			<b>221.839.964</b>	<b>0,97</b>	BRED Banque Populaire SA, FRN 4,134% 08/07/2024	EUR	150.000.000	150.005.277	0,65
<b>Einlagenzertifikate insgesamt</b>			<b>5.701.638.291</b>	<b>24,86</b>	Dexia SA 0% 14/10/2024	EUR	123.000.000	121.288.979	0,53
<b>Commercial Papers</b>									
<i>Australien</i>									
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0% 27/08/2024	EUR	100.000.000	99.103.310	0,43	Dexia SA 0% 22/10/2024	EUR	100.000.000	98.530.788	0,43
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0% 04/10/2024	EUR	158.000.000	155.974.023	0,68	Eurotitrisation - SAT Magenta 0% 15/07/2024	EUR	49.500.000	49.272.811	0,22
Toyota Finance Australia Ltd. 0% 13/06/2024	EUR	15.000.000	14.981.915	0,07	HSBC Continental Europe SA 0% 15/07/2024	EUR	48.000.000	47.779.695	0,21
			<b>270.059.248</b>	<b>1,18</b>	HSBC Continental Europe SA 0% 12/09/2024	EUR	45.000.000	44.513.501	0,19
<i>Österreich</i>									
Erste Group Bank AG 0% 05/06/2024	EUR	110.000.000	109.964.086	0,48	HSBC Continental Europe SA 0% 07/10/2024	EUR	110.000.000	108.530.767	0,47
Oesterreichische Kontrollbank 0% 01/07/2024	EUR	98.000.000	97.704.882	0,43	HSBC Continental Europe SA 0% 04/11/2024	EUR	100.000.000	98.381.879	0,43
Oesterreichische Kontrollbank 0% 03/10/2024	EUR	105.000.000	103.672.180	0,45	HSBC Continental Europe SA, FRN 4,076% 22/07/2024	EUR	100.000.000	100.003.259	0,44
Oesterreichische Kontrollbank AG 0% 03/07/2024	EUR	195.000.000	194.373.044	0,85	La Banque Postale SA 0% 11/11/2024	EUR	274.000.000	269.332.966	1,17
Republik Österreich 0% 03/06/2024	EUR	4.000.000	3.999.545	0,02	LMA SA 0% 05/06/2024	EUR	50.000.000	49.983.687	0,22
Republik Österreich 0% 05/06/2024	EUR	22.000.000	21.992.331	0,09	LMA SA 0% 10/06/2024	EUR	31.500.000	31.472.674	0,14
			<b>531.706.068</b>	<b>2,32</b>	LMA SA 0% 11/06/2024	EUR	29.500.000	29.470.773	0,13
<i>Kanada</i>									
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 16/09/2024	EUR	100.000.000	98.866.046	0,43	LMA SA 0% 17/06/2024	EUR	29.000.000	28.952.970	0,13
			<b>98.866.046</b>	<b>0,43</b>	LMA SA 0% 03/07/2024	EUR	53.000.000	52.823.531	0,23
<i>Kaimaninseln</i>									
Chesham Finance Ltd. 0% 06/06/2024	EUR	103.000.000	102.954.373	0,45	LMA SA 0% 15/07/2024	EUR	49.000.000	48.775.106	0,21
			<b>102.954.373</b>	<b>0,45</b>	LMA SA 0% 16/07/2024	EUR	49.000.000	48.766.926	0,21
<i>China</i>									
Bank of China Ltd. 0% 18/07/2024	EUR	50.000.000	49.747.840	0,21	LMA SA 0% 25/07/2024	EUR	20.000.000	19.887.983	0,09
			<b>49.747.840</b>	<b>0,21</b>	LMA SA 0% 23/08/2024	EUR	40.000.000	39.650.394	0,17
					LMA SA 0% 27/08/2024	EUR	20.000.000	19.816.719	0,09
					LMA SA 0% 09/09/2024	EUR	24.000.000	23.747.900	0,10
					LMA SA 0% 10/09/2024	EUR	45.000.000	44.522.708	0,19
					LMA SA 0% 10/09/2024	EUR	74.000.000	73.215.119	0,32
					LMA SA 0% 24/09/2024	EUR	48.000.000	47.422.274	0,21
					LMA SA 0% 29/11/2024	EUR	37.000.000	36.308.686	0,16
					Managed and Enhanced Tap 0% 03/06/2024	EUR	35.000.000	34.997.157	0,15
					Managed and Enhanced Tap 0% 04/06/2024	EUR	50.000.000	49.997.292	0,22
					Managed and Enhanced Tap 0% 19/07/2024	EUR	36.000.000	35.817.655	0,16
					Managed and Enhanced Tap 0% 02/09/2024	EUR	30.000.000	29.706.394	0,13
					Managed and Enhanced Tap 0% 09/09/2024	EUR	39.000.000	38.590.338	0,17
					Natixis SA 0% 23/09/2024	EUR	98.000.000	96.830.463	0,42
					Natixis SA, FRN 4,237% 15/08/2024	EUR	137.000.000	137.034.523	0,60
					Satellite SASU 0% 05/06/2024	EUR	30.000.000	29.990.117	0,13

JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens
Satellite SASU 0% 17/06/2024	EUR	10.000.000	9.983.490	0,04	Toyota Motor Finance Netherlands BV				
Satellite SASU 0% 08/07/2024	EUR	42.000.000	41.831.537	0,18	0% 12/06/2024	EUR	80.000.000	79.912.804	0,35
Satellite SASU 0% 19/07/2024	EUR	98.000.000	97.502.413	0,43	Toyota Motor Finance Netherlands BV				
Satellite SASU 0% 03/09/2024	EUR	25.000.000	24.743.251	0,11	0% 21/06/2024	EUR	44.000.000	43.908.454	0,19
Satellite SASU 0% 16/10/2024	EUR	21.000.000	20.688.768	0,09					
Satellite SASU 0% 12/11/2024	EUR	22.000.000	21.611.807	0,09				<b>350.451.517</b>	<b>1,53</b>
			<b>4.008.306.059</b>	<b>17,47</b>					
<i>Deutschland</i>					<i>Supranational</i>				
FMS Wertmanagement AOR 0% 04/06/2024	EUR	145.000.000	144.968.554	0,63	European Stability Mechanism 0% 04/06/2024	EUR	25.000.000	24.994.220	0,11
FMS Wertmanagement AOR 0% 05/06/2024	EUR	195.000.000	194.940.820	0,85				<b>24.994.220</b>	<b>0,11</b>
Landeskreditbank Baden-wuerttemberg Foerderbank 0% 03/06/2024	EUR	192.000.000	191.977.985	0,84	<i>Schweden</i>				
Landeskreditbank Baden-wuerttemberg Foerderbank 0% 04/06/2024	EUR	195.000.000	194.957.523	0,85	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0% 17/06/2024	EUR	79.000.000	78.873.804	0,34
Landeskreditbank Baden-wuerttemberg Foerderbank 0% 06/06/2024	EUR	245.000.000	244.877.502	1,07	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0% 04/07/2024	EUR	80.000.000	79.728.218	0,35
NRW Bank 0% 11/06/2024	EUR	292.000.000	291.817.109	1,27	Svenska Handelsbanken AB 0% 04/06/2024	EUR	23.000.000	22.994.925	0,10
			<b>1.263.539.493</b>	<b>5,51</b>	Svenska Handelsbanken AB 0% 17/06/2024	EUR	78.000.000	77.871.879	0,34
					Svenska Handelsbanken AB 0% 05/07/2024	EUR	195.000.000	194.292.441	0,85
<i>Irland</i>					Svenska Handelsbanken AB 0% 19/07/2024	EUR	94.000.000	93.519.825	0,41
Matchpoint Finance plc 0% 04/06/2024	EUR	19.000.000	18.995.720	0,08	Svenska Handelsbanken AB 0% 25/07/2024	EUR	81.500.000	81.038.232	0,35
Matchpoint Finance plc 0% 11/06/2024	EUR	23.500.000	23.476.343	0,10	Svenska Handelsbanken AB 0% 09/09/2024	EUR	122.000.000	120.718.951	0,53
Matchpoint Finance plc 0% 11/06/2024	EUR	55.000.000	54.944.632	0,24	Svenska Handelsbanken AB 0% 15/10/2024	EUR	78.000.000	76.895.603	0,33
Matchpoint Finance plc 0% 05/07/2024	EUR	75.000.000	74.721.006	0,33	Svenska Handelsbanken AB 0% 14/11/2024	EUR	50.000.000	49.141.264	0,21
Matchpoint Finance plc 0% 17/07/2024	EUR	58.000.000	57.711.530	0,25	Svenska Handelsbanken AB 0% 20/11/2024	EUR	98.000.000	96.258.117	0,42
Matchpoint Finance plc 0% 19/07/2024	EUR	49.000.000	48.742.946	0,21	Svenska Handelsbanken AB 0% 20/11/2024	EUR	98.000.000	96.258.117	0,42
Matchpoint Finance plc 0% 16/08/2024	EUR	144.000.000	142.818.432	0,62	Svenska Handelsbanken AB 0% 16/04/2025	EUR	80.000.000	77.438.895	0,34
Matchpoint Finance plc 0% 20/08/2024	EUR	58.000.000	57.492.912	0,25				<b>1.145.030.271</b>	<b>4,99</b>
Matchpoint Finance plc 0% 03/09/2024	EUR	20.000.000	19.795.290	0,09	<i>Schweiz</i>				
Matchpoint Finance plc 0% 09/09/2024	EUR	21.000.000	20.771.707	0,09	UBS AG 0% 10/06/2024	EUR	160.000.000	159.861.203	0,70
Matchpoint Finance plc 0% 06/11/2024	EUR	62.000.000	60.948.837	0,27				<b>159.861.203</b>	<b>0,70</b>
Matchpoint Finance plc 0% 13/11/2024	EUR	49.000.000	48.133.671	0,21	<i>Großbritannien</i>				
Matchpoint Finance plc 0% 25/11/2024	EUR	29.000.000	28.451.299	0,12	Bank of China Ltd. 0% 26/07/2024	EUR	100.000.000	99.398.629	0,43
Matchpoint Finance plc 0% 04/12/2024	EUR	19.000.000	18.636.221	0,08	Barclays Bank plc 0% 18/09/2024	EUR	52.000.000	51.417.492	0,23
			<b>675.640.546</b>	<b>2,94</b>				<b>150.816.121</b>	<b>0,66</b>
<i>Luxemburg</i>					<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>				
Albion Capital Corp. SA 0% 17/06/2024	EUR	35.000.000	34.944.432	0,15	Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 17/06/2024	EUR	42.000.000	41.929.286	0,18
Albion Capital Corp. SA 0% 24/06/2024	EUR	18.000.000	17.957.802	0,08	Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 04/07/2024	EUR	148.000.000	147.472.954	0,64
Sunderland Receivables SA 0% 18/06/2024	EUR	44.000.000	43.921.085	0,19	Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 07/08/2024	EUR	123.000.000	122.116.378	0,53
Sunderland Receivables SA 0% 28/06/2024	EUR	89.000.000	88.737.486	0,39	Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 20/08/2024	EUR	87.000.000	86.238.773	0,38
Sunderland Receivables SA 0% 13/08/2024	EUR	18.000.000	17.859.509	0,08	Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 23/09/2024	EUR	11.000.000	10.863.656	0,05
Sunderland Receivables SA 0% 30/08/2024	EUR	26.000.000	25.744.070	0,11	Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 08/10/2024	EUR	64.500.000	63.598.352	0,28
Sunderland Receivables SA 0% 29/10/2024	EUR	30.000.000	29.514.493	0,13	LMA SA 0% 03/06/2024	EUR	33.000.000	32.996.389	0,14
Sunderland Receivables SA 0% 06/11/2024	EUR	17.000.000	16.710.668	0,07	Procter & Gamble Co. (The) 0% 03/07/2024	EUR	64.000.000	63.790.659	0,28
			<b>275.389.545</b>	<b>1,20</b>	Procter & Gamble Co. (The) 0% 22/07/2024	EUR	25.000.000	24.870.281	0,11
<i>Niederlande</i>								<b>593.876.728</b>	<b>2,59</b>
Linde Finance BV 0% 13/08/2024	EUR	35.000.000	34.737.155	0,15	<b>Commercial Papers insgesamt</b>			<b>9.956.063.017</b>	<b>43,40</b>
Niederlandse Waterschapsbank NV 0% 10/06/2024	EUR	192.000.000	191.893.104	0,84	<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>15.657.701.308</b>	<b>68,26</b>
					<b>Wertpapierbestand insgesamt</b>			<b>16.027.828.107</b>	<b>69,87</b>



## JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Geografische Aufteilung des Wertpapierbestandes zum 31. Mai 2024	% des Netto- vermögens
Frankreich	29,02
Großbritannien	13,26
Japan	9,35
Kanada	8,54
Vereinigte Staaten von Amerika	7,29
Deutschland	6,60
Australien	5,63
Irland	5,40
Schweden	4,99
Finnland	3,58
Österreich	2,54
Niederlande	2,33
Luxemburg	1,20
China	1,16
Belgien	1,15
Südkorea	1,01
Schweiz	0,70
Norwegen	0,65
Kaimaninseln	0,45
Singapur	0,21
Supranational	0,11
<b>Wertpapierbestand insgesamt und geldnahe Anlagen</b>	<b>105,17</b>
Bankguthaben und andere Aktiva/(Passiva)	(5,17)
<b>Summe</b>	<b>100,00</b>



JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<i>Südkorea</i>				
<b>Anleihen</b>					Korea Development Bank (The), Reg. S 0% 10/07/2024				
<i>Australien</i>					EUR 3.300.000 3.287.084 0,07				
National Australia Bank Ltd., Reg. S, FRN 4,183% 30/11/2024					EUR 3.300.000 3.287.084 0,07				
<i>Kanada</i>					<i>Spanien</i>				
Bank of Nova Scotia (The), Reg. S, FRN 4,422% 22/09/2025					Banco Santander SA, Reg. S 0,25% 19/06/2024				
EUR 20.000.000 20.072.920 0,45					EUR 5.900.000 5.890.690 0,13				
Bank of Nova Scotia (The), Reg. S, FRN 4,46% 12/12/2025					EUR 5.900.000 5.890.690 0,13				
EUR 12.000.000 12.044.640 0,27					<i>Schweden</i>				
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reg. S, FRN 4,429% 09/06/2025					Volvo Treasury AB, FRN 4,385% 09/01/2026				
EUR 13.000.000 13.031.408 0,29					EUR 24.000.000 24.074.160 0,53				
Daimler Truck Finance Canada, Inc., Reg. S, FRN 4,428% 18/03/2025					Volvo Treasury AB, Reg. S, FRN 4,202% 22/05/2026				
EUR 21.300.000 21.347.925 0,47					EUR 29.500.000 29.522.774 0,66				
National Bank of Canada, Reg. S, FRN 4,392% 06/03/2026					EUR 29.500.000 29.522.774 0,66				
EUR 32.000.000 32.029.504 0,71					EUR 29.500.000 29.522.774 0,66				
Toronto-Dominion Bank (The), Reg. S, FRN 4,303% 16/04/2026					EUR 29.500.000 29.522.774 0,66				
EUR 60.000.000 60.033.600 1,34					EUR 29.500.000 29.522.774 0,66				
EUR 30.014.693 0,67					EUR 29.500.000 29.522.774 0,66				
EUR 30.014.693 0,67					EUR 29.500.000 29.522.774 0,66				
<i>Dänemark</i>					<i>Großbritannien</i>				
Danske Bank A/S, FRN 4,256% 11/08/2025					Mitsubishi HC Capital UK plc, Reg. S, FRN 4,328% 15/05/2025				
EUR 7.500.000 7.516.275 0,17					EUR 20.000.000 19.993.928 0,44				
EUR 7.500.000 7.516.275 0,17					Nationwide Building Society, Reg. S, FRN 4,426% 07/06/2025				
<i>Frankreich</i>					EUR 7.000.000 7.017.234 0,16				
BPCE SA, FRN 4,262% 06/09/2024					EUR 7.000.000 7.017.234 0,16				
EUR 12.000.000 12.002.040 0,27					EUR 7.000.000 7.017.234 0,16				
Cie de Saint-Gobain SA, Reg. S, FRN 4,104% 18/07/2024					EUR 7.000.000 7.017.234 0,16				
EUR 6.500.000 6.500.831 0,14					EUR 7.000.000 7.017.234 0,16				
Electricite de France SA, Reg. S 4,625% 11/09/2024					EUR 7.000.000 7.017.234 0,16				
EUR 22.500.000 22.534.605 0,50					EUR 7.000.000 7.017.234 0,16				
Societe Generale SA, Reg. S, FRN 4,395% 19/01/2026					EUR 7.000.000 7.017.234 0,16				
EUR 18.000.000 18.061.920 0,40					EUR 7.000.000 7.017.234 0,16				
Vinci SA, FRN 4,056% 13/05/2026					EUR 7.000.000 7.017.234 0,16				
EUR 18.000.000 17.990.460 0,40					EUR 7.000.000 7.017.234 0,16				
EUR 77.089.856 1,71					EUR 7.000.000 7.017.234 0,16				
<i>Deutschland</i>					<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>				
DZ Bank AG, Reg. S, FRN 4,248% 28/02/2025					Caterpillar Financial Services Corp., Reg. S, FRN 4,292% 08/12/2025				
EUR 5.000.000 5.005.000 0,11					EUR 35.000.000 35.112.348 0,78				
Volkswagen Leasing GmbH, Reg. S 0% 19/07/2024					EUR 13.000.000 12.996.100 0,29				
EUR 11.059.000 11.002.599 0,25					EUR 13.000.000 12.996.100 0,29				
Volkswagen Leasing GmbH, Reg. S 1,375% 20/01/2025					EUR 13.000.000 12.996.100 0,29				
EUR 12.000.000 11.812.800 0,26					EUR 13.000.000 12.996.100 0,29				
EUR 27.820.399 0,62					EUR 13.000.000 12.996.100 0,29				
<i>Italien</i>					<b>Anleihen insgesamt</b>				
Intesa Sanpaolo SpA, Reg. S 1% 04/07/2024					EUR 489.265.728 10,88				
EUR 1.000.000 997.400 0,02					EUR 489.265.728 10,88				
EUR 997.400 0,02					EUR 489.265.728 10,88				
<i>Japan</i>					<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., Reg. S 0,978% 09/06/2024					EUR 489.265.728 10,88				
EUR 3.516.000 3.514.481 0,08					EUR 489.265.728 10,88				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., Reg. S 0,339% 19/07/2024					EUR 489.265.728 10,88				
EUR 7.000.000 6.968.920 0,16					EUR 489.265.728 10,88				
Mizuho Financial Group, Inc., Reg. S 0,523% 10/06/2024					EUR 489.265.728 10,88				
EUR 3.300.000 3.298.119 0,07					EUR 489.265.728 10,88				
EUR 13.781.520 0,31					EUR 489.265.728 10,88				
<i>Niederlande</i>					<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
Mercedes-Benz International Finance BV, Reg. S, FRN 4,262% 01/12/2025					<b>Anleihen</b>				
EUR 25.000.000 25.052.000 0,56					<i>Deutschland</i>				
Volkswagen International Finance NV, Reg. S, FRN 4,552% 27/03/2026					Red & Black Auto Germany 10 UG, Reg. S, FRN 'A' 4,278% 15/09/2032				
EUR 10.500.000 10.539.270 0,23					EUR 20.239.630 20.244.082 0,45				
EUR 35.591.270 0,79					Red & Black Auto Germany 8 UG, Reg. S, FRN 'A' 4,528% 15/09/2030				
<i>Australien</i>					EUR 649.603 651.464 0,01				
Commonwealth Bank of Australia 0% 20/11/2024					EUR 649.603 651.464 0,01				
EUR 35.000.000 34.385.473 0,77					EUR 649.603 651.464 0,01				
EUR 34.385.473 0,77					EUR 649.603 651.464 0,01				

JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens
<i>Belgien</i>					MUFG Bank Ltd. 0% 07/11/2024	EUR	10.000.000	9.831.481	0,22
KBC Bank NV, FRN 4,112% 10/07/2024	EUR	22.000.000	22.000.379	0,49	Norinchukin Bank (The) 0% 18/06/2024	EUR	30.000.000	29.942.062	0,67
			<b>22.000.379</b>	<b>0,49</b>	Norinchukin Bank (The) 0% 02/08/2024	EUR	18.000.000	17.878.884	0,40
<i>Kanada</i>					Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 22/07/2024	EUR	20.000.000	19.888.631	0,44
Bank of Montreal 0% 07/10/2024	EUR	25.000.000	24.666.712	0,55				<b>204.598.606</b>	<b>4,55</b>
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 18/11/2024	EUR	27.500.000	27.015.375	0,60	<i>Niederlande</i>				
			<b>51.682.087</b>	<b>1,15</b>	ABN AMRO Bank NV 0% 12/08/2024	EUR	30.000.000	29.770.651	0,66
<i>China</i>					ABN AMRO Bank NV 0% 19/08/2024	EUR	10.000.000	9.916.408	0,22
Agricultural Bank of China Ltd., Reg. S 0% 09/07/2024	EUR	20.000.000	19.919.229	0,44				<b>39.687.059</b>	<b>0,88</b>
China Construction Bank Corp. 0% 18/06/2024	EUR	35.000.000	34.932.353	0,78	<i>Norwegen</i>				
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0% 07/06/2024	EUR	25.000.000	24.981.187	0,55	DNB Bank ASA 0% 03/07/2024	EUR	20.000.000	19.933.252	0,44
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0% 17/06/2024	EUR	40.000.000	39.926.977	0,89				<b>19.933.252</b>	<b>0,44</b>
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0% 04/07/2024	EUR	10.000.000	9.963.545	0,22	<i>Südkorea</i>				
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0% 17/07/2024	EUR	5.000.000	4.974.817	0,11	Industrial Bank of Korea 0% 18/11/2024	EUR	53.000.000	52.073.626	1,16
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0% 31/07/2024	EUR	4.000.000	3.973.865	0,09	Keb Hana Bank 0% 17/06/2024	EUR	15.000.000	14.972.616	0,33
			<b>138.671.973</b>	<b>3,08</b>	Keb Hana Bank 0% 18/07/2024	EUR	17.000.000	16.912.560	0,38
<i>Dänemark</i>					Keb Hana Bank 0% 26/08/2024	EUR	34.000.000	33.681.252	0,75
Danske Bank A/S 0% 11/06/2024	EUR	13.000.000	12.985.082	0,29	Keb Hana Bank 0% 16/09/2024	EUR	4.000.000	3.953.247	0,09
Danske Bank A/S 0% 12/08/2024	EUR	6.000.000	5.954.483	0,13	Keb Hana Bank 0% 17/10/2024	EUR	5.000.000	4.924.330	0,11
			<b>18.939.565</b>	<b>0,42</b>	Keb Hana Bank 0% 06/11/2024	EUR	15.000.000	14.739.338	0,33
<i>Finnland</i>					Kookmin Bank 0% 17/07/2024	EUR	45.000.000	44.781.013	0,99
Nordea Bank Abp 0% 03/06/2024	EUR	12.500.000	12.496.126	0,28	Kookmin Bank 0% 15/08/2024	EUR	10.000.000	9.921.056	0,22
Nordea Bank Abp 0% 06/09/2024	EUR	10.000.000	9.899.571	0,22	Kookmin Bank 0% 30/08/2024	EUR	4.000.000	3.962.084	0,09
Nordea Bank Abp 0% 25/11/2024	EUR	40.000.000	39.271.199	0,87	Kookmin Bank 0% 20/09/2024	EUR	10.000.000	9.883.718	0,22
			<b>61.666.896</b>	<b>1,37</b>	Kookmin Bank 0% 26/11/2024	EUR	20.000.000	19.632.354	0,44
<i>Frankreich</i>					Kookmin Bank 0% 27/11/2024	EUR	18.000.000	17.667.324	0,39
Credit Agricole SA 0% 22/11/2024	EUR	39.000.000	38.299.017	0,85	Woori Bank 0% 17/06/2024	EUR	20.000.000	19.964.740	0,44
Credit Agricole SA 0% 26/11/2024	EUR	35.000.000	34.356.955	0,76	Woori Bank 0% 16/09/2024	EUR	15.000.000	14.831.702	0,33
Credit Agricole SA 0% 27/11/2024	EUR	5.000.000	4.907.638	0,11	Woori Bank 0% 10/02/2025	EUR	6.000.000	5.843.902	0,13
Credit Agricole SA 0% 02/01/2025	EUR	15.000.000	14.669.754	0,33				<b>287.744.862</b>	<b>6,40</b>
Credit Agricole SA 0% 11/04/2025	EUR	10.000.000	9.684.597	0,22	<i>Großbritannien</i>				
			<b>101.917.961</b>	<b>2,27</b>	Goldman Sachs International Bank 0% 09/09/2024	EUR	12.000.000	11.874.037	0,27
<i>Irland</i>					Goldman Sachs International Bank 0% 15/11/2024	EUR	12.000.000	11.792.617	0,26
Bank of America Europe DAC 0% 14/11/2024	EUR	20.000.000	19.660.775	0,44	Goldman Sachs International Bank 0% 16/12/2024	EUR	40.000.000	39.184.008	0,87
Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 30/08/2024	EUR	20.000.000	19.805.766	0,44	Lloyds Bank plc 0% 11/07/2024	EUR	6.000.000	5.975.130	0,13
Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 27/09/2024	EUR	25.000.000	24.684.200	0,55	Mizuho International plc 0% 03/06/2024	EUR	1.000.000	999.680	0,02
Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 01/10/2024	EUR	5.000.000	4.934.767	0,11	Mizuho International plc 0% 03/12/2024	EUR	13.000.000	12.755.232	0,29
Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 09/10/2024	EUR	20.000.000	19.722.521	0,44	Mizuho International plc, FRN 4,179% 15/07/2024	EUR	10.000.000	10.001.853	0,22
Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 03/12/2024	EUR	4.000.000	3.923.024	0,09	National Westminster Bank plc 0% 11/09/2024	EUR	15.000.000	14.840.826	0,33
Wells Fargo Bank International Unlimited Co. 0% 03/12/2024	EUR	20.000.000	19.610.323	0,43	Standard Chartered Bank, FRN 4,281% 09/01/2025	EUR	19.000.000	19.011.549	0,42
			<b>112.341.376</b>	<b>2,50</b>				<b>126.434.932</b>	<b>2,81</b>
<i>Japan</i>					<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>				
Chiba Bank Ltd. 0% 13/08/2024	EUR	24.000.000	23.818.682	0,53	Bank of America NA 0% 13/09/2024	EUR	20.000.000	19.786.100	0,44
Chiba Bank Ltd. 0% 19/08/2024	EUR	16.000.000	15.869.051	0,35	Bank of America NA 0% 20/11/2024	EUR	35.000.000	34.385.208	0,76
Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 12/06/2024	EUR	14.000.000	13.981.963	0,31	Citibank NA 0% 17/06/2024	EUR	16.000.000	15.971.792	0,36
Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 24/06/2024	EUR	15.000.000	14.961.400	0,33	Citibank NA 0% 07/11/2024	EUR	15.000.000	14.752.765	0,33
Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 02/07/2024	EUR	20.000.000	19.931.436	0,44				<b>84.895.865</b>	<b>1,89</b>
Mizuho Bank Ltd. 0% 17/06/2024	EUR	2.000.000	1.996.380	0,05	<b>Einlagezertifikate insgesamt</b>				
Mizuho Corporate Bank Ltd. 0% 29/08/2024	EUR	17.000.000	16.836.267	0,37				<b>1.304.900.286</b>	<b>29,02</b>
Mizuho Corporate Bank Ltd. 0% 14/11/2024	EUR	20.000.000	19.662.369	0,44	<b>Commercial Papers</b>				
					<i>Australien</i>				
<b>Einlagezertifikate insgesamt</b>					Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0% 05/07/2024	EUR	35.000.000	34.876.159	0,77
					Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0% 27/08/2024	EUR	30.000.000	29.730.993	0,66
					Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0% 04/10/2024	EUR	35.000.000	34.551.207	0,77
					Macquarie Bank Ltd. 0% 03/09/2024	EUR	20.000.000	19.805.282	0,44
					Macquarie Bank Ltd. 0% 23/09/2024	EUR	27.000.000	26.681.879	0,59



JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens
Macquarie Bank Ltd. 0% 28/10/2024	EUR	19.000.000	18.708.153	0,42	UNEDIC SA 0% 05/06/2024	EUR	20.000.000	19.989.284	0,45
Macquarie Bank Ltd. 0% 15/11/2024	EUR	10.000.000	9.828.010	0,22	UNEDIC SA 0% 16/08/2024	EUR	5.000.000	4.959.538	0,11
			<b>174.181.683</b>	<b>3,87</b>				<b>492.122.316</b>	<b>10,94</b>
<i>Belgien</i>					<i>Deutschland</i>				
Bridgestone Europe NV 0% 25/10/2024	EUR	2.000.000	1.968.075	0,04	BASF SE 0% 26/09/2024	EUR	30.000.000	29.637.327	0,66
Bridgestone Europe NV 0% 29/10/2024	EUR	16.000.000	15.737.816	0,35	DZ Bank AG 0% 31/10/2024	EUR	5.000.000	4.920.945	0,11
			<b>17.705.891</b>	<b>0,39</b>	DZ Bank AG 0% 17/02/2025	EUR	41.000.000	39.917.744	0,89
<i>Kanada</i>					Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0% 05/06/2024				
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 29/07/2024	EUR	10.000.000	9.937.444	0,22	Standard Chartered Bank 0% 10/06/2024	EUR	40.000.000	39.979.455	0,89
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 16/09/2024	EUR	20.000.000	19.773.209	0,44	Standard Chartered Bank 0% 27/02/2025	EUR	10.000.000	9.989.622	0,22
			<b>29.710.653</b>	<b>0,66</b>	Standard Chartered Bank 0% 03/03/2025	EUR	19.000.000	18.473.558	0,41
<i>China</i>					Standard Chartered Bank 0% 09/05/2025				
Bank of China Ltd. 0% 02/07/2024	EUR	9.000.000	8.969.118	0,20		EUR	18.000.000	17.377.339	0,38
Bank of China Ltd. 0% 18/07/2024	EUR	5.000.000	4.974.282	0,11		EUR	18.000.000	17.377.339	0,38
			<b>13.943.400</b>	<b>0,31</b>	<i>Irland</i>				
<i>Dänemark</i>					Caterpillar International Finance DAC 0% 13/06/2024				
Danske Bank A/S 0% 07/03/2025	EUR	15.000.000	14.575.266	0,32	CRH Finance DAC 0% 11/06/2024	EUR	37.000.000	36.957.089	0,82
Danske Bank A/S 0% 14/04/2025	EUR	20.000.000	19.358.146	0,43	Matchpoint Finance plc 0% 04/06/2024	EUR	11.000.000	10.995.211	0,24
			<b>33.933.412</b>	<b>0,75</b>	Matchpoint Finance plc 0% 11/06/2024	EUR	20.000.000	19.976.073	0,44
<i>Finnland</i>					Matchpoint Finance plc 0% 03/07/2024				
OP Corporate Bank plc 0% 11/06/2024	EUR	10.000.000	9.988.616	0,22	Matchpoint Finance plc 0% 03/09/2024	EUR	40.000.000	39.856.781	0,89
OP Corporate Bank plc 0% 09/09/2024	EUR	25.000.000	24.740.177	0,55	Matchpoint Finance plc 0% 06/11/2024	EUR	10.000.000	9.897.645	0,22
OP Corporate Bank plc 0% 13/05/2025	EUR	40.000.000	38.621.614	0,86	Matchpoint Finance plc 0% 14/11/2024	EUR	5.000.000	4.915.229	0,11
OP Corporate Bank plc 0% 23/05/2025	EUR	45.000.000	43.407.515	0,97	Matchpoint Finance plc 0% 04/12/2024	EUR	20.000.000	19.644.325	0,44
			<b>116.757.922</b>	<b>2,60</b>		EUR	11.000.000	10.789.391	0,24
<i>Frankreich</i>					<i>Jersey</i>				
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 13/06/2024	EUR	15.500.000	15.478.771	0,34	Royal Bank of Scotland International Ltd. (The) 0% 28/10/2024	EUR	30.000.000	29.535.675	0,66
AXA Banque SACA 0% 19/08/2024	EUR	15.000.000	14.877.825	0,33		EUR	30.000.000	29.535.675	0,66
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0% 26/11/2024	EUR	19.000.000	18.650.736	0,42	<i>Luxemburg</i>				
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0% 29/11/2024	EUR	35.000.000	34.346.055	0,76	Albion Capital Corp. SA 0% 24/06/2024	EUR	4.427.000	4.415.599	0,10
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0% 04/02/2025	EUR	20.000.000	19.491.658	0,43	Intesa Sanpaolo Bank Luxembourg SA 0% 14/08/2024	EUR	30.000.000	29.767.750	0,66
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0% 04/03/2025	EUR	10.000.000	9.718.036	0,22	Nestle Finance International Ltd. 0% 03/06/2024	EUR	25.000.000	24.992.211	0,56
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0% 10/04/2025	EUR	15.000.000	14.523.058	0,32	Sunderland Receivables SA 0% 18/06/2024	EUR	6.000.000	5.988.353	0,13
Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN 4,268% 23/01/2025	EUR	11.000.000	11.004.599	0,25	Sunderland Receivables SA 0% 28/06/2024	EUR	10.000.000	9.969.836	0,22
BPCE SA 0% 21/11/2024	EUR	45.000.000	44.195.244	0,98	Sunderland Receivables SA 0% 13/08/2024	EUR	7.000.000	6.944.111	0,16
BPCE SA 0% 26/11/2024	EUR	22.000.000	21.595.589	0,48	Sunderland Receivables SA 0% 30/08/2024	EUR	12.000.000	11.881.878	0,27
BPCE SA 0% 29/11/2024	EUR	15.000.000	14.719.738	0,33	Sunderland Receivables SA 0% 29/10/2024	EUR	7.000.000	6.886.715	0,15
BPCE SA 0% 13/01/2025	EUR	10.000.000	9.767.852	0,22	Sunderland Receivables SA 0% 06/11/2024	EUR	7.000.000	6.880.863	0,15
Bpifrance SACA 0% 04/06/2024	EUR	28.000.000	27.988.658	0,62				<b>107.727.316</b>	<b>2,40</b>
Bpifrance SACA 0% 30/09/2024	EUR	20.000.000	19.751.640	0,44	<i>Niederlande</i>				
BRED Banque Populaire SA 0% 17/09/2024	EUR	5.000.000	4.942.479	0,11	Cooperatieve Rabobank UA 0% 05/06/2024	EUR	10.000.000	9.994.781	0,22
Danone SA 0% 22/07/2024	EUR	20.000.000	19.892.327	0,44	Daimler Truck International Finance BV 0% 10/06/2024	EUR	8.000.000	7.991.143	0,18
Dexia SA 0% 11/06/2024	EUR	6.500.000	6.492.422	0,14	Heineken NV 0% 13/06/2024	EUR	10.000.000	9.986.513	0,22
FS Societe Generale/Ossiam, FRN 4,23% 04/03/2025	EUR	35.000.000	35.002.557	0,78	Heineken NV 0% 18/07/2024	EUR	9.000.000	8.955.271	0,20
La Banque Postale SA 0% 11/11/2024	EUR	20.000.000	19.659.341	0,44	LSEG Netherlands BV 0% 24/06/2024	EUR	20.000.000	19.948.267	0,44
La Banque Postale SA, FRN 4,088% 23/07/2024	EUR	50.000.000	50.002.193	1,11	PACCAR Financial Europe BV 0% 06/06/2024	EUR	5.000.000	4.996.885	0,11
LMA SA 0% 23/08/2024	EUR	10.000.000	9.912.599	0,22	Toyota Motor Finance Netherlands BV 0% 18/07/2024	EUR	4.000.000	3.980.121	0,09
LMA SA 0% 09/09/2024	EUR	15.000.000	14.842.438	0,33				<b>65.852.981</b>	<b>1,46</b>
LMA SA 0% 29/11/2024	EUR	1.500.000	1.471.974	0,03					
Natixis SA 0% 14/11/2024	GBP	13.000.000	14.868.949	0,33					
Natixis SA, FRN 4,237% 15/08/2024	EUR	10.000.000	10.002.588	0,22					
Satellite SASU 0% 30/07/2024	EUR	4.000.000	3.974.168	0,09					

JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens
<i>Spanien</i>					<i>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</i>				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0% 28/06/2024	EUR	8.100.000	8.076.506	0,18	<i>Frankreich</i>				
Banco Santander SA 0% 03/09/2024	EUR	10.000.000	9.901.106	0,22	BOFA Securities Europe SA 3,78% 03/06/2024	EUR	40.000.000	40.000.000	0,89
Banco Santander SA 0% 03/09/2024	EUR	10.000.000	9.901.106	0,22				<b>40.000.000</b>	<b>0,89</b>
Banco Santander SA 0% 04/10/2024	EUR	20.000.000	19.738.950	0,44					
			<b>47.617.668</b>	<b>1,06</b>	<i>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</i>				
								<b>40.000.000</b>	<b>0,89</b>
<i>Schweden</i>					<i>Termineinlagen</i>				
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0% 17/06/2024	EUR	10.000.000	9.982.262	0,22	<i>Österreich</i>				
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0% 04/07/2024	EUR	20.000.000	19.929.228	0,45	Erste Group Bank AG 3,9% 03/06/2024	EUR	50.000.000	50.000.000	1,11
Svenska Handelsbanken AB 0% 19/07/2024	EUR	15.000.000	14.922.688	0,33				<b>50.000.000</b>	<b>1,11</b>
Svenska Handelsbanken AB 0% 25/07/2024	EUR	9.000.000	8.947.938	0,20	<i>Belgien</i>				
Svenska Handelsbanken AB 0% 11/09/2024	EUR	20.000.000	19.785.904	0,44	KBC Bank NV 3,89% 03/06/2024	EUR	35.000.000	35.000.000	0,78
Svenska Handelsbanken AB 0% 15/10/2024	EUR	15.000.000	14.787.616	0,33				<b>35.000.000</b>	<b>0,78</b>
Svenska Handelsbanken AB 0% 14/11/2024	EUR	10.000.000	9.828.253	0,22	<i>Frankreich</i>				
Svenska Handelsbanken AB 0% 02/12/2024	EUR	20.000.000	19.620.650	0,44	BRED Banque Populaire SA 3,86% 03/06/2024	EUR	50.000.000	50.000.000	1,11
Svenska Handelsbanken AB 0% 06/03/2025	EUR	38.000.000	36.931.932	0,82	BRED Banque Populaire SA 3,9% 03/06/2024	EUR	100.000	100.000	0,01
Svenska Handelsbanken AB 0% 20/03/2025	EUR	20.000.000	19.411.055	0,43	La Banque Postale SA 3,88% 03/06/2024	EUR	90.000.000	90.000.000	2,00
Svenska Handelsbanken AB 0% 16/04/2025	EUR	15.000.000	14.519.793	0,32				<b>140.100.000</b>	<b>3,12</b>
			<b>188.667.319</b>	<b>4,20</b>	<i>Niederlande</i>				
<i>Schweiz</i>					Cooperatieve Rabobank UA 3,8% 03/06/2024	EUR	50.000.000	50.000.000	1,11
UBS AG 0% 10/06/2024	EUR	35.000.000	34.963.677	0,78				<b>50.000.000</b>	<b>1,11</b>
UBS AG 0% 18/06/2024	EUR	15.000.000	14.972.002	0,33	<i>Termineinlagen insgesamt</i>				
UBS AG 0% 24/04/2025	EUR	5.000.000	4.834.245	0,11				<b>275.100.000</b>	<b>6,12</b>
			<b>54.769.924</b>	<b>1,22</b>	<i>Bankguthaben</i>				
<i>Großbritannien</i>								<b>139.097.721</b>	<b>3,09</b>
Amcor Uk Finance Plc 0% 06/06/2024	EUR	17.000.000	16.988.703	0,38	<i>Andere Aktiva/(Passiva)</i>				
Amcor Uk Finance Plc 0% 04/11/2024	EUR	15.000.000	14.741.518	0,33				<b>(54.418.425)</b>	<b>(1,21)</b>
Bank of China Ltd. 0% 29/07/2024	EUR	33.000.000	32.791.493	0,73	<i>Nettovermögen insgesamt</i>				
Barclays Bank plc 0% 18/09/2024	EUR	15.000.000	14.831.969	0,33				<b>4.497.394.192</b>	<b>100,00</b>
Barclays Bank plc 0% 07/03/2025	EUR	10.000.000	9.722.551	0,22					
Mitsubishi HC Capital UK plc 0% 17/10/2024	EUR	13.000.000	12.808.916	0,28	<i>Geografische Aufteilung des Wertpapierbestandes zum 31. Mai 2024</i>				
MUFG Securities EMEA plc 0% 10/06/2024	EUR	8.000.000	7.991.409	0,18	Frankreich				18,93
Standard Chartered Bank 0% 26/07/2024	EUR	5.000.000	4.971.013	0,11	Vereinigte Staaten von Amerika				9,95
Transport for London 0% 04/07/2024	EUR	35.000.000	34.873.153	0,77	Großbritannien				6,96
Transport for London 0% 12/07/2024	EUR	10.000.000	9.955.238	0,22	Südkorea				6,47
			<b>159.675.963</b>	<b>3,55</b>	Irland				6,30
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					Schweden				5,39
Colgate Palmolive Co. 0% 13/06/2024	EUR	25.000.000	24.966.282	0,56	Kanada				5,34
Colgate Palmolive Co. 0% 18/06/2024	EUR	20.000.000	19.962.670	0,45	Australien				5,31
Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 17/06/2024	EUR	28.000.000	27.948.660	0,62	Deutschland				4,90
Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 23/09/2024	EUR	27.000.000	26.665.338	0,59	Japan				4,86
LMA SA 0% 03/06/2024	EUR	190.000.000	189.937.636	4,22	Luxemburg				4,47
Procter & Gamble Co. (The) 0% 22/07/2024	EUR	25.000.000	24.868.138	0,55	Niederlande				4,24
			<b>314.348.724</b>	<b>6,99</b>	Finnland				3,97
<i>Commercial Papers insgesamt</i>					China				3,39
			<b>2.189.517.121</b>	<b>48,68</b>	Belgien				1,66
<i>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</i>					Dänemark				1,34
			<b>3.608.349.168</b>	<b>80,23</b>	Schweiz				1,22
<i>Wertpapierbestand insgesamt</i>					Spanien				1,19
			<b>4.097.614.896</b>	<b>91,11</b>	Österreich				1,11
					Jersey				0,66
					Norwegen				0,44
					Italien				0,02
					<i>Wertpapierbestand insgesamt und geldnahe Anlagen</i>				
									<b>98,12</b>
					<i>Bankguthaben und andere Aktiva/(Passiva)</i>				
									1,88
					<i>Summe</i>				
									<b>100,00</b>

JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeit	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) EUR	% des Nettovermögens
EUR	23.431.667	GBP	19.991.856	03/07/2024	Standard Chartered	36.232	-
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften insgesamt</b>						<b>36.232</b>	<b>-</b>
EUR	23.354.582	GBP	19.991.856	05/06/2024	State Street	(67.489)	-
GBP	19.991.856	EUR	23.457.527	05/06/2024	Standard Chartered	(35.456)	-
<b>Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften insgesamt</b>						<b>(102.945)</b>	<b>-</b>
<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften</b>						<b>(66.713)</b>	<b>-</b>

JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert SGD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert SGD	% des Netto- vermö- gens
<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					Canadian Imperial Bank of Commerce, Reg. S 0% 23/05/2025	SGD	15.000.000	14.461.568	0,73
<b>Anleihen</b>					Toronto-Dominion Bank (The) 0% 22/07/2024	SGD	30.000.000	29.834.539	1,51
<i>Australien</i>								<b>127.576.753</b>	<b>6,44</b>
Commonwealth Bank of Australia 4,15% 06/10/2024	SGD	15.000.000	14.995.448	0,76	<i>Japan</i>				
Commonwealth Bank of Australia, Reg. S 4,3% 14/07/2024	SGD	10.000.000	9.997.852	0,50	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., Reg. S 3,7% 06/09/2024	SGD	20.000.000	19.993.210	1,01
			<b>24.993.300</b>	<b>1,26</b>	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., Reg. S 0% 30/10/2024	SGD	20.000.000	19.691.774	1,00
<i>Singapur</i>								<b>39.684.984</b>	<b>2,01</b>
Monetary Authority of Singapore, FRN 3,981% 07/06/2024	SGD	10.000.000	10.000.217	0,50	<b>Einlagezertifikate insgesamt</b>			<b>167.261.737</b>	<b>8,45</b>
Monetary Authority of Singapore, FRN 4,15% 07/06/2024	SGD	30.000.000	30.001.291	1,52	<b>Commercial Papers</b>				
Monetary Authority of Singapore, FRN 4,007% 05/07/2024	SGD	30.000.000	30.006.863	1,52	<i>Kanada</i>				
Monetary Authority of Singapore, FRN 3,889% 02/08/2024	SGD	25.000.000	25.003.259	1,26	Toronto-Dominion Bank (The) 0% 17/09/2024	SGD	14.000.000	13.835.258	0,70
Monetary Authority of Singapore, FRN 3,855% 06/09/2024	SGD	15.000.000	15.009.306	0,76				<b>13.835.258</b>	<b>0,70</b>
Monetary Authority of Singapore, FRN 3,908% 06/09/2024	SGD	30.000.000	30.006.144	1,52	<i>Frankreich</i>				
Monetary Authority of Singapore, FRN 3,884% 04/10/2024	SGD	40.000.000	40.012.515	2,02	BRED Banque Populaire SA 0% 04/11/2024	SGD	20.000.000	19.682.074	0,99
Monetary Authority of Singapore, FRN 3,88% 01/11/2024	SGD	35.000.000	35.008.126	1,77	LMA SA 0% 27/01/2025	SGD	20.000.000	19.535.725	0,99
Monetary Authority of Singapore, FRN 3,898% 07/03/2025	SGD	10.000.000	10.002.090	0,51				<b>39.217.799</b>	<b>1,98</b>
Monetary Authority of Singapore Bill 0% 14/06/2024	SGD	15.000.000	14.980.212	0,76	<b>Commercial Papers insgesamt</b>			<b>53.053.057</b>	<b>2,68</b>
Monetary Authority of Singapore Bill 0% 21/06/2024	SGD	30.000.000	29.940.734	1,51	<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>1.215.028.885</b>	<b>61,37</b>
Monetary Authority of Singapore Bill 0% 28/06/2024	SGD	10.000.000	9.974.260	0,50	<b>Wertpapierbestand insgesamt</b>			<b>1.215.028.885</b>	<b>61,37</b>
Monetary Authority of Singapore Bill 0% 28/06/2024	SGD	50.000.000	49.866.834	2,52	<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>				
Monetary Authority of Singapore Bill 0% 05/07/2024	SGD	50.000.000	49.833.342	2,52	<i>Australien</i>				
Monetary Authority of Singapore Bill 0% 19/07/2024	SGD	30.000.000	29.855.038	1,51	National Australia Bank Ltd. 3,6% 03/06/2024	SGD	230.000.000	230.000.000	11,62
Monetary Authority of Singapore Bill 0% 12/08/2024	SGD	30.000.000	29.779.496	1,50				<b>230.000.000</b>	<b>11,62</b>
Monetary Authority of Singapore Bill 0% 16/08/2024	SGD	30.000.000	29.770.194	1,50	<i>Großbritannien</i>				
Monetary Authority of Singapore Bill 0% 23/08/2024	SGD	30.000.000	29.745.595	1,50	Standard Chartered Bank 3,45% 03/06/2024	SGD	150.000.000	150.000.000	7,58
Singapore Treasury Bill 0% 11/06/2024	SGD	60.000.000	59.942.104	3,03				<b>150.000.000</b>	<b>7,58</b>
Singapore Treasury Bill 0% 25/06/2024	SGD	60.000.000	59.852.665	3,02	<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>			<b>380.000.000</b>	<b>19,20</b>
Singapore Treasury Bill 0% 09/07/2024	SGD	50.000.000	49.805.796	2,52	<b>Termineinlagen</b>				
Singapore Treasury Bill 0% 23/07/2024	SGD	50.000.000	49.733.979	2,51	<i>Niederlande</i>				
Singapore Treasury Bill 0% 06/08/2024	SGD	40.000.000	39.722.859	2,01	ING Bank NV 3,5% 03/06/2024	SGD	170.000.000	170.000.000	8,59
Singapore Treasury Bill 0% 20/08/2024	SGD	20.000.000	19.834.291	1,00				<b>170.000.000</b>	<b>8,59</b>
Singapore Treasury Bill 0% 01/10/2024	SGD	50.000.000	49.371.988	2,49	<i>Vereinigte Arabische Emirate</i>				
Singapore Treasury Bill 0% 15/10/2024	SGD	25.000.000	24.651.140	1,25	First Abu Dhabi Bank PJSC 3,3% 03/06/2024	SGD	170.000.000	170.000.000	8,58
Singapore Treasury Bill 0% 29/10/2024	SGD	30.000.000	29.546.188	1,49				<b>170.000.000</b>	<b>8,58</b>
Singapore Treasury Bill 0% 12/11/2024	SGD	50.000.000	49.176.387	2,48	<b>Termineinlagen insgesamt</b>			<b>340.000.000</b>	<b>17,17</b>
Singapore Treasury Bill 0% 26/11/2024	SGD	40.000.000	39.287.878	1,98	<b>Bankguthaben</b>			<b>50.121.122</b>	<b>2,53</b>
			<b>969.720.791</b>	<b>48,98</b>	<b>Andere Aktiva/(Passiva)</b>			<b>(5.321.192)</b>	<b>(0,27)</b>
<b>Anleihen insgesamt</b>			<b>994.714.091</b>	<b>50,24</b>	<b>Nettovermögen insgesamt</b>			<b>1.979.828.815</b>	<b>100,00</b>
<b>Einlagezertifikate</b>									
<i>Kanada</i>									
Bank of Montreal, Reg. S 0% 14/11/2024	SGD	30.000.000	29.467.623	1,49					
Bank of Montreal, Reg. S 0% 09/01/2025	SGD	20.000.000	19.533.222	0,98					
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reg. S 0% 05/09/2024	SGD	20.000.000	19.789.876	1,00					
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reg. S 0% 02/05/2025	SGD	15.000.000	14.489.925	0,73					

## JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

---

Geografische Aufteilung des Wertpapierbestandes zum 31. Mai 2024	% des Netto- vermögens
Singapur	48,98
Australien	12,88
Niederlande	8,59
Vereinigte Arabische Emirate	8,58
Großbritannien	7,58
Kanada	7,14
Japan	2,01
Frankreich	1,98
<b>Wertpapierbestand insgesamt und geldnahe Anlagen</b>	<b>97,74</b>
Bankguthaben und andere Aktiva/(Passiva)	2,26
<b>Summe</b>	<b>100,00</b>

JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert GBP	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert GBP	% des Netto- vermö- gens	
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<i>Belgien</i>					
<b>Anleihen</b>					KBC Bank NV 0% 03/07/2024					
<i>Australien</i>					KBC Bank NV 0% 09/07/2024					
Commonwealth Bank of Australia, Reg. S, FRN 5,655% 13/11/2024	GBP	50.000.000	50.026.949	0,35	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 16/08/2024					
Westpac Banking Corp., Reg. S, FRN 5,628% 22/11/2024	GBP	140.000.000	140.082.081	0,99						
				<b>190.109.030</b>	<b>1,34</b>					
<i>Kanada</i>					<i>Kanada</i>					
Bank of Nova Scotia (The), Reg. S, FRN 5,754% 22/06/2024	GBP	100.000.000	100.008.990	0,70	Bank of Montreal 0% 04/04/2025					
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reg. S, FRN 5,755% 20/06/2024	GBP	132.000.000	132.005.096	0,93	Royal Bank of Canada 0% 02/01/2025					
Royal Bank of Canada, FRN 5,535% 27/01/2025	GBP	75.000.000	74.979.725	0,53	Toronto-Dominion Bank (The) 0% 28/04/2025					
Toronto-Dominion Bank (The), Reg. S, FRN 5,757% 17/06/2024	GBP	120.000.000	120.005.446	0,85	Toronto-Dominion Bank (The) 0% 29/04/2025					
Toronto-Dominion Bank (The), Reg. S, FRN 5,701% 25/09/2024	GBP	100.000.000	100.045.000	0,70	Toronto-Dominion Bank (The), FRN 5,494% 14/05/2025					
				<b>527.044.257</b>	<b>3,71</b>					
<i>Norwegen</i>					<i>China</i>					
Kommunalbanken A/S, Reg. S 1% 12/12/2024	GBP	22.494.000	21.995.353	0,16	Bank of China Ltd. 0% 02/07/2024					
				<b>21.995.353</b>	<b>0,16</b>	China Construction Bank Corp. 0% 19/06/2024				
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					China Construction Bank Corp. 0% 24/06/2024					
Metropolitan Life Global Funding I, Reg. S, FRN 5,811% 12/09/2024	GBP	142.000.000	142.034.080	1,00	China Construction Bank Corp. 0% 08/08/2024					
				<b>142.034.080</b>	<b>1,00</b>	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0% 05/07/2024				
<b>Anleihen insgesamt</b>					Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0% 16/08/2024					
				<b>881.182.720</b>	<b>6,21</b>					
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>					<b>476.834.330</b>					
				<b>881.182.720</b>	<b>6,21</b>					
<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>271.777.309</b>					
<b>Einlagenzertifikate</b>					<b>1,92</b>					
<i>Australien</i>					<i>Finnland</i>					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0% 07/10/2024	GBP	110.000.000	107.972.550	0,76	Nordea Bank Abp 0% 19/07/2024					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0% 01/05/2025	GBP	70.000.000	66.693.927	0,47	Nordea Bank Abp 0% 19/08/2024					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN 5,64% 17/06/2024	GBP	140.000.000	140.015.173	0,99	Nordea Bank Abp 0% 15/10/2024					
Commonwealth Bank of Australia 0% 02/08/2024	GBP	1.500.000	1.487.184	0,01	Nordea Bank Abp 5,29% 06/11/2024					
Commonwealth Bank of Australia, FRN 5,736% 08/07/2024	GBP	100.000.000	100.031.099	0,71	Nordea Bank Abp 0% 16/04/2025					
Commonwealth Bank of Australia, FRN 5,669% 07/01/2025	GBP	145.350.000	145.441.453	1,03						
National Australia Bank Ltd. 0% 02/10/2024	GBP	50.000.000	49.116.479	0,35	<i>Frankreich</i>					
National Australia Bank Ltd. 0% 08/10/2024	GBP	145.000.000	142.313.919	1,00	Credit Agricole SA 0% 02/01/2025					
National Australia Bank Ltd. 0% 04/11/2024	GBP	100.000.000	97.763.125	0,69	Credit Agricole SA 0% 13/03/2025					
National Australia Bank Ltd. 0% 02/12/2024	GBP	75.000.000	73.024.763	0,51	Societe Generale SA 0% 31/10/2024					
National Australia Bank Ltd. 0% 02/01/2025	GBP	75.000.000	72.704.690	0,51						
National Australia Bank Ltd., FRN 5,644% 04/02/2025	GBP	70.000.000	70.031.489	0,49	<i>Deutschland</i>					
National Australia Bank Ltd., FRN 5,508% 22/05/2025	GBP	100.000.000	99.990.399	0,70	DZ Bank AG 0% 25/10/2024					
				<b>1.166.586.250</b>	<b>8,22</b>					
<i>Japan</i>					<i>Japan</i>					
					Mizuho Bank Ltd. 0% 17/06/2024					
					Mizuho Bank Ltd. 0% 03/07/2024					
					MUFG Bank Ltd. 0% 27/06/2024					
					MUFG Bank Ltd. 0% 02/08/2024					
					Norinchukin Bank (The) 0% 04/06/2024					
					Norinchukin Bank (The) 0% 26/07/2024					
					Norinchukin Bank (The) 0% 04/09/2024					
					Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 24/06/2024					
					Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 08/07/2024					
				<b>758.359.686</b>	<b>5,35</b>					
<i>Niederlande</i>					<i>Niederlande</i>					
					ABN AMRO Bank NV 0% 03/06/2024					
					ABN AMRO Bank NV 0% 19/07/2024					
					ABN AMRO Bank NV 0% 04/09/2024					
					ABN AMRO Bank NV 0% 04/09/2024					
				<b>230.072.135</b>	<b>1,62</b>					





JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert GBP	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert GBP	% des Netto- vermö- gens
Transport for London 0% 04/06/2024	GBP	70.000.000	69.980.695	0,49	Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith, Inc. 5,2% 03/06/2024	GBP	150.000.000	150.000.000	1,06
Transport for London 0% 20/06/2024	GBP	70.000.000	69.853.972	0,49	MUFG Securities EMEA plc 5,2% 03/06/2024	GBP	50.000.000	50.000.000	0,35
			<b>317.232.283</b>	<b>2,23</b>	MUFG Securities EMEA plc 5,2% 04/06/2024	GBP	50.000.000	50.000.000	0,35
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					Natwest Markets Securities, Inc. 5,21% 03/06/2024	GBP	200.000.000	200.000.000	1,41
Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 10/06/2024	GBP	8.000.000	7.991.679	0,06	Santander UK plc 5,22% 03/06/2024	GBP	300.000.000	300.000.000	2,11
Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 05/07/2024	GBP	100.000.000	99.525.089	0,70	Standard Chartered Bank 5,22% 03/06/2024	GBP	150.000.000	150.000.000	1,06
Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 05/08/2024	GBP	120.000.000	118.905.833	0,84	Toronto-Dominion Bank (The) 5,21% 03/06/2024	GBP	100.000.000	100.000.000	0,70
Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 14/08/2024	GBP	75.000.000	74.213.091	0,52	Toronto-Dominion Bank (The) 5,21% 03/06/2024	GBP	200.000.000	200.000.000	1,41
LMA SA 0% 03/06/2024	GBP	178.350.000	178.324.505	1,26	Toronto-Dominion Bank (The) 5,21% 04/06/2024	GBP	200.000.000	200.000.000	1,41
Manhattan Asset Funding Co. LLC 0% 20/06/2024	GBP	47.000.000	46.877.249	0,33					
			<b>525.837.446</b>	<b>3,71</b>				<b>1.877.000.000</b>	<b>13,23</b>
<b>Commercial Papers insgesamt</b>			<b>3.646.235.088</b>	<b>25,70</b>	<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>				
<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>8.375.233.805</b>	<b>59,03</b>	Goldman Sachs International Bank 5,22% 03/06/2024	GBP	200.000.000	200.000.000	1,41
<b>Wertpapierbestand insgesamt</b>			<b>9.256.416.525</b>	<b>65,24</b>	JPMorgan Chase Bank NA 5,21% 03/06/2024	GBP	200.000.000	200.000.000	1,41
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>			<b>400.000.000</b>	<b>2,82</b>
<i>Australien</i>					<b>Terminanlagen</b>				
Commonwealth Bank of Australia 5,22% 03/06/2024	GBP	45.976.000	45.976.000	0,32	<i>Österreich</i>				
Commonwealth Bank of Australia 5,22% 03/06/2024	GBP	304.024.000	304.024.000	2,14	Erste Group Bank AG 5,18% 03/06/2024	GBP	50.000.000	50.000.000	0,35
Commonwealth Bank of Australia 5,22% 04/06/2024	GBP	43.431.000	43.431.000	0,31				<b>50.000.000</b>	<b>0,35</b>
Commonwealth Bank of Australia 5,22% 04/06/2024	GBP	306.569.000	306.569.000	2,16	<i>Kanada</i>				
National Australia Bank Ltd. 5,2% 03/06/2024	GBP	100.000.000	100.000.000	0,71	Royal Bank of Canada 5,2% 03/06/2024	GBP	100.000.000	100.000.000	0,71
			<b>800.000.000</b>	<b>5,64</b>				<b>100.000.000</b>	<b>0,71</b>
<i>Kanada</i>					<i>China</i>				
Bank of Montreal 5,21% 03/06/2024	GBP	120.000.000	120.000.000	0,85	Agricultural Bank of China Ltd. 5,2% 03/06/2024	GBP	75.000.000	75.000.000	0,53
Bank of Montreal 5,21% 04/06/2024	GBP	120.000.000	120.000.000	0,85	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 5,21% 03/06/2024	GBP	50.000.000	50.000.000	0,35
Bank of Nova Scotia (The) 5,21% 03/06/2024	GBP	250.000.000	250.000.000	1,76				<b>125.000.000</b>	<b>0,88</b>
Bank of Nova Scotia (The) 5,21% 04/06/2024	GBP	250.000.000	250.000.000	1,76	<i>Frankreich</i>				
Royal Bank of Canada 5,2% 03/06/2024	GBP	50.000.000	50.000.000	0,35	BNP Paribas SA 5,2% 03/06/2024	GBP	100.000.000	100.000.000	0,70
			<b>790.000.000</b>	<b>5,57</b>	BRED Banque Populaire SA 5,2% 03/06/2024	GBP	100.000.000	100.000.000	0,71
<i>Frankreich</i>					<b>200.000.000</b>			<b>1,41</b>	
BNP Paribas SA 5,22% 03/06/2024	GBP	200.000.000	200.000.000	1,41	<i>Deutschland</i>				
Credit Agricole Corporate and Investment Bank SA 5,22% 03/06/2024	GBP	100.000.000	100.000.000	0,70	DZ Bank AG 5,18% 03/06/2024	GBP	25.000.000	25.000.000	0,18
Societe Generale SA 5,22% 03/06/2024	GBP	200.000.000	200.000.000	1,41				<b>25.000.000</b>	<b>0,18</b>
			<b>500.000.000</b>	<b>3,52</b>	<i>Singapur</i>				
<i>Singapur</i>					DBS Bank Ltd. 5,21% 03/06/2024	GBP	39.400.000	39.400.000	0,28
DBS Bank Ltd. 5,21% 03/06/2024	GBP	77.400.000	77.400.000	0,55	Mizuho Bank Ltd. 5,19% 03/06/2024	GBP	50.000.000	50.000.000	0,35
DBS Bank Ltd. 5,21% 03/06/2024	GBP	81.400.000	81.400.000	0,57	MUFG Bank Ltd. 5,2% 03/06/2024	GBP	100.000.000	100.000.000	0,71
DBS Bank Ltd. 5,21% 04/06/2024	GBP	39.500.000	39.500.000	0,28	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 5,19% 03/06/2024	GBP	50.000.000	50.000.000	0,35
DBS Bank Ltd. 5,21% 04/06/2024	GBP	77.600.000	77.600.000	0,55				<b>200.000.000</b>	<b>1,41</b>
DBS Bank Ltd. 5,21% 04/06/2024	GBP	81.500.000	81.500.000	0,57	<i>Niederlande</i>				
			<b>396.800.000</b>	<b>2,80</b>	Cooperatieve Rabobank UA 5,2% 03/06/2024	GBP	50.000.000	50.000.000	0,35
<i>Spanien</i>					ING Bank NV 5,17% 03/06/2024	GBP	50.000.000	50.000.000	0,35
Banco Santander SA 5,22% 03/06/2024	GBP	100.000.000	100.000.000	0,70				<b>100.000.000</b>	<b>0,70</b>
			<b>100.000.000</b>	<b>0,70</b>	<i>Großbritannien</i>				
<i>Großbritannien</i>					Barclays Bank plc 5,21% 03/06/2024	GBP	86.000.000	86.000.000	0,61
Barclays Bank plc 5,21% 03/06/2024	GBP	86.000.000	86.000.000	0,61	Citigroup Global Markets Ltd. 5,24% 03/06/2024	GBP	391.000.000	391.000.000	2,76
Citigroup Global Markets Ltd. 5,24% 03/06/2024	GBP	391.000.000	391.000.000	2,76					



JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert GBP	% des Netto- vermö- gens
<i>Singapur</i>				
DBS Bank Ltd. 5,18% 03/06/2024	GBP	50.000.000	50.000.000	0,35
			<u>50.000.000</u>	<u>0,35</u>
<b>Termineinlagen insgesamt</b>			<b>850.000.000</b>	<b>5,99</b>
<b>Bankguthaben</b>			<b>686.969.929</b>	<b>4,84</b>
<b>Andere Aktiva/(Passiva)</b>			<b>(1.469.245.870)</b>	<b>(10,35)</b>
<b>Nettovermögen insgesamt</b>			<b><u>14.187.940.584</u></b>	<b><u>100,00</u></b>

Geografische Aufteilung des Wertpapierbestandes zum 31. Mai 2024	% des Netto- vermögens
Großbritannien	18,73
Frankreich	16,73
Australien	16,61
Kanada	12,41
Vereinigte Staaten von Amerika	9,37
Japan	6,76
China	4,94
Singapur	4,91
Niederlande	2,94
Finnland	2,63
Irland	1,77
Belgien	1,68
Norwegen	1,68
Deutschland	0,87
Spanien	0,83
Schweden	0,68
Kaimaninseln	0,60
Luxemburg	0,53
Österreich	0,35
Schweiz	0,35
Südkorea	0,14
<b>Wertpapierbestand insgesamt und geldnahe Anlagen</b>	<b>105,51</b>
Bankguthaben und andere Aktiva/(Passiva)	(5,51)
<b>Summe</b>	<b><u>100,00</u></b>

JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert GBP	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert GBP	% des Netto- vermö- gens
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<i>Großbritannien</i>				
<b>Anleihen</b>					HSBC Bank plc, Reg. S, FRN 5,962% 09/03/2025				
<i>Australien</i>					Lloyds Banking Group plc, Reg. S 2,25% 16/10/2024				
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., Reg. S, FRN 5,544% 22/04/2025	GBP	7.000.000	6.996.209	1,01	Santander UK plc, Reg. S, FRN 5,815% 12/11/2024				
Westpac Banking Corp., Reg. S, FRN 5,628% 22/11/2024	GBP	7.500.000	7.504.397	1,09					
				<b>14.500.606</b>					
				<b>2,10</b>	<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>				
<i>Kanada</i>					Metropolitan Life Global Funding I, Reg. S, FRN 5,811% 12/09/2024				
Bank of Montreal, Reg. S 1,5% 18/12/2024	GBP	10.650.000	10.430.908	1,51					
Bank of Nova Scotia (The), Reg. S, FRN 6,26% 14/03/2025	GBP	5.400.000	5.429.257	0,78	<b>Anleihen insgesamt</b>				
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reg. S, FRN 5,755% 20/06/2024	GBP	6.000.000	6.000.590	0,87	<b>142.443.364</b>				
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reg. S, FRN 5,779% 30/06/2025	GBP	400.000	400.864	0,06	<b>20,60</b>				
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reg. S, FRN 6,257% 15/12/2025	GBP	7.000.000	7.065.534	1,02	<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>				
Royal Bank of Canada, FRN 5,535% 27/01/2025	GBP	10.000.000	9.997.297	1,45	<b>142.443.364</b>				
Royal Bank of Canada, Reg. S, FRN 5,695% 30/01/2025	GBP	600.000	600.758	0,09	<b>20,60</b>				
Toronto-Dominion Bank (The), Reg. S, FRN 5,701% 25/09/2024	GBP	4.500.000	4.502.025	0,65	<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
Toronto-Dominion Bank (The), Reg. S, FRN 5,66% 22/04/2025	GBP	10.600.000	10.613.186	1,53	<b>Anleihen</b>				
				<b>55.040.419</b>	<i>Luxemburg</i>				
				<b>7,96</b>	Silver Arrow Compartment Silver Arrow UK, Reg. S, FRN 'A' 5,759% 31/01/2031				
<i>Frankreich</i>					GBP 4.793.230 4.798.086 0,69				
Credit Agricole SA, Reg. S 1,25% 02/10/2024	GBP	4.500.000	4.439.565	0,64	<b>4.798.086</b>				
Dexia SA, Reg. S 0,25% 11/12/2024	GBP	2.000.000	1.948.860	0,28	<b>0,69</b>				
Dexia SA, Reg. S 2,125% 12/02/2025	GBP	2.100.000	2.056.446	0,30					
				<b>8.444.871</b>	<b>1,24</b>				
<i>Deutschland</i>					<i>Großbritannien</i>				
State of North Rhine-Westphalia Germany, Reg. S 0,625% 16/12/2024	GBP	8.500.000	8.292.177	1,20	Bavarian Sky UK 5 plc, Reg. S, FRN 'A' 5,829% 20/04/2031				
				<b>8.292.177</b>	GBP 3.755.360 3.763.509 0,55				
				<b>1,20</b>	<b>3.763.509</b>				
<i>Japan</i>					<b>8.561.595</b>				
Development Bank of Japan, Inc., Reg. S 1,25% 31/01/2025	GBP	10.429.000	10.163.019	1,47	<b>1,24</b>				
				<b>10.163.019</b>	<b>Einlagenzertifikate</b>				
<i>Niederlande</i>					<i>Australien</i>				
ABN AMRO Bank NV, Reg. S 1,375% 16/01/2025	GBP	6.100.000	5.957.577	0,86	Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0% 03/03/2025				
BMW International Investment BV, Reg. S 1,375% 01/10/2024	GBP	2.743.000	2.708.493	0,39	Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0% 01/05/2025				
Enel Finance International NV, Reg. S 5,625% 14/08/2024	GBP	5.064.000	5.062.645	0,73	Commonwealth Bank of Australia 0% 02/08/2024				
Mercedes-Benz International Finance BV, Reg. S 1,625% 11/11/2024	GBP	5.700.000	5.609.279	0,81	Commonwealth Bank of Australia, FRN 5,669% 07/01/2025				
Nederlandse Waterschapsbank NV, Reg. S 2% 16/12/2024	GBP	1.175.000	1.154.384	0,17	National Australia Bank Ltd. 0% 02/10/2024				
Volkswagen Financial Services NV, Reg. S 2,125% 27/06/2024	GBP	1.200.000	1.197.194	0,18	National Australia Bank Ltd. 5,87% 04/10/2024				
Volkswagen Financial Services NV, Reg. S 1,875% 03/12/2024	GBP	1.000.000	982.430	0,14	National Australia Bank Ltd. 0% 04/11/2024				
Volkswagen Financial Services NV, Reg. S 0,875% 20/02/2025	GBP	4.400.000	4.263.732	0,62	National Australia Bank Ltd. 0% 02/12/2024				
				<b>26.935.734</b>	National Australia Bank Ltd. 0% 28/02/2025				
				<b>3,90</b>	<b>47.356.464</b>				
<i>Norwegen</i>					<b>6,85</b>				
Kommunalbanken A/S, Reg. S 1% 12/12/2024	GBP	4.106.000	4.014.880	0,58	<i>Belgien</i>				
				<b>4.014.880</b>	KBC Bank NV 0% 09/07/2024				
				<b>0,58</b>	GBP 12.000.000 11.932.427 1,73				
<i>China</i>					<b>11.932.427</b>				
					<b>1,73</b>				
					<i>Kanada</i>				
					Bank of Montreal 0% 04/04/2025				
					Royal Bank of Canada 0% 08/07/2024				
				<b>26.935.734</b>	GBP 3.600.000 3.443.280 0,50				
				<b>3,90</b>	GBP 9.500.000 9.448.820 1,36				
					<b>12.892.100</b>				
					<b>1,86</b>				
					<i>China</i>				
					Bank of China Ltd. 0% 02/07/2024				
					China Construction Bank Corp. 0% 19/06/2024				
					China Construction Bank Corp. 0% 24/06/2024				
					China Construction Bank Corp. 0% 08/08/2024				
				<b>4.014.880</b>	GBP 9.000.000 8.957.947 1,30				
				<b>0,58</b>	GBP 7.500.000 7.479.171 1,08				
				<b>0,58</b>	GBP 4.000.000 3.985.978 0,58				
				<b>0,32</b>	GBP 2.200.000 2.177.626 0,32				

JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert GBP	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert GBP	% des Netto- vermö- gens
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0% 05/07/2024	GBP	6.000.000	5.970.164	0,86	Goldman Sachs International Bank 0% 16/12/2024	GBP	7.700.000	7.477.411	1,08
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0% 16/08/2024	GBP	7.500.000	7.416.447	1,07	Lloyds Bank plc 5,35% 23/05/2025	GBP	4.000.000	3.999.111	0,58
			<b>35.987.333</b>	<b>5,21</b>				<b>17.371.382</b>	<b>2,51</b>
<i>Dänemark</i>					<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>				
Danske Bank A/S 0% 14/06/2024	GBP	8.000.000	7.983.831	1,15	Bank of America NA 0% 20/11/2024	GBP	11.500.000	11.217.047	1,62
			<b>7.983.831</b>	<b>1,15</b>	Citibank NA 0% 11/11/2024	GBP	4.000.000	3.905.733	0,57
								<b>15.122.780</b>	<b>2,19</b>
<i>Finnland</i>					<b>Einlagezertifikate insgesamt</b>				
Nordea Bank Abp 0% 19/07/2024	GBP	6.000.000	5.958.405	0,86				<b>275.103.253</b>	<b>39,80</b>
Nordea Bank Abp 0% 19/08/2024	GBP	8.500.000	8.403.426	1,22	<b>Commercial Papers</b>				
Nordea Bank Abp 0% 16/04/2025	GBP	5.000.000	4.778.294	0,69	<i>Australien</i>				
			<b>19.140.125</b>	<b>2,77</b>	Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0% 02/10/2024	GBP	6.000.000	5.893.655	0,85
<i>Frankreich</i>								<b>5.893.655</b>	<b>0,85</b>
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0% 15/04/2025	GBP	6.000.000	5.728.995	0,83	<i>China</i>				
BNP Paribas SA 0% 01/08/2024	GBP	8.400.000	8.323.669	1,20	Agricultural Bank of China Ltd. 0% 07/08/2024	GBP	8.500.000	8.416.638	1,22
Credit Agricole SA 0% 02/01/2025	GBP	6.000.000	5.816.202	0,84				<b>8.416.638</b>	<b>1,22</b>
Credit Agricole SA 0% 13/03/2025	GBP	9.000.000	8.638.544	1,25	<i>Dänemark</i>				
Societe Generale SA 0% 31/07/2024	GBP	2.500.000	2.477.643	0,36	Danske Bank A/S 0% 23/05/2025	GBP	3.500.000	3.323.966	0,48
Societe Generale SA, FRN 5,848% 18/11/2024	GBP	5.000.000	5.005.987	0,73				<b>3.323.966</b>	<b>0,48</b>
			<b>35.991.040</b>	<b>5,21</b>	<i>Finnland</i>				
<i>Deutschland</i>					OP Corporate Bank plc 0% 12/02/2025	GBP	8.500.000	8.192.466	1,19
DZ Bank AG 0% 25/10/2024	GBP	5.000.000	4.894.837	0,71	OP Corporate Bank plc 0% 14/03/2025	GBP	7.000.000	6.718.163	0,97
			<b>4.894.837</b>	<b>0,71</b>				<b>14.910.629</b>	<b>2,16</b>
<i>Japan</i>					<i>Frankreich</i>				
MUFG Bank Ltd. 0% 27/06/2024	GBP	6.500.000	6.474.425	0,94	BPCE SA 0% 16/12/2024	GBP	4.000.000	3.886.845	0,56
Norinchukin Bank (The) 0% 04/06/2024	GBP	2.500.000	2.498.538	0,36	BPCE SA 0% 03/02/2025	GBP	9.000.000	8.683.048	1,26
Norinchukin Bank (The) 0% 12/08/2024	GBP	7.000.000	6.925.326	1,00	BPCE SA 0% 14/04/2025	GBP	5.500.000	5.252.993	0,76
Norinchukin Bank (The) 0% 04/09/2024	GBP	2.500.000	2.466.430	0,36	FS Societe Generale/Ossiam 0% 23/05/2025	GBP	6.000.000	5.698.337	0,82
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 24/06/2024	GBP	4.000.000	3.986.056	0,58	Natixis SA 0% 15/08/2024	GBP	1.500.000	1.483.646	0,22
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 08/07/2024	GBP	4.000.000	3.977.869	0,57				<b>25.004.869</b>	<b>3,62</b>
			<b>26.328.644</b>	<b>3,81</b>	<i>Deutschland</i>				
<i>Niederlande</i>					DZ Bank AG 0% 16/05/2025	GBP	11.500.000	10.935.831	1,58
ABN AMRO Bank NV 0% 19/07/2024	GBP	3.000.000	2.978.715	0,43				<b>10.935.831</b>	<b>1,58</b>
ABN AMRO Bank NV 0% 04/09/2024	GBP	4.000.000	3.944.476	0,57	<i>Irland</i>				
Rabobank International 0% 23/07/2024	GBP	4.500.000	4.465.762	0,65	Matchpoint Finance plc 0% 12/07/2024	GBP	4.500.000	4.472.119	0,65
			<b>11.388.953</b>	<b>1,65</b>	Matchpoint Finance plc 0% 02/08/2024	GBP	4.500.000	4.458.201	0,64
<i>Norwegen</i>					Matchpoint Finance plc 0% 12/09/2024	GBP	2.800.000	2.757.148	0,40
DNB Bank ASA 0% 31/07/2024	GBP	8.200.000	8.129.188	1,18				<b>11.687.468</b>	<b>1,69</b>
DNB Bank ASA 6,05% 20/09/2024	GBP	8.000.000	8.013.767	1,16	<i>Luxemburg</i>				
DNB Bank ASA 0% 19/12/2024	GBP	1.500.000	1.457.298	0,21	Intesa Sanpaolo Bank Luxembourg SA 0% 14/08/2024	GBP	3.400.000	3.362.756	0,48
			<b>17.600.253</b>	<b>2,55</b>				<b>3.362.756</b>	<b>0,48</b>
<i>Spanien</i>					<i>Niederlande</i>				
Banco Santander SA 0% 09/12/2024	GBP	7.500.000	7.293.545	1,05	Schlumberger Finance BV 0% 10/06/2024	GBP	8.500.000	8.487.629	1,23
			<b>7.293.545</b>	<b>1,05</b>	Toyota Motor Finance Netherlands BV 0% 02/07/2024	GBP	8.000.000	7.962.819	1,15
<i>Schweiz</i>								<b>16.450.448</b>	<b>2,38</b>
UBS AG 0% 17/04/2025	GBP	4.000.000	3.819.539	0,55	<i>Norwegen</i>				
			<b>3.819.539</b>	<b>0,55</b>	DNB Bank ASA 0% 14/04/2025	GBP	2.600.000	2.485.015	0,36
<i>Großbritannien</i>								<b>2.485.015</b>	<b>0,36</b>
Goldman Sachs International Bank 0% 17/06/2024	GBP	1.000.000	997.524	0,14					
Goldman Sachs International Bank 0% 23/09/2024	GBP	2.000.000	1.966.176	0,29					
Goldman Sachs International Bank 0% 04/11/2024	GBP	3.000.000	2.931.160	0,42					

# JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund

## Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert GBP	% des Netto- vermö- gens
<i>Schweden</i>				
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0% 14/06/2024	GBP	8.000.000	7.983.923	1,16
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0% 21/06/2024	GBP	8.000.000	7.975.908	1,15
Svenska Handelsbanken AB 0% 05/06/2024	GBP	15.000.000	14.989.138	2,17
			<b>30.948.969</b>	<b>4,48</b>
<i>Großbritannien</i>				
Barclays Bank plc 0% 18/11/2024	GBP	8.000.000	7.806.918	1,13
Lloyds Bank plc 0% 05/09/2024	GBP	5.000.000	4.930.295	0,71
LSEGA Financing plc 0% 10/07/2024	GBP	3.500.000	3.469.731	0,50
MUFG Securities EMEA plc 0% 20/05/2025	GBP	6.000.000	5.700.696	0,82
Transport for London 0% 14/06/2024	GBP	2.000.000	1.995.927	0,29
Transport for London 0% 20/11/2024	GBP	5.000.000	4.876.243	0,71
			<b>28.779.810</b>	<b>4,16</b>
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>				
Collateralized Commercial Paper III Co. LLC 0% 05/07/2024	GBP	6.000.000	5.969.547	0,86
Manhattan Asset Funding Co. LLC 0% 20/06/2024	GBP	6.000.000	5.982.561	0,87
			<b>11.952.108</b>	<b>1,73</b>
<b>Commercial Papers insgesamt</b>			<b>174.152.162</b>	<b>25,19</b>
<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>457.817.010</b>	<b>66,23</b>
<b>Wertpapierbestand insgesamt</b>			<b>600.260.374</b>	<b>86,83</b>
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>				
<i>Großbritannien</i>				
Barclays Bank plc 5,21% 03/06/2024	GBP	14.000.000	14.000.000	2,03
Citigroup Global Markets Ltd. 5,24% 03/06/2024	GBP	34.000.000	34.000.000	4,92
			<b>48.000.000</b>	<b>6,95</b>
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>				
JPMorgan Chase Bank NA 5,21% 03/06/2024	GBP	20.000.000	20.000.000	2,89
			<b>20.000.000</b>	<b>2,89</b>
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>			<b>68.000.000</b>	<b>9,84</b>
<b>Bankguthaben</b>			<b>23.451.764</b>	<b>3,39</b>
<b>Andere Aktiva/(Passiva)</b>			<b>(415.448)</b>	<b>(0,06)</b>
<b>Nettovermögen insgesamt</b>			<b>691.296.690</b>	<b>100,00</b>

Geografische Aufteilung des Wertpapierbestandes zum 31. Mai 2024	% des Netto- vermögens
Großbritannien	15,55
Frankreich	10,05
Kanada	9,82
Australien	9,80
Niederlande	7,93
Vereinigte Staaten von Amerika	7,60
China	6,43
Japan	5,28
Finnland	4,93
Schweden	4,48
Deutschland	3,49
Norwegen	3,49
Belgien	1,73
Irland	1,69
Dänemark	1,63
Luxemburg	1,17
Spanien	1,05
Schweiz	0,55
<b>Wertpapierbestand insgesamt</b>	<b>96,67</b>
Bankguthaben und andere Aktiva/(Passiva)	3,33
<b>Summe</b>	<b>100,00</b>

JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					Canadian Imperial Bank of Commerce 5,95% 19/09/2024				
					USD	153.000.000	153.125.827	0,13	
<b>Anleihen</b>					Canadian Imperial Bank of Commerce 5,95% 20/09/2024				
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					Canadian Imperial Bank of Commerce 6% 02/10/2024				
US Treasury Bill 0% 23/01/2025	USD	1.315.000.000	1.272.962.330	1,07	USD	25.000.000	25.020.476	0,02	
			<b>1.272.962.330</b>	<b>1,07</b>	USD	130.000.000	130.131.795	0,11	
<b>Anleihen insgesamt</b>					Canadian Imperial Bank of Commerce 5,3% 07/10/2024				
			<b>1.272.962.330</b>	<b>1,07</b>	USD	126.000.000	125.867.781	0,11	
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>					Canadian Imperial Bank of Commerce 6% 16/10/2024				
			<b>1.272.962.330</b>	<b>1,07</b>	USD	100.000.000	100.117.392	0,08	
<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					Canadian Imperial Bank of Commerce 6% 17/10/2024				
			<b>1.272.962.330</b>	<b>1,07</b>	USD	63.000.000	63.074.699	0,05	
<b>Anleihen</b>					Canadian Imperial Bank of Commerce 5,6% 10/12/2024				
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					Canadian Imperial Bank of Commerce 5,4% 19/03/2025				
US Treasury Bill 0% 18/06/2024	USD	854.000.000	852.161.987	0,71	USD	15.000.000	15.000.781	0,01	
US Treasury Bill 0% 01/08/2024	USD	680.000.000	674.292.250	0,57	USD	127.000.000	126.865.302	0,11	
			<b>1.526.454.237</b>	<b>1,28</b>	USD	137.500.000	137.378.559	0,12	
<b>Anleihen insgesamt</b>					Canadian Imperial Bank of Commerce 5,42% 08/04/2025				
			<b>1.526.454.237</b>	<b>1,28</b>	USD	104.000.000	104.024.430	0,09	
<b>Einlagenzertifikate</b>					Canadian Imperial Bank of Commerce 5,55% 17/04/2025				
<i>Australien</i>					Canadian Imperial Bank of Commerce 5,51% 22/05/2025				
National Australia Bank Ltd. 0% 27/08/2024	USD	226.000.000	223.063.200	0,19	USD	53.000.000	53.003.031	0,04	
National Australia Bank Ltd. 0% 09/09/2024	USD	250.000.000	246.269.592	0,21	USD	71.000.000	71.018.565	0,06	
National Australia Bank Ltd. 0% 16/09/2024	USD	250.000.000	246.010.933	0,21	USD	65.000.000	64.469.762	0,05	
National Australia Bank Ltd. 0% 04/10/2024	USD	164.000.000	160.946.838	0,13	USD	250.000.000	247.237.857	0,21	
National Australia Bank Ltd. 0% 09/10/2024	USD	147.000.000	144.154.684	0,12	USD	250.000.000	246.747.152	0,21	
National Australia Bank Ltd. 0% 12/11/2024	USD	246.000.000	240.002.195	0,20	USD	79.500.000	79.567.547	0,07	
National Australia Bank Ltd. 0% 18/02/2025	USD	125.000.000	120.200.993	0,10	USD	50.000.000	50.057.464	0,04	
National Australia Bank Ltd. 0% 28/02/2025	USD	224.000.000	215.087.141	0,18	USD	300.000.000	294.354.084	0,25	
			<b>1.595.735.576</b>	<b>1,34</b>	USD	285.000.000	279.509.560	0,23	
<i>Belgien</i>					Toronto-Dominion Bank (The) 6% 17/10/2024				
Belfius Bank SA 0% 01/07/2024	USD	200.000.000	199.180.584	0,17	USD	131.000.000	131.163.796	0,11	
KBC Bank NV 5,32% 06/06/2024	USD	400.000.000	400.000.000	0,33	USD	18.000.000	17.423.964	0,01	
KBC Bank NV 0% 18/06/2024	USD	200.000.000	199.522.938	0,17	USD	85.000.000	81.891.578	0,07	
KBC Bank NV 0% 08/07/2024	USD	400.000.000	397.842.664	0,33	USD	35.000.000	34.996.281	0,03	
KBC Bank NV 0% 08/08/2024	USD	400.000.000	395.981.180	0,33	USD	55.000.000	52.793.930	0,04	
KBC Bank NV 5,44% 12/08/2024	USD	260.000.000	260.006.053	0,22	USD	55.000.000	52.793.930	0,04	
KBC Bank NV 0% 28/08/2024	USD	300.000.000	295.998.417	0,25	USD	15.000.000	14.980.095	0,01	
KBC BANK NV 0% 17/06/2024	USD	350.000.000	349.217.319	0,29	USD	76.000.000	76.002.772	0,06	
KBC Bank SA 0% 01/08/2024	USD	200.000.000	198.207.026	0,17	USD	13.000.000	13.003.038	0,01	
KBC Bank SA 0% 30/08/2024	USD	500.000.000	493.180.940	0,41	USD	60.000.000	60.004.458	0,05	
			<b>3.189.137.121</b>	<b>2,67</b>	USD	105.000.000	105.042.344	0,09	
<i>Kanada</i>					Toronto-Dominion Bank (The) 5,4% 28/03/2025				
Bank of Montreal 0% 17/06/2024	USD	135.000.000	134.696.929	0,11	USD	15.000.000	14.980.095	0,01	
Bank of Montreal 5,37% 11/07/2024	USD	87.000.000	86.991.874	0,07	USD	76.000.000	76.002.772	0,06	
Bank of Montreal 5,44% 26/08/2024	USD	115.000.000	115.002.571	0,10	USD	13.000.000	13.003.038	0,01	
Bank of Montreal 5,54% 03/09/2024	USD	7.000.000	7.000.153	0,01	USD	13.000.000	13.003.038	0,01	
Bank of Montreal 5,99% 11/09/2024	USD	165.000.000	165.170.772	0,14	USD	13.000.000	13.003.038	0,01	
Bank of Montreal 0% 07/10/2024	USD	55.000.000	53.943.968	0,05	USD	60.000.000	60.004.458	0,05	
Bank of Montreal 5,5% 04/12/2024	USD	47.000.000	46.978.924	0,04	USD	60.000.000	60.004.458	0,05	
Bank of Montreal 0% 14/02/2025	USD	128.000.000	123.096.008	0,10	USD	105.000.000	105.042.344	0,09	
Bank of Montreal 0% 04/04/2025	USD	79.000.000	75.425.022	0,06	USD	105.000.000	105.042.344	0,09	
Bank of Montreal, FRN 5,97% 05/07/2024	USD	100.000.000	100.045.557	0,08	USD	105.000.000	105.042.344	0,09	
Bank of Montreal, FRN 5,61% 21/01/2025	USD	223.000.000	223.072.132	0,19	USD	105.000.000	105.042.344	0,09	
Bank of Nova Scotia (The) 5,6% 11/09/2024	USD	117.000.000	117.002.845	0,10	USD	105.000.000	105.042.344	0,09	
Bank of Nova Scotia (The) 5,4% 02/04/2025	USD	80.000.000	79.901.060	0,07	USD	105.000.000	105.042.344	0,09	
Bank of Nova Scotia (The), FRN 5,99% 03/06/2024	USD	72.000.000	72.001.053	0,06	USD	105.000.000	105.042.344	0,09	
Bank of Nova Scotia (The), FRN 5,88% 08/11/2024	USD	98.000.000	98.153.118	0,08	USD	105.000.000	105.042.344	0,09	
					USD	185.000.000	185.031.148	0,15	
					USD	70.000.000	70.022.603	0,06	
							<b>4.452.356.306</b>	<b>3,73</b>	
<i>China</i>					Toronto-Dominion Bank (The) 5,55% 17/04/2025				
					USD	435.000.000	435.000.000	0,37	
					USD	250.000.000	250.000.000	0,21	
					USD	444.000.000	444.000.000	0,37	
					USD	50.000.000	49.565.019	0,04	
							<b>1.178.565.019</b>	<b>0,99</b>	
<i>Curaçao</i>					Toronto-Dominion Bank (The) 5,53% 28/05/2025				
					USD	185.000.000	185.031.148	0,15	
					USD	70.000.000	70.022.603	0,06	
							<b>255.053.751</b>	<b>0,21</b>	
<i>Finnland</i>					Toronto-Dominion Bank (The), FRN 5,98% 28/06/2024				
					USD	70.000.000	69.999.796	0,06	
					USD	138.000.000	138.004.526	0,12	

JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Wahrung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermo- gens	Anlagen	Wahrung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermo- gens
Nordea Bank Abp, FRN 5,5% 15/10/2024	USD	100.000.000	100.002.728	0,08	Natixis SA 5,51% 07/02/2025	USD	65.000.000	64.997.377	0,05
OP Corporate Bank plc 0% 18/02/2025	USD	130.000.000	124.999.051	0,10	Societe Generale SA 5,32% 06/06/2024	USD	500.000.000	500.000.000	0,42
			<b>433.006.101</b>	<b>0,36</b>				<b>7.583.634.989</b>	<b>6,36</b>
<i>Frankreich</i>					<i>Japan</i>				
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0% 02/07/2024	USD	300.000.000	298.675.155	0,25	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 11/07/2024	USD	100.000.000	99.409.872	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0% 01/11/2024	USD	225.000.000	219.887.980	0,18	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 18/07/2024	USD	100.000.000	99.303.951	0,08
BNP Paribas SA 5,78% 07/06/2024	USD	145.000.000	145.005.738	0,12	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 24/07/2024	USD	150.000.000	148.852.699	0,13
BNP Paribas SA 5,91% 20/06/2024	USD	153.000.000	153.027.581	0,13	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp. 0% 29/07/2024	USD	50.000.000	49.568.752	0,04
BNP Paribas SA 5,51% 24/02/2025	USD	180.000.000	179.993.106	0,15	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,55% 10/06/2024	USD	180.000.000	180.004.601	0,15
BNP Paribas SA, FRN 5,52% 17/07/2024	USD	182.000.000	182.017.241	0,15	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,63% 13/06/2024	USD	93.000.000	93.005.233	0,08
BNP Paribas SA, FRN 5,58% 12/11/2024	USD	163.000.000	163.043.399	0,14	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,63% 17/06/2024	USD	100.000.000	100.008.123	0,08
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,78% 07/06/2024	USD	114.000.000	114.004.871	0,10	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,61% 02/07/2024	USD	140.000.000	140.011.372	0,12
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,39% 11/09/2024	USD	113.000.000	112.971.348	0,09	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,51% 09/08/2024	USD	220.000.000	220.032.318	0,19
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,45% 30/09/2024	USD	160.000.000	159.988.765	0,13	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,51% 16/08/2024	USD	233.000.000	233.037.662	0,20
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,31% 04/10/2024	USD	139.000.000	138.887.092	0,12	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,51% 12/09/2024	USD	230.000.000	230.041.352	0,19
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,55% 01/11/2024	USD	88.000.000	88.022.832	0,07	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,58% 03/10/2024	USD	150.000.000	150.054.531	0,13
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,51% 07/11/2024	USD	150.000.000	150.015.133	0,13	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,58% 31/10/2024	USD	165.000.000	165.035.780	0,14
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,34% 15/11/2024	USD	72.000.000	71.928.564	0,06	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,58% 05/11/2024	USD	200.000.000	200.043.846	0,17
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,41% 16/12/2024	USD	130.000.000	129.901.907	0,11	Mizuho Bank Ltd. 0% 06/06/2024	USD	500.000.000	499.767.770	0,42
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,58% 25/04/2025	USD	111.000.000	111.028.817	0,09	Mizuho Bank Ltd. 0% 20/06/2024	USD	180.000.000	179.513.303	0,15
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,58% 30/04/2025	USD	56.000.000	56.014.658	0,05	Mizuho Bank Ltd. 0% 18/07/2024	USD	200.000.000	198.615.408	0,17
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,5% 23/05/2025	USD	190.000.000	189.972.965	0,16	Mizuho Bank Ltd. 0% 23/07/2024	USD	200.000.000	198.466.380	0,17
Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN 5,44% 10/06/2024	USD	118.000.000	118.001.336	0,10	Mizuho Bank Ltd. 0% 27/08/2024	USD	250.000.000	246.684.270	0,21
Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN 5,53% 31/07/2024	USD	180.000.000	180.034.113	0,15	Mizuho Bank Ltd. 5,4% 06/09/2024	USD	200.000.000	199.939.880	0,17
Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN 5,58% 05/11/2024	USD	250.000.000	250.101.342	0,21	Mizuho Bank Ltd. 0% 29/11/2024	USD	350.000.000	340.517.604	0,29
Credit Agricole SA 0% 01/10/2024	USD	141.000.000	138.443.633	0,12	Mizuho Bank Ltd., FRN 5,45% 21/06/2024	USD	115.000.000	115.000.449	0,10
Credit Agricole SA 0% 03/02/2025	USD	80.000.000	77.103.766	0,06	Mizuho Bank Ltd., FRN 5,56% 17/07/2024	USD	229.000.000	229.033.478	0,19
Credit Agricole SA 0% 18/02/2025	USD	115.000.000	110.590.610	0,09	Mizuho Bank Ltd., FRN 5,51% 13/08/2024	USD	230.000.000	230.023.407	0,19
Credit Industriel et Commercial 5,8% 13/06/2024	USD	91.000.000	91.006.852	0,08	Mizuho Bank Ltd., FRN 5,58% 01/11/2024	USD	194.000.000	194.046.533	0,16
Credit Industriel et Commercial 5,54% 06/09/2024	USD	77.000.000	76.994.575	0,06	Mizuho Bank Ltd., FRN 5,58% 05/11/2024	USD	225.000.000	225.052.416	0,19
Credit Industriel et Commercial 0% 07/10/2024	USD	205.000.000	201.104.662	0,17	Mizuho Bank Ltd., FRN 5,58% 06/11/2024	USD	300.000.000	300.068.949	0,25
Credit Industriel et Commercial 0% 08/10/2024	USD	279.000.000	273.657.100	0,23	Mizuho Bank Ltd., FRN 5,58% 08/11/2024	USD	250.000.000	250.056.318	0,21
Credit Industriel et Commercial 0% 21/10/2024	USD	300.000.000	293.675.196	0,25	MUFG Bank Ltd. 0% 03/06/2024	USD	100.000.000	99.984.887	0,08
Credit Industriel et Commercial 0% 24/10/2024	USD	313.000.000	306.261.410	0,26	MUFG Bank Ltd. 5,43% 15/07/2024	USD	180.000.000	179.978.820	0,15
Credit Industriel et Commercial 0% 01/11/2024	USD	100.000.000	97.727.991	0,08	MUFG Bank Ltd., FRN 5,68% 03/06/2024	USD	141.000.000	141.000.904	0,12
Credit Industriel et Commercial 0% 06/11/2024	USD	133.000.000	129.879.150	0,11	MUFG Bank Ltd., FRN 5,54% 19/07/2024	USD	228.000.000	228.017.522	0,19
Credit Industriel et Commercial 0% 03/03/2025	USD	143.000.000	137.174.782	0,12	MUFG Bank Ltd., FRN 5,51% 23/08/2024	USD	95.000.000	95.003.788	0,08
Credit Industriel et Commercial 5,5% 03/03/2025	USD	72.000.000	72.007.172	0,06	MUFG Bank Ltd., FRN 5,57% 25/10/2024	USD	180.000.000	180.020.394	0,15
Credit Industriel et Commercial, FRN 5,55% 10/10/2024	USD	218.000.000	218.055.679	0,18	Norinchukin Bank (The) 5,37% 03/06/2024	USD	200.000.000	200.000.000	0,17
Natixis SA 5,9% 05/06/2024	USD	105.000.000	105.002.761	0,09	Norinchukin Bank (The) 0% 06/08/2024	USD	100.000.000	99.037.700	0,08
Natixis SA 5,94% 14/06/2024	USD	169.500.000	169.519.577	0,14	Norinchukin Bank (The) 0% 26/08/2024	USD	200.000.000	197.425.976	0,17
Natixis SA 5,81% 08/07/2024	USD	133.000.000	133.037.562	0,11	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 28/06/2024	USD	100.000.000	99.603.747	0,08
Natixis SA 5,89% 12/07/2024	USD	100.000.000	100.035.660	0,08	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 09/07/2024	USD	100.000.000	99.440.579	0,08
Natixis SA 5,76% 09/08/2024	USD	237.000.000	237.089.425	0,20	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 10/07/2024	USD	100.000.000	99.425.003	0,08
Natixis SA 5,62% 03/09/2024	USD	55.000.000	55.008.417	0,05	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 30/08/2024	USD	300.000.000	295.871.604	0,25
Natixis SA 5,62% 04/09/2024	USD	200.000.000	200.029.846	0,17	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 05/09/2024	USD	100.000.000	98.531.674	0,08
Natixis SA 5,4% 19/09/2024	USD	228.000.000	227.878.401	0,19	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 30/09/2024	USD	25.000.000	24.542.772	0,02
Natixis SA 5,43% 27/12/2024	USD	140.000.000	139.911.013	0,12	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 29/11/2024	USD	100.000.000	97.333.288	0,08
Natixis SA 5,47% 08/01/2025	USD	215.000.000	214.918.429	0,18					



JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 29/11/2024	USD	100.000.000	97.333.288	0,08	ING Bank NV 0% 21/10/2024	USD	200.000.000	195.726.968	0,16
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 29/11/2024	USD	125.000.000	121.666.610	0,10	ING Bank NV 5,25% 21/10/2024	USD	19.000.000	18.973.952	0,02
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,68% 03/06/2024	USD	51.000.000	51.000.315	0,04				<b>2.970.402.215</b>	<b>2,49</b>
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,64% 07/06/2024	USD	93.500.000	93.502.350	0,08	<i>Norwegen</i>				
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,68% 07/06/2024	USD	150.000.000	150.004.572	0,13	DNB Bank ASA 0% 30/09/2024	USD	250.000.000	245.487.665	0,21
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,63% 12/06/2024	USD	93.000.000	93.004.171	0,08				<b>245.487.665</b>	<b>0,21</b>
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,54% 17/07/2024	USD	200.000.000	200.017.838	0,17	<i>Singapur</i>				
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,54% 19/07/2024	USD	39.000.000	39.003.620	0,03	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN 5,61% 10/06/2024	USD	93.000.000	93.003.344	0,08
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,54% 22/07/2024	USD	150.000.000	150.014.748	0,13				<b>93.003.344</b>	<b>0,08</b>
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,5% 05/08/2024	USD	88.000.000	88.004.864	0,07	<i>Südkorea</i>				
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,5% 06/08/2024	USD	141.000.000	141.007.914	0,12	Keb Hana Bank 0% 12/08/2024	USD	30.000.000	29.679.977	0,03
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,51% 15/08/2024	USD	231.000.000	231.019.448	0,19	Keb Hana Bank 0% 15/10/2024	USD	30.000.000	29.384.292	0,02
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,51% 23/08/2024	USD	136.000.000	136.010.856	0,11	Kookmin Bank, FRN 5,68% 23/07/2024	USD	100.000.000	100.027.014	0,08
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,58% 29/10/2024	USD	10.000.000	10.001.170	0,01	Korea Development Bank (The) 0% 14/08/2024	USD	75.000.000	74.177.404	0,06
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,58% 30/10/2024	USD	350.000.000	350.039.515	0,29	Korea Development Bank (The), FRN 5,67% 11/06/2024	USD	47.000.000	47.002.887	0,04
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,57% 31/10/2024	USD	100.000.000	100.006.651	0,08	Korea Development Bank (The), FRN 5,57% 21/10/2024	USD	50.000.000	50.008.953	0,04
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,58% 05/11/2024	USD	100.000.000	100.007.982	0,08	Woori Bank, 144A 5,5% 01/08/2024	USD	150.000.000	150.011.475	0,13
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,58% 07/11/2024	USD	113.000.000	113.007.702	0,10				<b>480.292.002</b>	<b>0,40</b>
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN 5,63% 18/06/2024	USD	93.000.000	93.007.239	0,08	<i>Schweden</i>				
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN 5,45% 24/06/2024	USD	228.000.000	227.999.574	0,19	Skandinaviska Enskilda Banken AB 5,51% 31/10/2024	USD	125.000.000	125.007.136	0,11
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN 5,6% 10/07/2024	USD	184.000.000	184.026.185	0,15	Skandinaviska Enskilda Banken AB 5,5% 28/05/2025	USD	157.000.000	156.952.752	0,13
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN 5,54% 24/07/2024	USD	228.000.000	228.024.936	0,19	Skandinaviska Enskilda Banken AB 5,52% 30/05/2025	USD	20.000.000	20.000.000	0,02
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN 5,48% 31/07/2024	USD	68.000.000	68.001.543	0,06	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN 5,98% 05/06/2024	USD	95.000.000	95.004.317	0,08
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN 5,51% 02/08/2024	USD	135.000.000	135.010.303	0,11	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN 5,5% 26/07/2024	USD	65.000.000	65.006.616	0,05
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN 5,5% 07/08/2024	USD	141.000.000	141.009.228	0,12	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN 5,48% 08/08/2024	USD	70.000.000	70.004.751	0,06
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN 5,51% 13/09/2024	USD	200.000.000	200.016.212	0,17	Svenska Handelsbanken AB 5,565% 02/07/2024	USD	70.000.000	70.006.520	0,06
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., FRN 5,57% 22/10/2024	USD	200.000.000	200.049.512	0,17	Svenska Handelsbanken AB 5,9% 12/07/2024	USD	115.000.000	115.048.507	0,10
			<b>11.695.241.950</b>	<b>9,81</b>	Svenska Handelsbanken AB 5,905% 16/07/2024	USD	3.000.000	3.001.395	0,00
<i>Luxemburg</i>					Svenska Handelsbanken AB 5,52% 28/05/2025	USD	60.000.000	60.004.268	0,05
ING Bank NV 0% 27/12/2024	USD	375.000.000	363.322.219	0,31	Svenska Handelsbanken AB, FRN 5,97% 08/07/2024	USD	180.000.000	180.097.832	0,15
			<b>363.322.219</b>	<b>0,31</b>	Svenska Handelsbanken AB, FRN 5,51% 24/07/2024	USD	134.000.000	134.017.037	0,11
								<b>1.094.151.131</b>	<b>0,92</b>
<i>Niederlande</i>					<i>Schweiz</i>				
ABN AMRO Bank NV 0% 12/06/2024	USD	296.000.000	295.574.692	0,25	UBS AG 0% 07/06/2024	USD	450.000.000	449.663.976	0,38
ABN AMRO Bank NV 0% 14/06/2024	USD	350.000.000	349.363.721	0,29	UBS AG 0% 01/10/2024	USD	200.000.000	196.331.598	0,16
ABN AMRO Bank NV 0% 27/08/2024	USD	227.000.000	223.999.764	0,19				<b>645.995.574</b>	<b>0,54</b>
ABN AMRO Bank NV 0% 13/09/2024	USD	350.000.000	344.482.467	0,29	<i>Großbritannien</i>				
ABN AMRO Bank NV 0% 29/11/2024	USD	350.000.000	340.530.221	0,29	Barclays Bank plc, FRN 5,65% 20/06/2024	USD	118.000.000	118.012.925	0,10
Cooperatieve Rabobank UA 0% 05/06/2024	USD	100.000.000	99.955.671	0,08	Cooperatieve Rabobank UA 0% 18/09/2024	USD	109.000.000	107.218.876	0,09
Cooperatieve Rabobank UA 0% 14/08/2024	USD	132.500.000	131.057.598	0,11	Goldman Sachs International Bank 0% 10/06/2024	USD	300.000.000	299.646.588	0,25
Cooperatieve Rabobank UA 0% 09/09/2024	USD	250.000.000	246.249.175	0,21	Goldman Sachs International Bank 0% 20/08/2024	USD	300.000.000	296.330.247	0,25
Cooperatieve Rabobank UA 0% 13/09/2024	USD	131.000.000	128.956.708	0,11	Goldman Sachs International Bank 0% 16/09/2024	USD	150.000.000	147.556.379	0,12
Cooperatieve Rabobank UA 5,7% 17/10/2024	USD	100.000.000	100.100.087	0,08	Goldman Sachs International Bank 0% 03/10/2024	USD	100.000.000	98.116.147	0,08
Cooperatieve Rabobank UA 0% 08/11/2024	USD	223.000.000	217.666.295	0,18	SMBC Bank International plc 0% 24/07/2024	USD	300.000.000	297.709.530	0,25
Cooperatieve Rabobank UA 5,8% 12/11/2024	USD	110.000.000	110.171.049	0,09	Standard Chartered Bank 5,42% 05/07/2024	USD	246.000.000	245.978.283	0,21
Cooperatieve Rabobank UA 0% 11/12/2024	USD	49.000.000	47.589.816	0,04	Standard Chartered Bank 5,4% 06/09/2024	USD	170.000.000	169.932.894	0,14
Cooperatieve Rabobank UA, FRN 6,041% 04/06/2024	USD	120.000.000	120.004.031	0,10					

JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Standard Chartered Bank 5,42% 13/09/2024	USD	100.000.000	99.965.516	0,08	National Australia Bank Ltd., FRN, 144A 5,51% 31/07/2024	USD	55.000.000	55.007.480	0,05
Standard Chartered Bank 5,45% 10/10/2024	USD	115.000.000	114.975.941	0,10	National Australia Bank Ltd., FRN, 144A 5,49% 09/09/2024	USD	190.000.000	190.033.396	0,16
Standard Chartered Bank 5,5% 02/12/2024	USD	200.000.000	199.981.932	0,17	Toyota Finance Australia Ltd. 0% 24/07/2024	USD	80.000.000	79.380.550	0,07
Standard Chartered Bank, FRN 5,56% 02/08/2024	USD	46.000.000	46.009.863	0,04	Toyota Finance Australia Ltd. 0% 12/08/2024	USD	50.000.000	49.471.380	0,04
Standard Chartered Bank, FRN 5,57% 09/08/2024	USD	182.000.000	182.046.945	0,15	Toyota Finance Australia Ltd. 0% 09/09/2024	USD	80.000.000	78.797.202	0,07
Standard Chartered Bank, FRN 5,57% 11/10/2024	USD	75.000.000	75.021.850	0,06	Toyota Finance Australia Ltd. 0% 21/11/2024	USD	90.000.000	87.656.742	0,07
Standard Chartered Bank, FRN 5,58% 01/11/2024	USD	138.000.000	138.038.506	0,12	Treasury Corp. of Victoria 0% 04/11/2024	USD	150.000.000	146.615.514	0,12
Standard Chartered Bank, FRN 5,56% 15/11/2024	USD	200.000.000	199.997.984	0,17	Westpac Banking Corp., 144A 0% 06/09/2024	USD	40.000.000	39.418.301	0,03
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 01/07/2024	USD	230.000.000	229.020.678	0,19				<b>2.751.971.896</b>	<b>2,31</b>
			<b>3.065.561.084</b>	<b>2,57</b>					
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					<i>Österreich</i>				
Bank of America NA, FRN 5,52% 02/08/2024	USD	221.000.000	221.021.567	0,19	Oesterreichische Kontrollbank 0% 29/07/2024	USD	285.000.000	282.675.751	0,24
Bank of America NA, FRN 5,5% 16/08/2024	USD	232.000.000	232.018.201	0,20	Oesterreichische Kontrollbank AG 0% 07/06/2024	USD	220.000.000	219.859.614	0,18
Norinchukin Bank (The) 5,32% 06/06/2024	USD	500.000.000	500.000.000	0,42	Oesterreichische Kontrollbank AG 0% 13/06/2024	USD	150.000.000	149.789.422	0,12
Norinchukin Bank (The) 5,45% 22/08/2024	USD	145.000.000	144.998.099	0,12	Republik Österreich 0% 26/06/2024	USD	200.000.000	199.314.248	0,17
Norinchukin Bank (The), FRN 5,48% 09/07/2024	USD	110.000.000	110.002.341	0,09				<b>851.639.035</b>	<b>0,71</b>
Norinchukin Bank (The), FRN 5,48% 02/08/2024	USD	100.000.000	100.002.288	0,08	<i>Kanada</i>				
Wells Fargo Bank NA, FRN 5,85% 04/06/2024	USD	170.000.000	170.003.993	0,14	Bank of Montreal 0% 11/06/2024	USD	100.000.000	99.868.560	0,08
Wells Fargo Bank NA, FRN 5,85% 05/06/2024	USD	200.000.000	200.007.036	0,17	Bank of Montreal 0% 03/09/2024	USD	172.000.000	169.564.129	0,14
Wells Fargo Bank NA, FRN 5,83% 25/06/2024	USD	83.000.000	83.021.638	0,07	Bank of Montreal 0% 07/11/2024	USD	216.000.000	210.896.000	0,18
Wells Fargo Bank NA, FRN 5,98% 28/06/2024	USD	208.000.000	208.084.662	0,17	Bank of Montreal 0% 14/11/2024	USD	112.000.000	109.242.545	0,09
Wells Fargo Bank NA, FRN 5,93% 02/08/2024	USD	84.000.000	84.073.221	0,07	Bank of Montreal 0% 18/03/2025	USD	57.000.000	54.581.615	0,05
Wells Fargo Bank NA, FRN 5,93% 02/08/2024	USD	85.000.000	85.073.949	0,07	Bank of Montreal 0% 03/04/2025	USD	26.000.000	24.838.116	0,02
Wells Fargo Bank NA, FRN 5,93% 31/10/2024	USD	208.000.000	208.356.246	0,18	Bank of Montreal 0% 08/04/2025	USD	78.000.000	74.459.383	0,06
			<b>2.346.663.241</b>	<b>1,97</b>	Bank of Montreal 0% 30/04/2025	USD	62.000.000	58.993.921	0,05
<b>Einlagenzertifikate insgesamt</b>			<b>41.687.609.288</b>	<b>34,96</b>	Bank of Montreal, FRN 5,93% 01/08/2024	USD	90.000.000	90.067.475	0,08
<b>Commercial Papers</b>					Bank of Nova Scotia (The), 144A 0% 28/06/2024	USD	100.000.000	99.609.077	0,08
<i>Australien</i>					Bank of Nova Scotia (The), FRN, 144A 5,5% 09/09/2024	USD	290.000.000	290.042.961	0,24
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 144A 0% 25/07/2024	USD	110.000.000	109.143.311	0,09	Canadian Imperial Bank of Commerce, 144A 0% 19/09/2024	USD	25.000.000	24.587.697	0,02
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 144A 0% 08/10/2024	USD	287.800.000	282.253.720	0,24	Canadian Imperial Bank of Commerce, 144A 0% 10/12/2024	USD	78.000.000	75.792.526	0,06
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 144A 0% 26/11/2024	USD	184.000.000	179.114.798	0,15	Canadian Imperial Bank of Commerce, 144A 0% 22/05/2025	USD	72.000.000	68.293.430	0,06
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 144A 0% 14/01/2025	USD	101.000.000	97.642.646	0,08	Canadian Imperial Bank of Commerce 0% 03/06/2024	USD	265.000.000	264.960.912	0,22
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 144A 5,53% 08/10/2024	USD	126.000.000	126.023.848	0,11	Federation des caisses Desjardins du Quebec (The) 0% 06/06/2024	USD	200.000.000	199.894.596	0,17
Export Finance & Insurance Corp. 0% 03/06/2024	USD	15.500.000	15.497.685	0,01	Federation des caisses Desjardins du Quebec (The) 0% 10/06/2024	USD	200.000.000	199.776.418	0,17
Export Finance & Insurance Corp. 0% 03/06/2024	USD	50.000.000	49.992.531	0,04	Federation des caisses Desjardins du Quebec (The) 0% 13/06/2024	USD	100.000.000	99.855.070	0,08
Export Finance & Insurance Corp. 0% 05/06/2024	USD	80.000.000	79.965.650	0,07	National Bank of Canada, 144A 0% 25/07/2024	USD	110.000.000	109.127.660	0,09
Export Finance & Insurance Corp. 0% 05/08/2024	USD	65.000.000	64.379.015	0,05	National Bank of Canada, 144A 0% 29/07/2024	USD	229.000.000	227.046.886	0,19
Export Finance & Insurance Corp. 0% 16/09/2024	USD	75.500.000	74.283.197	0,06	National Bank of Canada, 144A 0% 09/09/2024	USD	90.000.000	88.634.901	0,08
Macquarie Bank Ltd., FRN, 144A 5,49% 08/08/2024	USD	83.000.000	83.005.617	0,07	Province of Quebec Canada 0% 02/07/2024	USD	300.000.000	298.709.445	0,25
Macquarie Bank Ltd., FRN, 144A 5,5% 13/08/2024	USD	81.000.000	81.007.494	0,07	Province of Quebec Canada 0% 24/07/2024	USD	300.000.000	297.767.193	0,25
Macquarie Bank Ltd., FRN, 144A 5,53% 20/09/2024	USD	40.000.000	40.002.242	0,03	Royal Bank of Canada, 144A 0% 05/06/2024	USD	218.000.000	217.904.939	0,18
Macquarie Bank Ltd., FRN, 144A 5,58% 17/10/2024	USD	275.000.000	275.058.449	0,23	Royal Bank of Canada, 144A 0% 18/09/2024	USD	160.500.000	157.863.519	0,13
Macquarie Bank Ltd. 0% 12/08/2024	USD	200.000.000	197.886.294	0,17	Royal Bank of Canada, 144A 0% 11/10/2024	USD	116.000.000	113.695.571	0,10
Macquarie Bank Ltd. 0% 11/09/2024	USD	25.000.000	24.616.644	0,02	Royal Bank of Canada, 144A 0% 05/11/2024	USD	210.000.000	205.076.458	0,17
Macquarie Bank Ltd. 0% 23/09/2024	USD	250.000.000	245.718.190	0,21	Royal Bank of Canada, FRN, 144A 5,64% 07/06/2024	USD	205.000.000	205.005.068	0,17
					Royal Bank of Canada, FRN, 144A 5,98% 28/06/2024	USD	83.000.000	83.031.604	0,07
					Royal Bank of Canada, FRN, 144A 5,97% 08/07/2024	USD	55.000.000	55.024.839	0,05
					Royal Bank of Canada, FRN, 144A 5,6% 22/01/2025	USD	125.000.000	125.032.685	0,11
					Toronto-Dominion Bank (The), 144A 0% 06/09/2024	USD	50.000.000	49.270.499	0,04



JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Toronto-Dominion Bank (The), 144A 0% 09/09/2024	USD	85.000.000	83.722.457	0,07	Natixis SA 0% 03/02/2025	USD	60.000.000	57.816.167	0,05
Toronto-Dominion Bank (The), 144A 0% 03/02/2025	USD	185.000.000	178.263.116	0,15	Societe Generale SA, 144A 0% 31/07/2024	USD	195.800.000	194.076.803	0,16
Toronto-Dominion Bank (The), 144A 0% 17/04/2025	USD	80.000.000	76.256.641	0,07	Societe Generale SA, 144A 0% 01/08/2024	USD	125.000.000	123.879.162	0,10
Toronto-Dominion Bank (The), 144A 0% 22/04/2025	USD	38.000.000	36.195.298	0,03	TotalEnergies Capital SA, 144A 0% 04/06/2024	USD	150.000.000	149.955.668	0,13
Toronto-Dominion Bank (The), 144A 0% 28/05/2025	USD	55.000.000	52.112.513	0,04				<b>7.963.818.351</b>	<b>6,68</b>
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 01/08/2024	USD	137.000.000	135.773.760	0,11	<i>Deutschland</i>				
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 17/01/2025	USD	250.000.000	241.462.877	0,20	DekaBank Deutsche Girozentrale 0% 17/06/2024	USD	178.000.000	177.606.937	0,15
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 30/05/2025	USD	200.000.000	189.427.632	0,16	DekaBank Deutsche Girozentrale 0% 27/06/2024	USD	200.000.000	199.262.476	0,17
			<b>5.441.729.992</b>	<b>4,56</b>	DekaBank Deutsche Girozentrale 0% 09/07/2024	USD	500.000.000	497.322.775	0,42
<i>Kaimaninseln</i>					DekaBank Deutsche Girozentrale 0% 10/07/2024	USD	300.000.000	298.314.225	0,25
Chesham Finance Ltd., 144A 0% 05/06/2024	USD	215.000.000	214.903.074	0,18	DZ Bank AG, 144A 0% 03/06/2024	USD	630.000.000	629.907.075	0,53
			<b>214.903.074</b>	<b>0,18</b>	DZ Bank AG, FRN, 144A 5,49% 26/08/2024	USD	212.000.000	212.020.161	0,18
<i>Finnland</i>					Erste Abwicklungsanstalt 0% 03/06/2024	USD	200.000.000	199.970.622	0,17
Finvera Oyj 0% 12/06/2024	USD	150.000.000	149.786.094	0,13	Erste Abwicklungsanstalt 0% 08/07/2024	USD	250.000.000	248.709.445	0,21
Kuntarahoitus Oyj 0% 05/06/2024	USD	100.000.000	99.957.021	0,08	Erste Abwicklungsanstalt 0% 15/07/2024	USD	250.000.000	248.455.065	0,21
Kuntarahoitus Oyj 0% 10/06/2024	USD	150.000.000	149.832.366	0,13	Landeskreditbank				
Kuntarahoitus Oyj 0% 12/06/2024	USD	182.000.000	181.740.461	0,15	Baden-wuerttemberg Foerderbank 0% 01/07/2024	USD	300.000.000	298.713.159	0,25
Municipality Finance plc 0% 03/06/2024	USD	50.000.000	49.993.213	0,04	Landeskreditbank				
Municipality Finance plc 0% 07/06/2024	USD	150.000.000	149.902.677	0,13	Baden-wuerttemberg Foerderbank 0% 01/07/2024	USD	300.000.000	298.713.159	0,25
Nordea Bank Abp, FRN, 144A 5,44% 12/06/2024	USD	125.000.000	124.999.894	0,10	Landeskreditbank				
OP Corporate Bank plc 0% 14/02/2025	USD	125.000.000	120.262.534	0,10	Baden-wuerttemberg Foerderbank 0% 02/07/2024	USD	400.000.000	398.228.336	0,33
OP Corporate Bank plc 0% 18/02/2025	USD	50.000.000	48.076.558	0,04	Landeskreditbank				
			<b>1.074.550.818</b>	<b>0,90</b>	Baden-wuerttemberg Foerderbank 0% 10/07/2024	USD	700.000.000	696.230.787	0,58
<i>Frankreich</i>					Landeskreditbank				
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 05/06/2024	USD	250.000.000	249.892.552	0,21	Baden-wuerttemberg Foerderbank 0% 02/07/2024	USD	300.000.000	298.824.915	0,25
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 05/06/2024	USD	300.000.000	299.871.063	0,25	Landwirtschaftliche Rentenbank 0% 29/07/2024	USD	650.000.000	644.932.672	0,54
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 05/06/2024	USD	500.000.000	499.807.845	0,42	Landwirtschaftliche Rentenbank 0% 31/07/2024	USD	600.000.000	594.914.544	0,50
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 10/06/2024	USD	200.000.000	199.771.000	0,17	NRW Bank, 144A 0% 12/06/2024	USD	220.000.000	219.691.685	0,18
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 10/06/2024	USD	350.000.000	349.600.146	0,29	NRW Bank 0% 06/06/2024	USD	500.000.000	499.707.150	0,42
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 11/06/2024	USD	500.000.000	499.355.670	0,42	NRW Bank 0% 10/07/2024	USD	700.000.000	696.086.741	0,58
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 14/06/2024	USD	600.000.000	599.051.748	0,50				<b>8.252.734.847</b>	<b>6,92</b>
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 17/06/2024	USD	500.000.000	498.953.265	0,42	<i>Japan</i>				
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 18/06/2024	USD	583.000.000	581.708.772	0,49	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0% 28/08/2024	USD	155.000.000	152.937.175	0,13
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 01/07/2024	USD	300.000.000	298.800.057	0,25				<b>152.937.175</b>	<b>0,13</b>
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 02/07/2024	USD	300.000.000	298.691.985	0,25	<i>Luxemburg</i>				
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0% 02/07/2024	USD	300.000.000	298.823.295	0,25	Barton Capital SA, 144A 0% 04/06/2024	USD	45.000.000	44.986.765	0,04
Antalis SA, 144A 0% 13/06/2024	USD	111.750.000	111.572.749	0,09	Barton Capital SA, FRN, 144A 5,58% 08/10/2024	USD	50.000.000	50.003.341	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0% 12/11/2024	USD	42.000.000	40.976.901	0,03	Barton Capital SA, FRN, 144A 5,58% 15/10/2024	USD	50.000.000	50.002.152	0,04
BNP Paribas SA 0% 07/06/2024	USD	118.000.000	117.915.539	0,10	DZ Privatbank SA 0% 03/06/2024	USD	100.000.000	99.985.361	0,08
BNP Paribas SA 0% 02/10/2024	USD	210.000.000	206.151.143	0,17	DZ Privatbank SA 0% 07/06/2024	USD	250.000.000	249.830.285	0,21
BPCE SA, 144A 0% 07/06/2024	USD	110.000.000	109.921.007	0,09	DZ Privatbank SA 0% 01/07/2024	USD	200.000.000	199.184.260	0,17
BPCE SA 0% 22/10/2024	USD	250.000.000	244.623.565	0,21				<b>693.992.164</b>	<b>0,58</b>
Caisse des Depots et Consignations 0% 12/06/2024	USD	500.000.000	499.284.375	0,42	<i>Niederlande</i>				
Caisse des Depots et Consignations 0% 31/07/2024	USD	500.000.000	495.754.320	0,42	Cooperatieve Rabobank UA 0% 03/06/2024	USD	1.055.000.000	1.054.844.388	0,88
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 0% 04/11/2024	USD	67.000.000	65.446.451	0,05	Cooperatieve Rabobank UA 0% 28/05/2025	USD	350.000.000	331.563.802	0,28
Dexia SA 0% 25/11/2024	USD	500.000.000	486.952.930	0,41	Nederlandse Waterschapsbank NV, 144A 0% 02/07/2024	USD	500.000.000	497.817.060	0,42
Natixis SA 0% 08/07/2024	USD	144.000.000	143.235.490	0,12	Nederlandse Waterschapsbank NV 0% 03/06/2024	USD	300.000.000	299.956.323	0,25
Natixis SA 0% 09/08/2024	USD	85.000.000	84.134.036	0,07					
Natixis SA 0% 03/09/2024	USD	45.000.000	44.367.933	0,04					
Natixis SA 0% 20/12/2024	USD	82.000.000	79.545.085	0,07					
Natixis SA 0% 03/01/2025	USD	35.000.000	33.881.629	0,03					

JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Niederlandse Waterschapsbank NV 0% 03/07/2024	USD	500.000.000	497.780.675	0,42	Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0% 09/09/2024	USD	80.000.000	78.807.227	0,07
Niederlandse Waterschapsbank NV 0% 09/07/2024	USD	500.000.000	497.342.380	0,42	Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0% 12/09/2024	USD	80.000.000	78.772.051	0,07
			<b>3.179.304.628</b>	<b>2,67</b>	Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0% 16/09/2024	USD	47.000.000	46.251.039	0,04
<i>Neuseeland</i>					International Development Association 0% 06/06/2024	USD	300.000.000	299.827.626	0,25
ANZ New Zealand Int'l Ltd., FRN, 144A 5,56% 04/11/2024	USD	75.000.000	75.023.305	0,06	International Development Association 0% 10/07/2024	USD	300.000.000	298.322.889	0,25
ASB Bank Ltd., FRN, 144A 5,45% 03/06/2024	USD	80.000.000	79.999.954	0,07				<b>1.203.480.482</b>	<b>1,01</b>
ASB Bank Ltd., FRN, 144A 5,57% 30/10/2024	USD	140.000.000	140.032.492	0,12					
			<b>295.055.751</b>	<b>0,25</b>	<i>Schweden</i>				
<i>Norwegen</i>					Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A 0% 07/06/2024	USD	225.000.000	224.838.468	0,19
DNB Bank ASA, 144A 0% 10/06/2024	USD	85.000.000	84.901.295	0,07	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A 0% 22/07/2024	USD	61.000.000	60.549.957	0,05
DNB Bank ASA, 144A 0% 13/06/2024	USD	120.000.000	119.813.504	0,10	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A 0% 07/08/2024	USD	68.000.000	67.337.777	0,06
DNB Bank ASA, 144A 0% 18/09/2024	USD	65.000.000	63.944.514	0,05	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN, 144A 5,93% 31/07/2024	USD	79.000.000	79.063.771	0,07
DNB Bank ASA, 144A 0% 25/09/2024	USD	121.000.000	118.910.506	0,10	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN, 144A 5,53% 18/10/2024	USD	120.000.000	120.007.955	0,10
DNB Bank ASA, 144A 0% 07/11/2024	USD	210.000.000	205.056.134	0,17	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN, 144A 5,57% 18/11/2024	USD	259.000.000	259.034.538	0,22
DNB Bank ASA, 144A 0% 02/01/2025	USD	105.000.000	101.684.436	0,09	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN, 144A 5,56% 29/11/2024	USD	175.000.000	175.008.682	0,15
DNB Bank ASA, 144A 0% 01/04/2025	USD	24.000.000	22.937.549	0,02	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0% 27/08/2024	USD	100.000.000	98.697.991	0,08
DNB Bank ASA 0% 27/08/2024	USD	350.000.000	345.433.522	0,29	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0% 28/08/2024	USD	100.000.000	98.682.989	0,08
DNB Bank ASA 0% 19/09/2024	USD	200.000.000	196.713.142	0,17	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0% 30/09/2024	USD	25.000.000	24.547.841	0,02
DNB Bank ASA 0% 02/01/2025	USD	200.000.000	193.662.810	0,16	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 03/06/2024	USD	90.000.000	89.987.009	0,07
			<b>1.453.057.412</b>	<b>1,22</b>	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 11/06/2024	USD	142.000.000	141.815.528	0,12
<i>Singapur</i>					Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 16/07/2024	USD	81.000.000	80.477.642	0,07
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN, 144A 5,5% 26/08/2024	USD	100.000.000	99.999.336	0,08	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 30/07/2024	USD	44.625.000	44.244.540	0,04
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., FRN, 144A 5,53% 29/11/2024	USD	100.000.000	100.000.000	0,08	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 07/08/2024	USD	91.000.000	90.117.148	0,07
United Overseas Bank Ltd., 144A 0% 12/09/2024	USD	126.000.000	124.043.379	0,11	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 12/08/2024	USD	47.000.000	46.509.478	0,04
United Overseas Bank Ltd., FRN, 144A 5,503% 29/08/2024	USD	300.000.000	300.036.711	0,25	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 21/08/2024	USD	230.000.000	227.222.028	0,19
			<b>624.079.426</b>	<b>0,52</b>	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 22/08/2024	USD	26.137.000	25.817.355	0,02
<i>Südkorea</i>					Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 23/08/2024	USD	63.500.000	62.713.798	0,05
Korea Development Bank (The) 0% 15/07/2024	USD	100.000.000	99.352.227	0,09	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 18/09/2024	USD	145.000.000	142.665.541	0,12
Korea Development Bank (The) 0% 10/09/2024	USD	50.000.000	49.234.602	0,04	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 01/10/2024	USD	154.000.000	151.240.466	0,13
Korea Development Bank (The) 0% 10/09/2024	USD	100.000.000	98.469.204	0,08	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 08/11/2024	USD	118.000.000	115.218.341	0,10
			<b>247.056.033</b>	<b>0,21</b>	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 06/01/2025	USD	100.000.000	96.758.463	0,08
<i>Supranational</i>					Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 01/04/2025	USD	93.000.000	88.860.023	0,07
Council Of Europe Development Bank 0% 11/06/2024	USD	55.000.000	54.928.856	0,05	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 27/05/2025	USD	45.000.000	42.647.247	0,03
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0% 04/06/2024	USD	80.000.000	79.977.100	0,07	Svenska Handelsbanken AB, FRN, 144A 5,63% 05/06/2024	USD	45.000.000	45.000.765	0,04
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0% 17/06/2024	USD	20.000.000	19.957.160	0,02				<b>2.699.065.341</b>	<b>2,26</b>
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0% 28/06/2024	USD	50.000.000	49.822.466	0,04	<i>Schweiz</i>				
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0% 28/06/2024	USD	73.000.000	72.740.496	0,06	UBS AG, 144A 0% 02/08/2024	USD	30.000.000	29.721.236	0,03
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0% 02/07/2024	USD	40.000.000	39.830.614	0,03	UBS AG, 144A 0% 03/09/2024	USD	25.000.000	24.641.881	0,02
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0% 22/07/2024	USD	30.000.000	29.784.287	0,02	UBS AG, 144A 0% 13/11/2024	USD	30.000.000	29.253.092	0,02
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0% 23/07/2024	USD	30.000.000	29.791.067	0,02	UBS AG, FRN, 144A 5,535% 02/08/2024	USD	30.000.000	30.004.529	0,03
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0% 29/08/2024	USD	25.000.000	24.667.604	0,02	UBS AG 0% 20/08/2024	USD	100.000.000	98.794.622	0,08
					UBS AG 0% 12/09/2024	USD	215.000.000	211.670.262	0,18
					UBS AG 0% 13/11/2024	USD	350.000.000	341.310.620	0,29
					UBS Group AG, FRN, 144A 5,56% 08/08/2024	USD	40.000.000	40.000.026	0,03
								<b>805.396.268</b>	<b>0,68</b>

JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
<i>Vereinigte Arabische Emirate</i>					ING US Funding LLC, 144A 0%				
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 0% 07/10/2024	USD	50.000.000	48.996.645	0,04	04/09/2024	USD	200.000.000	197.118.934	0,17
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 0% 29/11/2024	USD	100.000.000	97.170.080	0,08	ING US Funding LLC, 144A 0%	USD	100.000.000	98.156.025	0,08
First Abu Dhabi Bank PJSC, 144A 0%					01/10/2024				
23/09/2024	USD	345.000.000	339.013.850	0,29	ING US Funding LLC, 144A 0%	USD	224.000.000	219.640.089	0,18
First Abu Dhabi Bank PJSC, 144A 0%					08/10/2024				
24/09/2024	USD	211.000.000	207.307.297	0,17	ING US Funding LLC, 144A 0%	USD	119.000.000	116.265.693	0,10
First Abu Dhabi Bank PJSC, 144A 0%					10/02/2025				
01/10/2024	USD	240.000.000	235.549.039	0,20	ING US Funding LLC, FRN, 144A	USD	152.000.000	146.265.134	0,12
First Abu Dhabi Bank PJSC, 144A 0%					5,81% 13/06/2024				
02/01/2025	USD	380.000.000	367.847.144	0,31	ING US Funding LLC, FRN, 144A	USD	150.000.000	150.015.271	0,13
First Abu Dhabi Bank PJSC, 144A 0%					5,48% 16/08/2024				
07/01/2025	USD	245.000.000	236.991.754	0,20	ING US Funding LLC, FRN, 144A	USD	200.000.000	200.008.530	0,17
First Abu Dhabi Bank PJSC, 144A 0%					5,53% 25/11/2024				
28/02/2025	USD	300.000.000	287.992.323	0,24	ING US Funding LLC, FRN, 144A	USD	60.000.000	59.991.383	0,05
First Abu Dhabi Bank PJSC, FRN,					5,56% 25/11/2024				
144A 5,53% 14/08/2024	USD	100.000.000	100.018.591	0,08	ING US Funding LLC 0% 14/06/2024	USD	156.000.000	156.000.454	0,13
			<b>1.920.886.723</b>	<b>1,61</b>	ING US Funding LLC 0% 23/08/2024	USD	207.000.000	206.639.634	0,17
					ING US Funding LLC 0% 03/09/2024	USD	155.000.000	153.048.446	0,13
					ING US Funding LLC 0% 22/11/2024	USD	90.139.000	88.854.123	0,07
					ING US Funding LLC 0% 16/12/2024	USD	100.000.000	97.385.532	0,08
					ING US Funding LLC, FRN 5,54%	USD	173.000.000	167.862.950	0,14
<i>Großbritannien</i>					22/10/2024				
Bank of England 0% 08/07/2024	USD	350.000.000	348.250.563	0,29	ING US Funding LLC, FRN 5,58%	USD	100.000.000	100.003.476	0,08
Bank of England 0% 12/07/2024	USD	350.000.000	347.902.030	0,29	12/11/2024				
Bank of England 0% 24/07/2024	USD	500.000.000	496.278.655	0,42	ING US Funding LLC, FRN 5,57%	USD	80.000.000	80.010.351	0,07
Bank of England 0% 31/07/2024	USD	300.000.000	297.461.940	0,25	18/11/2024				
Bank of England 0% 13/08/2024	USD	154.000.000	152.354.843	0,13	La Fayette Asset Securitization LLC,				
Bank of England 0% 15/08/2024	USD	250.000.000	247.271.687	0,21	FRN, 144A 5,51% 06/08/2024	USD	50.000.000	50.000.061	0,04
Barclays Bank plc, 144A 0%					Liberty Street Funding LLC 0%				
26/11/2024	USD	95.000.000	92.454.068	0,08	04/11/2024	USD	30.000.000	29.297.730	0,03
Barclays Bank plc, FRN, 144A 5,53%					Nieuw Amsterdam Receivables				
13/08/2024	USD	79.000.000	79.015.761	0,07	Corp., 144A 0% 10/07/2024	USD	63.000.000	62.642.181	0,05
Barclays Bank plc, FRN, 144A 5,58%					Salisbury Receivables Co. LLC, 144A				
16/10/2024	USD	100.000.000	100.029.661	0,08	0% 31/07/2024	USD	120.000.000	118.943.771	0,10
Barclays Bank plc, FRN, 144A 5,58%					Salisbury Receivables Co. LLC, FRN,				
18/10/2024	USD	100.000.000	100.028.916	0,08	144A 5,58% 08/10/2024	USD	100.000.000	100.005.495	0,08
Lloyds Bank plc, FRN 5,44%					Sheffield Receivables Co. LLC, 144A				
10/06/2024	USD	230.000.000	229.998.390	0,19	0% 10/09/2024	USD	50.000.000	49.233.300	0,04
Mitsubishi Corp. Finance plc 0%					Starbird Funding Corp., FRN, 144A				
02/07/2024	USD	100.000.000	99.570.726	0,08	5,52% 01/08/2024	USD	56.000.000	55.998.089	0,05
Mitsubishi Corp. Finance plc 0%					Starbird Funding Corp., FRN, 144A				
10/07/2024	USD	200.000.000	198.851.124	0,17	5,58% 15/10/2024	USD	80.000.000	80.020.152	0,07
MUFG Securities EMEA plc 0%					Toyota Motor Credit Corp. 0%				
05/08/2024	USD	200.000.000	198.063.176	0,17	07/08/2024	USD	150.000.000	148.531.314	0,13
National Westminster Bank plc, 144A					Toyota Motor Credit Corp. 0%				
0% 04/06/2024	USD	200.000.000	199.940.890	0,17	14/08/2024	USD	101.000.000	99.906.201	0,08
National Westminster Bank plc 0%					Victory Receivables Corp., 144A 0%				
06/06/2024	USD	150.000.000	149.910.843	0,13	06/06/2024	USD	230.000.000	229.864.047	0,19
National Westminster Bank plc 0%								<b>4.582.743.234</b>	<b>3,84</b>
19/07/2024	USD	200.000.000	198.576.718	0,17					
National Westminster Bank plc 0%									
01/08/2024	USD	185.000.000	183.339.908	0,15					
National Westminster Bank Plc 0%									
29/10/2024	USD	100.000.000	97.739.639	0,08	<b>Commercial Papers insgesamt</b>			<b>49.351.746.333</b>	<b>41,39</b>
NatWest Markets plc, 144A 0%									
04/06/2024	USD	415.000.000	414.877.347	0,35	<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare</b>			<b>92.565.809.858</b>	<b>77,63</b>
Santander UK plc 0% 06/06/2024	USD	250.000.000	249.857.255	0,21	<b>Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>				
Santander UK plc 0% 23/07/2024	USD	222.000.000	220.312.820	0,18				<b>93.838.772.188</b>	<b>78,70</b>
Standard Chartered Bank, 144A 0%					<b>Wertpapierbestand insgesamt</b>				
03/07/2024	USD	70.000.000	69.677.384	0,06	<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>				
Standard Chartered Bank, 144A 0%					<i>Frankreich</i>				
03/09/2024	USD	30.000.000	29.573.345	0,02	BNP Paribas SA 5,33% 03/06/2024	USD	809.160.305	809.160.305	0,68
UBS Group AG, FRN, 144A 5,636%									
17/10/2024	USD	142.000.000	142.005.994	0,12				<b>809.160.305</b>	<b>0,68</b>
			<b>4.943.343.683</b>	<b>4,15</b>					
					<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>				
					Citibank NA 5,33% 03/06/2024	USD	38.167.939	38.167.939	0,03
					Fixed Income Clearing Corporation				
					5,33% 03/06/2024	USD	2.000.000.000	2.000.000.000	1,67
					Wells Fargo Securities LLC 5,33%				
					03/06/2024	USD	152.671.756	152.671.756	0,13
								<b>2.190.839.695</b>	<b>1,83</b>
					<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>			<b>3.000.000.000</b>	<b>2,51</b>
					<b>Termineinlagen</b>				
					<i>Österreich</i>				
					Erste Group Bank AG 5,32%				
					03/06/2024	USD	2.110.000.000	2.110.000.000	1,77
								<b>2.110.000.000</b>	<b>1,77</b>

# JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund

## Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
<i>Belgien</i>					<i>Vereinigte Arabische Emirate</i>				
KBC Bank NV 5,32% 03/06/2024	USD	1.000.000.000	1.000.000.000	0,84	First Abu Dhabi Bank PJSC 5,33% 03/06/2024	USD	800.000.000	800.000.000	0,67
			<b>1.000.000.000</b>	<b>0,84</b>	First Abu Dhabi Bank PJSC 5,33% 03/06/2024	USD	1.800.000.000	1.800.000.000	1,51
					First Abu Dhabi Bank PJSC 5,34% 04/06/2024	USD	1.000.000.000	1.000.000.000	0,84
<i>Kanada</i>								<b>3.600.000.000</b>	<b>3,02</b>
Canadian Imperial Bank of Commerce 5,31% 03/06/2024	USD	729.000.000	729.000.000	0,61	<b>Termineinlagen insgesamt</b>			<b>20.903.371.000</b>	<b>17,53</b>
National Bank of Canada 5,31% 03/06/2024	USD	500.000.000	500.000.000	0,42	<b>Bankguthaben</b>			<b>1.812.865.677</b>	<b>1,52</b>
National Bank of Canada 5,32% 05/06/2024	USD	500.000.000	500.000.000	0,42	<b>Andere Aktiva/(Passiva)</b>			<b>(314.011.671)</b>	<b>(0,26)</b>
Royal Bank of Canada 5,32% 03/06/2024	USD	1.150.000.000	1.150.000.000	0,96	<b>Nettovermögen insgesamt</b>			<b>119.240.997.194</b>	<b>100,00</b>
Royal Bank of Canada 5,32% 05/06/2024	USD	570.000.000	570.000.000	0,48					
Toronto-Dominion Bank (The) 5,32% 03/06/2024	USD	450.000.000	450.000.000	0,38					
			<b>3.899.000.000</b>	<b>3,27</b>					
<i>China</i>					<b>Geografische Aufteilung des Wertpapierbestandes zum 31. Mai 2024</b>				
Agricultural Bank of China Ltd. 5,35% 03/06/2024	USD	500.000.000	500.000.000	0,42	Frankreich				15,26
Agricultural Bank of China Ltd. 5,38% 04/06/2024	USD	225.000.000	225.000.000	0,19	Japan				11,68
Agricultural Bank of China Ltd. 5,38% 05/06/2024	USD	280.000.000	280.000.000	0,24	Kanada				11,56
China Construction Bank Corp. 5,35% 03/06/2024	USD	465.000.000	465.000.000	0,39	Vereinigte Staaten von Amerika				9,99
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 5,35% 03/06/2024	USD	995.000.000	995.000.000	0,83	Deutschland				6,92
			<b>2.465.000.000</b>	<b>2,07</b>	Großbritannien				6,72
					Niederlande				6,19
					Schweden				5,14
					Vereinigte Arabische Emirate				4,63
					Australien				3,65
					Belgien				3,51
					China				3,06
					Österreich				2,48
					Norwegen				1,43
					Finnland				1,26
					Schweiz				1,22
					Supranational				1,01
					Singapur				0,89
					Luxemburg				0,89
					Südkorea				0,61
					Neuseeland				0,25
					Curaçao				0,21
					Kaimaninseln				0,18
					<b>Wertpapierbestand insgesamt und geldnahe Anlagen</b>				<b>98,74</b>
					Bankguthaben und andere Aktiva/(Passiva)				1,26
					<b>Summe</b>				<b>100,00</b>
<i>Frankreich</i>									
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,31% 03/06/2024	USD	1.837.836.000	1.837.836.000	1,54					
			<b>1.837.836.000</b>	<b>1,54</b>					
<i>Japan</i>									
Mizuho Bank Ltd. 5,32% 03/06/2024	USD	530.000.000	530.000.000	0,44					
Mizuho Bank Ltd. 5,33% 03/06/2024	USD	1.550.000.000	1.550.000.000	1,30					
			<b>2.080.000.000</b>	<b>1,74</b>					
<i>Niederlande</i>									
ABN AMRO Bank NV 5,33% 07/06/2024	USD	200.000.000	200.000.000	0,17					
ING Bank NV 5,33% 05/06/2024	USD	700.000.000	700.000.000	0,59					
ING Bank NV 5,33% 06/06/2024	USD	325.000.000	325.000.000	0,27					
			<b>1.225.000.000</b>	<b>1,03</b>					
<i>Singapur</i>									
DBS Bank Ltd. 5,34% 03/06/2024	USD	175.000.000	175.000.000	0,15					
DBS Bank Ltd. 5,34% 04/06/2024	USD	175.000.000	175.000.000	0,14					
			<b>350.000.000</b>	<b>0,29</b>					
<i>Schweden</i>									
Skandinaviska Enskilda Banken AB 5,32% 03/06/2024	USD	1.336.535.000	1.336.535.000	1,12					
Skandinaviska Enskilda Banken AB 5,32% 04/06/2024	USD	1.000.000.000	1.000.000.000	0,84					
			<b>2.336.535.000</b>	<b>1,96</b>					

JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen</b>					Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3,75% 22/05/2025	USD	18.528.000	18.205.747	0,21
<i>Kanada</i>					Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3,5% 23/01/2025	USD	45.315.000	44.693.016	0,52
Canadian Pacific Railway Co. 1,35% 02/12/2024	USD	2.000.000	1.957.356	0,02	Humana, Inc. 4,5% 01/04/2025	USD	5.721.000	5.677.186	0,07
Canadian Pacific Railway Co. 2,9% 01/02/2025	USD	3.000.000	2.946.942	0,03	Kinder Morgan Energy Partners LP 4,25% 01/09/2024	USD	17.649.000	17.578.803	0,20
Magna International, Inc. 3,625% 15/06/2024	USD	6.162.000	6.155.906	0,07	MidAmerican Energy Co. 3,5% 15/10/2024	USD	8.210.000	8.140.735	0,09
			<b>11.060.204</b>	<b>0,12</b>	Morgan Stanley 3,7% 23/10/2024	USD	1.840.000	1.826.126	0,02
<i>Japan</i>					Omnicom Group, Inc. 3,65% 01/11/2024	USD	35.898.000	35.582.217	0,41
Mitsubishi HC Capital, Inc., 144A 3,637% 13/04/2025	USD	4.810.000	4.717.533	0,05	Oracle Corp. 3,4% 08/07/2024	USD	2.472.000	2.466.255	0,03
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,193% 25/02/2025	USD	5.235.000	5.106.987	0,06	Oracle Corp. 2,5% 01/04/2025	USD	45.957.000	44.767.792	0,52
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,696% 16/07/2024	USD	5.180.000	5.161.527	0,06	Parker-Hannifin Corp. 3,3% 21/11/2024	USD	8.644.000	8.550.063	0,10
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,348% 15/01/2025	USD	20.071.000	19.668.146	0,23	Public Service Enterprise Group, Inc. 2,875% 15/06/2024	USD	10.798.000	10.783.181	0,12
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 144A 0,8% 16/09/2024	USD	8.565.000	8.445.743	0,10	Republic Services, Inc. 2,5% 15/08/2024	USD	7.000.000	6.954.708	0,08
			<b>43.099.936</b>	<b>0,50</b>	Thermo Fisher Scientific, Inc. 1,215% 18/10/2024	USD	6.945.000	6.832.745	0,08
					Ventas Realty LP, REIT 2,65% 15/01/2025	USD	3.925.000	3.846.075	0,04
					Wells Fargo & Co. 3,3% 09/09/2024	USD	8.420.000	8.366.509	0,10
					Wells Fargo & Co. 3% 19/02/2025	USD	38.019.000	37.318.024	0,43
					Westlake Corp. 0,875% 15/08/2024	USD	10.666.000	10.560.329	0,12
								<b>421.041.076</b>	<b>4,87</b>
<i>Südkorea</i>					<b>Anleihen insgesamt</b>			<b>677.635.793</b>	<b>7,83</b>
Hyundai Capital Services, Inc., 144A 2,125% 24/04/2025	USD	16.891.000	16.339.669	0,19	<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>677.635.793</b>	<b>7,83</b>
			<b>16.339.669</b>	<b>0,19</b>					
<i>Spanien</i>					<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
Banco Santander SA 3,496% 24/03/2025	USD	1.600.000	1.573.480	0,02	<b>Anleihen</b>				
Banco Santander SA, FRN 5,742% 30/06/2024	USD	33.000.000	32.978.738	0,38	<i>Australien</i>				
			<b>34.552.218</b>	<b>0,40</b>	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., FRN, 144A 5,95% 18/03/2026	USD	20.889.000	20.938.089	0,24
<i>Schweiz</i>					Commonwealth Bank of Australia, FRN, 144A 6,012% 10/01/2025	USD	11.400.000	11.425.878	0,13
UBS AG 4,75% 09/08/2024	USD	11.189.000	11.166.576	0,13	Commonwealth Bank of Australia 5,079% 10/01/2025	USD	2.435.000	2.428.642	0,03
UBS AG 3,7% 21/02/2025	USD	16.725.000	16.485.051	0,19	Macquarie Bank Ltd., Reg. S 3,231% 21/03/2025	USD	3.450.000	3.387.992	0,04
UBS Group AG 3,75% 26/03/2025	USD	5.405.000	5.320.966	0,06	Macquarie Group Ltd., 144A 6,207% 22/11/2024	USD	15.656.000	15.693.879	0,18
			<b>32.972.593</b>	<b>0,38</b>	NBN Co. Ltd., 144A 0,875% 08/10/2024	USD	30.228.000	29.720.459	0,35
<i>Großbritannien</i>					Telstra Corp. Ltd., 144A 3,125% 07/04/2025	USD	11.694.000	11.462.575	0,13
Aon Global Ltd. 3,5% 14/06/2024	USD	1.905.000	1.903.232	0,02				<b>95.057.514</b>	<b>1,10</b>
Lloyds Banking Group plc 4,45% 08/05/2025	USD	15.470.000	15.301.352	0,18	<i>Kanada</i>				
NatWest Markets plc, 144A 0,8% 12/08/2024	USD	41.164.000	40.774.615	0,47	Bank of Montreal 2,5% 28/06/2024	USD	7.339.000	7.323.352	0,09
NatWest Markets plc, 144A 3,479% 22/03/2025	USD	5.982.000	5.883.256	0,07	Bank of Montreal, FRN 5,847% 10/01/2025	USD	25.920.000	25.948.899	0,30
NatWest Markets plc, FRN, 144A 5,876% 12/08/2024	USD	9.160.000	9.163.206	0,11	Bank of Montreal, FRN 6,469% 07/06/2025	USD	5.979.000	6.018.524	0,07
NatWest Markets plc, FRN, 144A 6,847% 22/03/2025	USD	11.550.000	11.641.459	0,13	Bank of Nova Scotia (The) 1,45% 10/01/2025	USD	34.695.000	33.829.411	0,39
Reckitt Benckiser Treasury Services plc, 144A 2,75% 26/06/2024	USD	33.970.000	33.902.977	0,39	Bank of Nova Scotia (The) 2,2% 03/02/2025	USD	18.389.000	17.973.484	0,21
			<b>118.570.097</b>	<b>1,37</b>	Bank of Nova Scotia (The), FRN 5,736% 31/07/2024	USD	5.000.000	5.001.280	0,06
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					Bank of Nova Scotia (The), FRN 5,842% 10/01/2025	USD	2.055.000	2.057.562	0,02
AbbVie, Inc. 3,6% 14/05/2025	USD	13.636.000	13.398.496	0,16	Bank of Nova Scotia (The), FRN 6,281% 11/04/2025	USD	16.501.000	16.577.906	0,19
Ameren Corp. 2,5% 15/09/2024	USD	10.000.000	9.905.536	0,11	Bank of Nova Scotia (The), FRN 6,485% 12/06/2025	USD	3.000.000	3.021.973	0,04
Amphenol Corp. 2,05% 01/03/2025	USD	5.823.000	5.668.240	0,07	Canadian Imperial Bank of Commerce 2,25% 28/01/2025	USD	8.178.000	8.001.250	0,09
Cencora, Inc. 3,25% 01/03/2025	USD	30.522.000	29.998.551	0,35	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN 5,796% 18/10/2024	USD	11.848.000	11.855.709	0,14
Citigroup, Inc. 3,3% 27/04/2025	USD	2.000.000	1.961.200	0,02	Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN 6,313% 07/04/2025	USD	1.995.000	2.004.305	0,02
Eastern Energy Gas Holdings LLC 2,5% 15/11/2024	USD	10.074.000	9.934.566	0,11	Federation des caisses Desjardins du Quebec (The), 144A 2,05% 10/02/2025	USD	25.582.000	24.945.306	0,29
Eastern Energy Gas Holdings LLC 3,6% 15/12/2024	USD	18.839.000	18.622.104	0,22	National Bank of Canada 0,75% 06/08/2024	USD	4.830.000	4.788.211	0,06
Energys Louisiana LLC 3,78% 01/04/2025	USD	10.500.000	10.347.998	0,12					
Eversource Energy 4,2% 27/06/2024	USD	9.184.000	9.173.586	0,11					
Fiserv, Inc. 2,75% 01/07/2024	USD	10.779.000	10.753.648	0,12					
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3,85% 08/07/2024	USD	16.349.000	16.316.166	0,19					
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3,5% 01/04/2025	USD	13.038.000	12.811.474	0,15					



JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
National Bank of Canada 5,25% 17/01/2025	USD	25.275.000	25.201.796	0,29	Citigroup, Inc., FRN 6,052% 30/10/2024	USD	46.670.000	46.710.603	0,54
National Bank of Canada, FRN 5,841% 06/08/2024	USD	9.883.000	9.886.846	0,11	Corebridge Global Funding, 144A 0,65% 17/06/2024	USD	12.642.000	12.616.855	0,15
Royal Bank of Canada 3,97% 26/07/2024	USD	1.247.000	1.244.029	0,01	Corebridge Global Funding, Reg. S 0,65% 17/06/2024	USD	3.000.000	2.994.033	0,03
Royal Bank of Canada, FRN 5,717% 29/07/2024	USD	13.094.000	13.096.619	0,15	CRH America, Inc., 144A 3,875% 18/05/2025	USD	3.115.000	3.060.335	0,04
Royal Bank of Canada, FRN 5,802% 21/01/2025	USD	5.000.000	5.004.960	0,06	Daimler Truck Finance North America LLC, 144A 1,625% 13/12/2024	USD	48.817.000	47.787.621	0,55
Royal Bank of Canada, FRN 6,208% 14/04/2025	USD	29.172.000	29.302.953	0,34	Daimler Truck Finance North America LLC, FRN, 144A 6,134% 13/12/2024	USD	4.327.000	4.338.804	0,05
Toronto-Dominion Bank (The) 1,45% 10/01/2025	USD	5.566.000	5.430.779	0,06	DTE Energy Co., STEP 2,529% 01/10/2024	USD	5.717.000	5.655.430	0,07
Toronto-Dominion Bank (The), FRN 5,862% 10/10/2025	USD	10.745.000	10.762.761	0,12	EMD Finance LLC, 144A 3,25% 19/03/2025	USD	8.000.000	7.856.139	0,09
			<b>269.277.915</b>	<b>3,11</b>	Equitable Financial Life Global Funding, 144A 0,8% 12/08/2024	USD	1.214.000	1.201.944	0,01
<i>Frankreich</i>					Equitable Financial Life Global Funding, 144A 1,1% 12/11/2024	USD	6.390.000	6.256.145	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 144A 2,375% 21/11/2024	USD	1.800.000	1.772.817	0,02	ERAC USA Finance LLC, 144A 3,85% 15/11/2024	USD	12.110.000	12.014.854	0,14
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 144A 0,998% 04/02/2025	USD	7.982.000	7.733.912	0,09	Everyg, Inc. 2,45% 15/09/2024	USD	9.255.000	9.167.157	0,11
Banque Federative du Credit Mutuel SA, FRN, 144A 5,761% 04/02/2025	USD	20.910.000	20.921.995	0,24	Gilead Sciences, Inc. 3,5% 01/02/2025	USD	26.030.000	25.674.367	0,30
BPCE SA, 144A 1,625% 14/01/2025	USD	7.130.000	6.959.263	0,08	Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN 5,901% 10/09/2024	USD	12.184.000	12.188.717	0,14
BPCE SA, FRN, 144A 5,938% 14/01/2025	USD	13.396.000	13.412.533	0,16	Hyundai Capital America, 144A 0,875% 14/06/2024	USD	25.430.000	25.391.413	0,29
Credit Agricole SA, 144A 2,375% 22/01/2025	USD	10.000.000	9.782.412	0,11	Hyundai Capital America, 144A 3,4% 20/06/2024	USD	12.500.000	12.483.957	0,14
			<b>60.582.932</b>	<b>0,70</b>	Hyundai Capital America, 144A 1% 17/09/2024	USD	16.668.000	16.432.133	0,19
<i>Niederlande</i>					Hyundai Capital America, 144A 2,65% 10/02/2025	USD	4.266.000	4.173.099	0,05
Cooperatieve Rabobank UA 3,875% 22/08/2024	USD	2.180.000	2.171.738	0,03	Hyundai Capital America, 144A 5,875% 07/04/2025	USD	1.137.000	1.137.245	0,01
Cooperatieve Rabobank UA 5% 13/01/2025	USD	6.357.000	6.337.058	0,08	Hyundai Capital America, FRN, 144A 6,501% 04/08/2025	USD	1.590.000	1.598.264	0,02
EDP Finance BV, 144A 3,625% 15/07/2024	USD	1.660.000	1.655.237	0,02	Hyundai Capital America, FRN, 144A 6,684% 03/11/2025	USD	1.510.000	1.521.808	0,02
EDP Finance BV, Reg. S 3,625% 15/07/2024	USD	3.500.000	3.489.957	0,04	Jackson National Life Global Funding, 144A 2,65% 21/06/2024	USD	10.242.000	10.223.580	0,12
Enel Finance International NV, 144A 2,65% 10/09/2024	USD	29.892.000	29.630.199	0,34	Jackson National Life Global Funding, 144A 1,75% 12/01/2025	USD	10.240.000	9.981.134	0,12
Mondelez International Holdings Netherlands BV, 144A 2,25% 19/09/2024	USD	9.882.000	9.778.082	0,11	Jackson National Life Global Funding, FRN, 144A 6,542% 28/06/2024	USD	32.956.000	32.977.388	0,38
Mondelez International Holdings Netherlands BV, 144A 0,75% 24/09/2024	USD	15.180.000	14.944.298	0,17	John Deere Capital Corp., FRN 5,829% 06/03/2026	USD	53.000.000	53.106.318	0,61
			<b>68.006.569</b>	<b>0,79</b>	MassMutual Global Funding II, FRN, 144A 5,632% 21/10/2024	USD	404.000	404.104	0,00
<i>Schweden</i>					Mercedes-Benz Finance North America LLC, 144A 2,7% 14/06/2024	USD	6.000.000	5.994.044	0,07
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A 0,65% 09/09/2024	USD	8.000.000	7.886.379	0,09	Mercedes-Benz Finance North America LLC, 144A 5,5% 27/11/2024	USD	2.175.000	2.170.596	0,02
			<b>7.886.379</b>	<b>0,09</b>	Mercedes-Benz Finance North America LLC, FRN, 144A 6,302% 30/03/2025	USD	1.470.000	1.478.353	0,02
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					Metropolitan Life Global Funding I, 144A 2,8% 21/03/2025	USD	2.800.000	2.739.576	0,03
American Honda Finance Corp., FRN 5,896% 12/02/2025	USD	28.090.000	28.125.955	0,33	Metropolitan Life Global Funding I, FRN, 144A 5,95% 09/04/2026	USD	14.395.000	14.412.850	0,17
American Honda Finance Corp., FRN 6,142% 23/04/2025	USD	18.345.000	18.406.895	0,21	Morgan Stanley, FRN 5,881% 22/01/2025	USD	30.221.000	30.242.155	0,35
American Honda Finance Corp., FRN 5,807% 29/04/2025	USD	4.871.000	4.873.728	0,06	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 4,2% 20/06/2024	USD	1.485.000	1.483.834	0,02
American Honda Finance Corp., FRN 5,945% 14/08/2025	USD	10.000.000	10.022.690	0,12	Pacific Life Global Funding II, FRN, 144A 6,21% 06/12/2024	USD	9.834.000	9.861.292	0,11
American Honda Finance Corp., FRN 5,882% 10/10/2025	USD	15.990.000	15.999.705	0,18	Pacific Life Global Funding II, FRN, 144A 6,192% 30/03/2025	USD	5.000.000	5.017.660	0,06
Analog Devices, Inc., FRN 5,619% 01/10/2024	USD	22.161.000	22.164.687	0,26	Pacific Life Global Funding II, FRN, 144A 6,25% 16/06/2025	USD	2.832.000	2.847.312	0,03
AT&T, Inc., FRN 6,762% 12/06/2024	USD	10.000.000	10.002.667	0,12	Pacific Life Global Funding II, FRN, 144A 5,987% 27/03/2026	USD	22.594.000	22.613.597	0,26
Athene Global Funding, 144A 1,716% 07/01/2025	USD	4.501.000	4.392.582	0,05	Penske Truck Leasing Co. LP, 144A 3,45% 01/07/2024	USD	7.530.000	7.515.445	0,09
BMW US Capital LLC, FRN, 144A 5,726% 12/08/2024	USD	8.965.000	8.967.421	0,10	PepsiCo, Inc., FRN 5,746% 12/11/2024	USD	7.480.000	7.487.862	0,09
BMW US Capital LLC, FRN, 144A 5,918% 02/04/2026	USD	27.656.000	27.729.744	0,32	Phillips 66 Co. 2,45% 15/12/2024	USD	13.500.000	13.253.407	0,15
BrightHouse Financial Global Funding, 144A 1,75% 13/01/2025	USD	21.320.000	20.773.156	0,24	Principal Life Global Funding II, 144A 0,75% 23/08/2024	USD	5.765.000	5.702.084	0,07
Caterpillar Financial Services Corp., FRN 5,795% 14/11/2024	USD	32.240.000	32.284.798	0,37	Principal Life Global Funding II, 144A 2,25% 21/11/2024	USD	2.556.000	2.513.771	0,03
Caterpillar Financial Services Corp., FRN 5,823% 06/01/2025	USD	15.616.000	15.636.603	0,18	Principal Life Global Funding II, FRN, 144A 5,728% 23/08/2024	USD	2.270.000	2.270.390	0,03
Citibank NA, FRN 5,946% 30/04/2026	USD	12.081.000	12.096.826	0,14	Protective Life Global Funding, 144A 0,781% 05/07/2024	USD	5.910.000	5.884.362	0,07
					Protective Life Global Funding, 144A 3,218% 28/03/2025	USD	1.000.000	980.848	0,01
					Protective Life Global Funding, FRN, 144A 6,445% 11/12/2024	USD	1.650.000	1.656.613	0,02

JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Reliance Standard Life Global Funding II, 144A 2,5% 30/10/2024	USD	10.525.000	10.374.963	0,12	Toronto-Dominion Bank (The) 0% 28/02/2025	USD	30.000.000	28.796.689	0,33
Sherwin-Williams Co. (The) 4,05% 08/08/2024	USD	6.737.000	6.715.860	0,08	Toronto-Dominion Bank (The) 5,33% 18/03/2025	USD	10.567.000	10.547.237	0,12
Sherwin-Williams Co. (The) 3,3% 01/02/2025	USD	6.005.000	5.908.243	0,07				<b>329.813.803</b>	<b>3,81</b>
Tampa Electric Co. 3,875% 12/07/2024	USD	2.010.000	2.005.553	0,02	<i>China</i>				
Toyota Motor Credit Corp., FRN 5,95% 13/06/2024	USD	15.000.000	15.001.500	0,17	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 5,6% 31/07/2024	USD	43.000.000	43.000.467	0,50
Toyota Motor Credit Corp., FRN 5,85% 22/08/2024	USD	18.676.000	18.688.999	0,22				<b>43.000.467</b>	<b>0,50</b>
Toyota Motor Credit Corp., FRN 5,694% 13/09/2024	USD	7.311.000	7.312.638	0,08	<i>Curaçao</i>				
Toyota Motor Credit Corp., FRN 5,68% 14/04/2025	USD	31.410.000	31.422.564	0,36	First Abu Dhabi Bank PJSC, FRN 5,6% 07/11/2024	USD	18.093.000	18.098.842	0,21
Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A 2,85% 26/09/2024	USD	3.907.000	3.868.037	0,04				<b>18.098.842</b>	<b>0,21</b>
Volkswagen Group of America Finance LLC, FRN, 144A 6,359% 07/06/2024	USD	1.185.000	1.185.098	0,01	<i>Finnland</i>				
Volkswagen Group of America Finance LLC, FRN, 144A 6,227% 20/03/2026	USD	17.000.000	17.050.214	0,20	Nordea Bank Abp, FRN 5,63% 21/03/2025	USD	24.517.000	24.527.429	0,29
Xcel Energy, Inc. 3,3% 01/06/2025	USD	11.549.000	11.275.573	0,13	OP Corporate Bank plc 0% 18/02/2025	USD	20.000.000	19.230.623	0,22
			<b>875.366.197</b>	<b>10,12</b>				<b>43.758.052</b>	<b>0,51</b>
<b>Anleihen insgesamt</b>			<b>1.376.177.506</b>	<b>15,91</b>					
<b>Einlagenzertifikate</b>					<i>Frankreich</i>				
<i>Australien</i>					BNP Paribas SA 5,95% 12/09/2024	USD	19.193.000	19.209.512	0,22
Commonwealth Bank of Australia 5,15% 12/02/2025	USD	30.435.000	30.366.079	0,35	BNP Paribas SA 5,95% 03/10/2024	USD	8.104.000	8.112.340	0,09
National Australia Bank Ltd. 0% 04/10/2024	USD	28.000.000	27.478.728	0,32	BNP Paribas SA 5,34% 08/10/2024	USD	31.700.000	31.676.492	0,37
National Australia Bank Ltd. 0% 09/10/2024	USD	30.000.000	29.419.323	0,34	BNP Paribas SA 5,15% 31/12/2024	USD	15.259.000	15.221.618	0,18
National Australia Bank Ltd. 0% 18/02/2025	USD	25.000.000	24.040.199	0,28	BNP Paribas SA, FRN 5,58% 12/11/2024	USD	7.000.000	7.001.864	0,08
Westpac Banking Corp., FRN 5,6% 21/02/2025	USD	19.979.000	19.979.377	0,23	BNP Paribas SA, FRN 5,64% 07/03/2025	USD	9.001.000	9.002.554	0,10
			<b>131.283.706</b>	<b>1,52</b>	BNP Paribas SA, FRN 5,89% 08/08/2025	USD	7.197.000	7.207.255	0,08
<i>Kanada</i>					Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,51% 07/11/2024	USD	11.000.000	11.001.110	0,13
Bank of Montreal 5,99% 11/09/2024	USD	10.000.000	10.010.350	0,12	Credit Agricole Corporate and Investment Bank 5,41% 16/12/2024	USD	15.000.000	14.988.682	0,17
Bank of Montreal 0% 07/10/2024	USD	10.000.000	9.807.994	0,11	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN 5,93% 01/08/2025	USD	18.930.000	18.934.914	0,22
Bank of Montreal 0% 14/02/2025	USD	10.000.000	9.616.876	0,11	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN 5,58% 25/04/2025	USD	19.958.000	20.010.431	0,23
Bank of Montreal 5,53% 02/05/2025	USD	15.000.000	15.001.303	0,17	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, FRN 5,93% 01/08/2025	USD	19.958.000	20.010.431	0,23
Bank of Nova Scotia (The) 5,8% 07/06/2024	USD	11.700.000	11.700.377	0,13	Credit Agricole SA 0% 03/02/2025	USD	20.000.000	19.275.941	0,22
Bank of Nova Scotia (The) 6,05% 28/06/2024	USD	10.909.000	10.912.622	0,13	Credit Agricole SA 0% 18/02/2025	USD	15.000.000	14.424.862	0,17
Canadian Imperial Bank of Commerce 5,8% 07/06/2024	USD	9.168.000	9.168.296	0,11	Credit Industriel et Commercial 5,8% 13/06/2024	USD	10.000.000	10.001.075	0,12
Canadian Imperial Bank of Commerce 5,95% 19/09/2024	USD	10.000.000	10.008.224	0,12	Credit Industriel et Commercial 0% 21/10/2024	USD	20.000.000	19.578.346	0,23
Canadian Imperial Bank of Commerce 5,96% 20/09/2024	USD	21.310.000	21.328.140	0,25	Credit Industriel et Commercial 0% 24/10/2024	USD	15.000.000	14.677.064	0,17
Canadian Imperial Bank of Commerce 5,3% 07/10/2024	USD	30.000.000	29.968.519	0,35	Credit Industriel et Commercial 5,6% 16/04/2025	USD	12.787.000	12.796.227	0,15
Canadian Imperial Bank of Commerce 5,6% 10/12/2024	USD	15.000.000	15.000.781	0,17	Credit Industriel et Commercial 5,6% 29/04/2025	USD	16.852.000	16.865.063	0,20
Canadian Imperial Bank of Commerce 5,4% 19/03/2025	USD	10.000.000	9.989.394	0,12	Credit Industriel et Commercial 5,5% 23/05/2025	USD	10.000.000	10.000.396	0,12
Canadian Imperial Bank of Commerce 5,55% 17/04/2025	USD	15.000.000	15.003.523	0,17	Credit Industriel et Commercial 5,52% 28/05/2025	USD	12.500.000	12.503.314	0,14
Canadian Imperial Bank of Commerce, FRN 5,63% 04/03/2025	USD	25.000.000	25.007.159	0,29	FS Societe Generale/Ossiam 0% 08/11/2024	USD	20.000.000	19.521.215	0,23
Toronto-Dominion Bank (The) 6,05% 03/07/2024	USD	12.305.000	12.309.753	0,14	Natixis SA 5,94% 14/06/2024	USD	12.500.000	12.501.870	0,14
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 26/07/2024	USD	10.000.000	9.916.547	0,11	Natixis SA, FRN 5,92% 08/08/2025	USD	15.927.000	15.963.964	0,18
Toronto-Dominion Bank (The) 6% 09/09/2024	USD	15.000.000	15.012.745	0,17				<b>340.476.109</b>	<b>3,94</b>
Toronto-Dominion Bank (The) 6% 20/09/2024	USD	11.521.000	11.532.285	0,13	<i>Japan</i>				
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 07/10/2024	USD	15.000.000	14.711.030	0,17	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,55% 10/06/2024	USD	5.000.000	5.000.155	0,06
Toronto-Dominion Bank (The) 6% 17/10/2024	USD	10.000.000	10.012.504	0,12	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,83% 05/07/2024	USD	28.000.000	28.010.231	0,32
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 03/02/2025	USD	15.000.000	14.451.455	0,17	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,66% 28/02/2025	USD	35.000.000	35.013.899	0,41
					Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp., FRN 5,72% 03/04/2025	USD	36.547.000	36.565.015	0,42
					Mizuho Bank Ltd. 0% 20/06/2024	USD	20.000.000	19.939.848	0,23
					Mizuho Bank Ltd., FRN 5,68% 30/01/2025	USD	18.307.000	18.317.745	0,21
					MUFG Bank Ltd. 5,36% 16/07/2024	USD	10.000.000	9.998.588	0,12
					Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 6,03% 06/06/2024	USD	4.579.000	4.579.432	0,05



JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 6,03% 12/07/2024	USD	11.631.000	11.638.762	0,13	HSBC Bank USA NA 5,91% 08/08/2024	USD	5.000.000	5.001.941	0,06
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 6,05% 07/08/2024	USD	24.137.000	24.163.643	0,28	Norinchukin Bank (The), FRN 5,54% 19/07/2024	USD	14.287.000	14.289.055	0,17
Sumitomo Mitsui Banking Corp., FRN 5,67% 18/03/2025	USD	17.359.000	17.363.843	0,20	Northern Trust Co.(The) 5,4% 20/09/2024	USD	49.139.000	49.118.797	0,57
			<b>210.591.161</b>	<b>2,43</b>	Wells Fargo Bank NA, FRN 5,83% 25/06/2024	USD	10.000.000	10.002.839	0,12
<i>Niederlande</i>					Wells Fargo Bank NA, FRN 5,98% 28/06/2024	USD	15.000.000	15.006.500	0,17
Cooperatieve Rabobank UA 5,95% 02/07/2024	USD	21.307.000	21.318.410	0,25	Wells Fargo Bank NA, FRN 5,93% 02/08/2024	USD	7.666.000	7.672.891	0,09
Cooperatieve Rabobank UA 5,93% 19/07/2024	USD	25.403.000	25.412.756	0,29	Wells Fargo Bank NA, FRN 5,93% 02/08/2024	USD	20.143.000	20.161.107	0,23
Cooperatieve Rabobank UA 5,9% 06/09/2024	USD	15.000.000	15.017.410	0,17	Wells Fargo Bank NA, FRN 5,93% 04/11/2024	USD	12.094.000	12.115.418	0,14
Cooperatieve Rabobank UA 0% 09/09/2024	USD	15.000.000	14.774.951	0,17			<b>222.092.802</b>	<b>2,57</b>	
Cooperatieve Rabobank UA 5,95% 12/09/2024	USD	31.737.000	31.763.020	0,37	<b>Einlagenzertifikate insgesamt</b>		<b>1.769.004.152</b>	<b>20,46</b>	
ING Bank NV 5,25% 21/10/2024	USD	20.000.000	19.972.581	0,23	<b>Commercial Papers</b>				
			<b>128.259.128</b>	<b>1,48</b>	<i>Australien</i>				
<i>Südkorea</i>					Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 144A 0% 05/07/2024	USD	2.700.000	2.685.978	0,03
Kookmin Bank, FRN 5,89% 27/05/2025	USD	10.651.000	10.647.274	0,12	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 144A 0% 25/07/2024	USD	22.000.000	21.821.581	0,25
			<b>10.647.274</b>	<b>0,12</b>	Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 144A 0% 16/08/2024	USD	10.000.000	9.886.853	0,11
<i>Spanien</i>					Australia & New Zealand Banking Group Ltd., 144A 0% 08/10/2024	USD	30.000.000	29.421.861	0,34
Banco Santander SA, FRN 5,7% 02/05/2025	USD	18.947.000	18.950.417	0,22	Commonwealth Bank of Australia, 144A 0% 22/07/2024	USD	12.348.000	12.252.898	0,14
			<b>18.950.417</b>	<b>0,22</b>	Commonwealth Bank of Australia, 144A 0% 09/09/2024	USD	12.360.000	12.175.520	0,14
<i>Schweden</i>					Commonwealth Bank of Australia, 144A 0% 16/09/2024	USD	9.721.000	9.565.795	0,11
Skandinaviska Enskilda Banken AB 5,38% 19/03/2025	USD	11.708.000	11.687.999	0,13	Commonwealth Bank of Australia, 144A 0% 17/10/2024	USD	11.940.000	11.693.986	0,14
Skandinaviska Enskilda Banken AB 5,5% 28/05/2025	USD	43.000.000	42.987.059	0,50	Macquarie Bank Ltd., 144A 0% 20/08/2024	USD	16.409.000	16.206.197	0,19
Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN 5,63% 07/03/2025	USD	23.893.000	23.897.302	0,28	Macquarie Bank Ltd., FRN, 144A 5,93% 30/10/2024	USD	10.000.000	10.016.620	0,12
Svenska Handelsbanken AB 5,905% 18/06/2024	USD	20.000.000	20.003.823	0,23	Macquarie International Finance Ltd. 0% 31/01/2025	USD	29.182.000	28.115.354	0,32
Svenska Handelsbanken AB 5,9% 01/08/2024	USD	12.000.000	12.007.979	0,14	National Australia Bank Ltd., FRN, 144A 5,8% 25/07/2024	USD	25.000.000	25.013.810	0,29
Svenska Handelsbanken AB 5,27% 12/02/2025	USD	20.000.000	19.955.667	0,23	National Australia Bank Ltd., FRN, 144A 5,68% 09/04/2025	USD	19.795.000	19.799.209	0,23
Svenska Handelsbanken AB 5,385% 19/03/2025	USD	14.153.000	14.132.743	0,16	Suncorp-Metway Ltd., 144A 0% 02/07/2024	USD	22.369.000	22.262.398	0,26
Svenska Handelsbanken AB, FRN 5,68% 23/01/2025	USD	11.071.000	11.078.917	0,13	Suncorp-Metway Ltd., 144A 0% 16/07/2024	USD	23.950.000	23.785.643	0,27
			<b>155.751.489</b>	<b>1,80</b>	Suncorp-Metway Ltd., 144A 0% 29/07/2024	USD	34.750.000	34.443.639	0,40
<i>Schweiz</i>					Suncorp-Metway Ltd., 144A 0% 25/11/2024	USD	31.086.000	30.272.091	0,35
UBS AG 0% 26/07/2024	USD	20.000.000	19.833.257	0,23	Telstra Group Ltd., 144A 0% 12/06/2024	USD	34.698.000	34.635.724	0,40
			<b>19.833.257</b>	<b>0,23</b>	Telstra Group Ltd., 144A 0% 06/09/2024	USD	5.000.000	4.923.270	0,06
<i>Großbritannien</i>					Westpac Banking Corp., 144A 0,63% 12/07/2024	USD	5.150.000	5.118.388	0,06
Barclays Bank plc 6% 08/08/2024	USD	27.000.000	27.014.714	0,31	Westpac Banking Corp., 144A 0% 06/09/2024	USD	17.727.000	17.469.206	0,20
Lloyds Bank plc 5,98% 17/07/2024	USD	1.000.000	1.000.506	0,01	Westpac Banking Corp., 144A 0% 13/09/2024	USD	9.561.000	9.412.366	0,11
Lloyds Bank plc, FRN 5,99% 15/08/2024	USD	13.218.000	13.232.991	0,16	Westpac Banking Corp., 144A 0% 10/10/2024	USD	10.000.000	9.806.319	0,11
Lloyds Bank plc, FRN 5,94% 02/10/2024	USD	22.477.000	22.510.829	0,26	Westpac Banking Corp., 144A 0% 28/01/2025	USD	35.000.000	33.766.941	0,39
Lloyds Bank plc, FRN 5,65% 12/03/2025	USD	12.718.000	12.719.172	0,15	Westpac Banking Corp., 144A 0% 14/04/2025	USD	25.000.000	23.853.698	0,28
Lloyds Bank plc, FRN 5,9% 30/10/2025	USD	19.950.000	19.969.433	0,23			<b>458.405.345</b>	<b>5,30</b>	
			<b>96.447.645</b>	<b>1,12</b>	<i>Kanada</i>				
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					Alimentation Couche-Tard, Inc., 144A 0% 15/07/2024	USD	13.000.000	12.908.675	0,15
Bank of America NA 5,8% 07/06/2024	USD	21.320.000	21.320.646	0,25	Bank of Montreal 0% 04/09/2024	USD	15.000.000	14.785.360	0,17
Bank of America NA 5,92% 09/08/2024	USD	5.764.000	5.766.445	0,07	Bank of Montreal 0% 18/03/2025	USD	15.000.000	14.363.583	0,17
Bank of America NA 6% 23/09/2024	USD	17.717.000	17.734.627	0,20	Bank of Montreal, FRN 5,93% 01/08/2024	USD	10.000.000	10.007.709	0,12
Citibank NA 5,95% 25/10/2024	USD	9.940.000	9.951.623	0,11	Bank of Nova Scotia (The), 144A 0% 02/04/2025	USD	10.000.000	9.553.903	0,11
Citibank NA, FRN 5,93% 28/10/2024	USD	13.930.000	13.952.256	0,16	Brookfield Corporate Treasury Ltd., 144A 0% 03/06/2024	USD	49.250.000	49.226.735	0,57
Goldman Sachs Bank, FRN 5,553% 18/11/2024	USD	20.000.000	19.998.657	0,23					

JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Brookfield Corporate Treasury Ltd., 144A 0% 24/06/2024	USD	9.000.000	8.965.832	0,10	<i>Niederlande</i>				
Brookfield Corporate Treasury Ltd., 144A 0% 26/06/2024	USD	700.000	697.120	0,01	Cooperatieve Rabobank UA 0% 18/11/2024	USD	90.000.000	87.713.688	1,01
Brookfield Corporate Treasury Ltd., 144A 0% 27/06/2024	USD	500.000	497.864	0,01				<b>87.713.688</b>	<b>1,01</b>
Brookfield Corporate Treasury Ltd., 144A 0% 28/06/2024	USD	58.746.000	58.485.641	0,68	<i>Neuseeland</i>				
Magna International, Inc., 144A 0% 25/06/2024	USD	15.000.000	14.942.622	0,17	Westpac Securities NZ Ltd., 144A 0% 29/01/2025	USD	16.274.000	15.687.217	0,18
Magna International, Inc., 144A 0% 02/07/2024	USD	63.000.000	62.690.245	0,72				<b>15.687.217</b>	<b>0,18</b>
National Bank of Canada, 144A 0% 05/03/2025	USD	9.952.000	9.545.076	0,11	<i>Norwegen</i>				
National Bank of Canada, 144A 0% 30/04/2025	USD	21.500.000	20.450.651	0,24	DNB Bank ASA, 144A 0% 16/10/2024	USD	6.000.000	5.877.870	0,07
National Bank of Canada, 144A 0% 23/05/2025	USD	17.000.000	16.114.475	0,19	DNB Bank ASA, 144A 0% 07/02/2025	USD	30.666.000	29.539.025	0,34
National Bank of Canada, FRN, 144A 5,63% 13/03/2025	USD	21.206.000	21.211.268	0,24	DNB Bank ASA, 144A 0% 29/05/2025	USD	24.597.000	23.308.778	0,27
Nutrien Ltd., 144A 0% 05/06/2024	USD	29.255.000	29.232.786	0,34	Equinor ASA, 144A 0% 18/10/2024	USD	23.094.000	22.613.217	0,26
Nutrien Ltd., 144A 0% 11/06/2024	USD	4.000.000	3.993.293	0,05				<b>81.338.890</b>	<b>0,94</b>
Nutrien Ltd., 144A 0% 25/06/2024	USD	10.000.000	9.961.470	0,11	<i>Singapur</i>				
Royal Bank of Canada, 144A 0% 11/10/2024	USD	10.000.000	9.801.342	0,11	DBS Bank Ltd., 144A 0% 30/08/2024	USD	44.932.000	44.326.364	0,51
Royal Bank of Canada, FRN, 144A 5,64% 07/06/2024	USD	15.000.000	15.000.372	0,17				<b>44.326.364</b>	<b>0,51</b>
Royal Bank of Canada, FRN, 144A 5,97% 08/07/2024	USD	10.000.000	10.004.275	0,11	<i>Spanien</i>				
Royal Bank of Canada, FRN, 144A 5,67% 09/05/2025	USD	25.000.000	25.002.559	0,29	Banco Santander SA, 144A 0% 11/10/2024	USD	12.000.000	11.760.098	0,14
TELUS Corp., 144A 0% 12/06/2024	USD	21.339.000	21.300.176	0,25				<b>11.760.098</b>	<b>0,14</b>
Toronto-Dominion Bank (The) 0% 01/08/2024	USD	13.000.000	12.879.921	0,15					
			<b>461.622.953</b>	<b>5,34</b>	<i>Schweden</i>				
<i>Chile</i>					Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A 0% 10/07/2024	USD	19.699.000	19.583.965	0,23
Banco Santander Chile, 144A 0% 03/10/2024	USD	16.675.000	16.334.263	0,19	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A 0% 22/07/2024	USD	7.400.000	7.343.712	0,08
			<b>16.334.263</b>	<b>0,19</b>	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A 0% 22/04/2025	USD	15.750.000	15.000.572	0,17
<i>China</i>					Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A 0% 23/04/2025	USD	15.977.000	15.214.604	0,18
Agricultural Bank of China Ltd., 144A 0% 01/08/2024	USD	37.000.000	36.638.738	0,42	Skandinaviska Enskilda Banken AB, FRN, 144A 5,93% 31/07/2024	USD	10.000.000	10.008.337	0,11
			<b>36.638.738</b>	<b>0,42</b>	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 11/06/2024	USD	13.000.000	12.979.072	0,15
<i>Frankreich</i>					Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 22/08/2024	USD	22.596.000	22.319.660	0,26
Credit Agricole Corporate and Investment Bank 0% 04/10/2024	USD	16.083.000	15.784.323	0,18	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 01/10/2024	USD	15.000.000	14.731.214	0,17
Credit Industriel et Commercial, 144A 0% 06/02/2025	USD	14.629.000	14.071.272	0,16	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 01/04/2025	USD	10.000.000	9.554.841	0,11
Dexia SA, 144A 0% 07/06/2024	USD	30.000.000	29.968.908	0,35	Svenska Handelsbanken AB, 144A 0% 22/04/2025	USD	25.972.000	24.739.851	0,29
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton, Inc., 144A 0% 18/06/2024	USD	20.060.000	20.006.696	0,23				<b>151.475.828</b>	<b>1,75</b>
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton, Inc., 144A 0% 25/10/2024	USD	5.136.000	5.024.796	0,06	<i>Schweiz</i>				
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton, Inc., 144A 0% 02/12/2024	USD	31.900.000	31.033.545	0,36	UBS AG, 144A 0% 03/09/2024	USD	10.000.000	9.856.752	0,11
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton, Inc., 144A 0% 21/01/2025	USD	11.261.000	10.875.713	0,13	UBS AG 0% 12/09/2024	USD	35.000.000	34.457.950	0,40
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton, Inc., 144A 0% 22/01/2025	USD	25.633.000	24.752.400	0,29				<b>44.314.702</b>	<b>0,51</b>
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton, Inc., 144A 0% 14/03/2025	USD	12.140.000	11.636.639	0,13	<i>Vereinigte Arabische Emirate</i>				
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton, Inc., 144A 0% 17/03/2025	USD	27.404.000	26.256.224	0,30	First Abu Dhabi Bank PJSC, 144A 0% 08/08/2024	USD	9.233.000	9.137.793	0,11
Natixis SA 0% 08/07/2024	USD	15.850.000	15.761.104	0,18	First Abu Dhabi Bank PJSC, 144A 0% 01/10/2024	USD	10.000.000	9.814.543	0,11
Natixis SA 0% 20/12/2024	USD	18.000.000	17.461.116	0,20	First Abu Dhabi Bank PJSC, 144A 0% 08/10/2024	USD	32.565.000	31.927.239	0,37
Societe Generale SA, 144A 0% 21/06/2024	USD	21.000.000	20.935.173	0,24	First Abu Dhabi Bank PJSC, 144A 0% 02/01/2025	USD	35.000.000	33.880.658	0,39
Societe Generale SA, 144A 0% 01/07/2024	USD	4.000.000	3.981.786	0,05	First Abu Dhabi Bank PJSC, 144A 0% 28/02/2025	USD	27.500.000	26.399.296	0,31
Societe Generale SA, 144A 0% 14/01/2025	USD	32.950.000	31.840.097	0,37				<b>111.159.529</b>	<b>1,29</b>
Societe Generale SA, 144A 0% 07/02/2025	USD	39.960.000	38.475.414	0,44	<i>Großbritannien</i>				
Societe Generale SA, 144A 0% 29/05/2025	USD	17.025.000	16.124.229	0,19	AstraZeneca plc, 144A 0% 09/10/2024	USD	8.894.000	8.714.173	0,10
			<b>333.989.435</b>	<b>3,86</b>	Barclays Bank plc, 144A 0% 06/06/2024	USD	25.000.000	24.977.827	0,29
					Barclays Bank plc, 144A 0% 29/01/2025	USD	26.000.000	25.059.583	0,29
					Lloyds Bank plc, 144A 0% 03/07/2024	USD	8.000.000	7.960.745	0,09

JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Lloyds Bank plc, 144A 0% 12/02/2025	USD	28.022.000	26.959.763	0,31	Entergy Corp., 144A 0% 09/07/2024	USD	28.463.000	28.291.373	0,33
LSEGA Financing plc, 144A 0% 06/08/2024	USD	19.000.000	18.806.763	0,22	Equitable Short Term Funding LLC, 144A 0% 09/07/2024	USD	13.471.000	13.393.026	0,15
LSEGA Financing plc, 144A 0% 09/08/2024	USD	50.000.000	49.468.518	0,57	Evergy Metro, Inc., 144A 0% 03/06/2024	USD	92.500.000	92.458.188	1,07
LSEGA Financing plc, 144A 0% 19/08/2024	USD	18.000.000	17.781.067	0,21	General Motors Financial Co., Inc., 144A 0% 03/06/2024	USD	54.000.000	53.975.481	0,62
NatWest Markets plc, 144A 0% 22/07/2024	USD	13.075.000	12.974.249	0,15	General Motors Financial Co., Inc., 144A 0% 24/07/2024	USD	4.050.000	4.015.883	0,05
NatWest Markets plc, 144A 0% 23/10/2024	USD	6.850.000	6.703.657	0,08	General Motors Financial Co., Inc., 144A 0% 19/11/2024	USD	25.000.000	24.320.043	0,28
Natwest Markets Securities, Inc., 144A 0% 05/07/2024	USD	20.000.000	19.896.491	0,23	General Motors Financial Co., Inc., 144A 0% 27/11/2024	USD	9.996.000	9.711.614	0,11
Standard Chartered Bank, 144A 0% 16/07/2024	USD	23.000.000	22.844.399	0,26	Glencore Funding LLC, 144A 0% 06/06/2024	USD	14.022.000	14.009.056	0,16
Standard Chartered Bank, 144A 0% 27/08/2024	USD	13.950.000	13.766.242	0,16	Glencore Funding LLC, 144A 0% 12/06/2024	USD	5.000.000	4.990.752	0,06
Standard Chartered Bank, 144A 0% 13/09/2024	USD	22.000.000	21.654.912	0,25	Glencore Funding LLC, 144A 0% 08/07/2024	USD	8.204.000	8.154.749	0,09
Standard Chartered Bank, 144A 0% 14/02/2025	USD	30.961.000	29.781.034	0,35	Glencore Funding LLC, 144A 0% 30/08/2024	USD	24.725.000	24.376.275	0,28
Standard Chartered Bank, 144A 0% 21/05/2025	USD	25.000.000	23.707.525	0,27	Great Bear Funding LLC, FRN, 144A 5,58% 01/10/2024	USD	40.000.000	40.002.636	0,46
			<b>331.056.948</b>	<b>3,83</b>	Henkel Corp., 144A 0% 10/09/2024	USD	11.757.000	11.580.582	0,13
					Henkel Corp., 144A 0% 18/10/2024	USD	29.524.000	28.915.095	0,33
					Henkel Corp., 144A 0% 30/10/2024	USD	12.803.000	12.516.533	0,14
					Henkel of America, Inc., 144A 0% 25/11/2024	USD	35.390.000	34.464.218	0,40
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					Henkel of America, Inc., 144A 0% 26/11/2024	USD	16.722.000	16.282.133	0,19
ABN AMRO Funding USA LLC, 144A 0% 18/11/2024	USD	15.306.000	14.912.456	0,17	HSBC USA, Inc., 144A 0% 06/06/2024	USD	7.277.000	7.270.503	0,08
Alliant Energy Corp., 144A 0% 03/06/2024	USD	30.000.000	29.986.439	0,35	HSBC USA, Inc., 144A 0% 04/11/2024	USD	15.000.000	14.641.015	0,17
Allianz Finance Corp., 144A 0% 03/10/2024	USD	8.400.000	8.243.715	0,10	HSBC USA, Inc., 144A 0% 07/02/2025	USD	25.200.000	24.249.239	0,28
Allianz Finance Corp., 144A 0% 07/10/2024	USD	28.400.000	27.854.836	0,32	HSBC USA, Inc., 144A 0% 12/02/2025	USD	23.985.000	23.061.640	0,27
Ameren Corp. 0% 03/06/2024	USD	15.000.000	14.993.220	0,17	HSBC USA, Inc., 144A 0% 20/03/2025	USD	5.000.000	4.780.531	0,06
Ameren Illinois Co. 0% 03/06/2024	USD	55.000.000	54.975.139	0,64	HSBC USA, Inc., 144A 0% 24/04/2025	USD	15.000.000	14.265.654	0,16
American Electric Power Co., Inc., 144A 0% 26/09/2024	USD	25.000.000	24.540.346	0,28	HSBC USA, Inc., 144A 0% 20/05/2025	USD	30.160.000	28.571.282	0,33
American Honda Finance Corp. 0% 11/07/2024	USD	5.000.000	4.968.354	0,06	ING US Funding LLC, 144A 0% 14/06/2024	USD	12.500.000	12.474.061	0,14
Bank of New York Mellon (The), FRN 5,68% 09/05/2025	USD	12.353.000	12.355.100	0,14	ING US Funding LLC, 144A 0% 18/07/2024	USD	5.000.000	4.964.160	0,06
BOFA Securities, Inc. 0% 19/07/2024	USD	24.798.000	24.615.431	0,28	ING US Funding LLC, 144A 0% 25/07/2024	USD	7.500.000	7.438.373	0,09
BOFA Securities, Inc. 0% 21/02/2025	USD	25.000.000	24.009.569	0,28	ING US Funding LLC, 144A 0% 09/09/2024	USD	12.000.000	11.818.077	0,14
BOFA Securities, Inc. 0% 26/02/2025	USD	18.000.000	17.273.896	0,20	ING US Funding LLC, 144A 0% 23/12/2024	USD	18.000.000	17.447.020	0,20
BOFA Securities, Inc. 0% 29/05/2025	USD	25.000.000	23.668.683	0,27	ING US Funding LLC, FRN, 144A 5,81% 13/06/2024	USD	12.000.000	12.001.662	0,14
Brighthouse Financial Short Term Funding LLC, 144A 0% 05/05/2025	USD	25.000.000	23.757.861	0,27	ING US Funding LLC 0% 22/11/2024	USD	40.384.000	39.328.173	0,45
Bunge Ltd. Finance Corp., 144A 0% 03/06/2024	USD	30.000.000	29.986.439	0,35	Kinder Morgan, Inc., 144A 0% 03/06/2024	USD	160.000.000	159.923.904	1,85
CenterPoint Energy Resources Corp., 144A 0% 03/06/2024	USD	60.000.000	59.973.079	0,69	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton, Inc., 144A 0% 17/09/2024	USD	18.050.000	17.758.460	0,21
CenterPoint Energy, Inc., 144A 0% 03/06/2024	USD	90.000.000	89.959.618	1,04	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton, Inc., 144A 0% 02/01/2025	USD	2.000.000	1.936.906	0,02
Cisco Systems, Inc., 144A 0% 30/10/2024	USD	15.000.000	14.664.291	0,17	Mondelez International, Inc., 144A 0% 03/06/2024	USD	45.000.000	44.979.659	0,52
Citigroup Global Markets, Inc., 144A 0% 19/09/2024	USD	10.257.000	10.084.355	0,12	NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 144A 0% 21/06/2024	USD	50.000.000	49.839.321	0,58
Citigroup Global Markets, Inc., 144A 0% 25/09/2024	USD	12.500.000	12.279.284	0,14	NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 144A 0% 10/07/2024	USD	10.000.000	9.938.148	0,11
CNH Industrial Capital LLC, 144A 0% 28/06/2024	USD	26.520.000	26.405.550	0,31	NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 144A 0% 19/07/2024	USD	4.000.000	3.969.660	0,05
CNH Industrial Capital LLC, 144A 0% 04/11/2024	USD	17.000.000	16.572.688	0,19	ONE Gas, Inc., 144A 0% 06/06/2024	USD	7.100.000	7.093.517	0,08
Constellation Energy Generation LLC, 144A 0% 03/06/2024	USD	100.000.000	99.949.964	1,16	Otis Worldwide Corp 0% 03/06/2024	USD	21.000.000	20.990.508	0,24
CRH America Finance, Inc., 144A 0% 10/06/2024	USD	3.933.000	3.927.049	0,05	PECO Energy Co., 144A 0% 03/06/2024	USD	119.000.000	118.946.266	1,38
CRH America Finance, Inc., 144A 0% 21/06/2024	USD	33.500.000	33.392.345	0,39	Phillips 66, 144A 0% 03/06/2024	USD	50.000.000	49.977.274	0,58
CRH America Finance, Inc., 144A 0% 28/06/2024	USD	15.500.000	15.433.108	0,18	PPG Industries, Inc. 0% 26/06/2024	USD	20.000.000	19.920.373	0,23
CRH America Finance, Inc., 144A 0% 23/08/2024	USD	6.000.000	5.921.656	0,07	Starrbird Funding Corp., 144A 0% 05/06/2024	USD	30.000.000	29.977.762	0,35
Dominion Energy, Inc., 144A 0% 21/06/2024	USD	16.700.000	16.646.528	0,19	Sysco Corp., 144A 0% 03/06/2024	USD	56.895.000	56.869.485	0,66
EIDP, Inc., 144A 0% 08/10/2024	USD	40.701.000	39.898.512	0,46	UnitedHealth Group, Inc., 144A 0% 30/09/2024	USD	35.847.000	35.192.296	0,41
EIDP, Inc., 144A 0% 02/12/2024	USD	7.000.000	6.804.053	0,08	Walt Disney Co. (The), 144A 0% 07/11/2024	USD	27.956.000	27.274.288	0,32
EIDP, Inc., 144A 0% 05/12/2024	USD	14.000.000	13.601.876	0,16	Walt Disney Co. (The), 144A 0% 08/11/2024	USD	28.000.000	27.312.989	0,32
EIDP, Inc., 144A 0% 10/12/2024	USD	15.000.000	14.562.322	0,17				<b>2.283.416.380</b>	<b>26,41</b>
EIDP, Inc., 144A 0% 13/12/2024	USD	15.048.000	14.602.235	0,17					
Enel Finance America LLC, 144A 0% 04/11/2024	USD	14.229.000	13.882.117	0,16	<b>Commercial Papers insgesamt</b>			<b>4.469.240.378</b>	<b>51,68</b>
Enel Finance America LLC, 144A 0% 18/11/2024	USD	14.576.000	14.188.971	0,16	<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>7.614.422.036</b>	<b>88,05</b>
Energy Mo West, Inc., 144A 0% 03/06/2024	USD	35.900.000	35.883.772	0,41	<b>Wertpapierbestand insgesamt</b>			<b>8.292.057.829</b>	<b>95,88</b>
Entergy Corp., 144A 0% 03/06/2024	USD	63.000.000	62.971.680	0,73					

JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
<b>Termineinlagen</b>				
<i>Japan</i>				
Mizuho Bank Ltd. 5,32% 03/06/2024	USD	200.000.000	200.000.000	2,31
			<b>200.000.000</b>	<b>2,31</b>
<i>Schweden</i>				
Skandinaviska Enskilda Banken AB 5,32% 03/06/2024	USD	62.671.000	62.671.000	0,73
			<b>62.671.000</b>	<b>0,73</b>
<b>Termineinlagen insgesamt</b>			<b>262.671.000</b>	<b>3,04</b>
<b>Bankguthaben</b>			<b>101.083.408</b>	<b>1,17</b>
<b>Andere Aktiva/(Passiva)</b>			<b>(8.110.371)</b>	<b>(0,09)</b>
<b>Nettovermögen insgesamt</b>			<b><u>8.647.701.866</u></b>	<b><u>100,00</u></b>

Geografische Aufteilung des Wertpapierbestandes zum 31. Mai 2024	% des Netto- vermögens
Vereinigte Staaten von Amerika	43,97
Kanada	12,38
Frankreich	8,50
Australien	7,92
Großbritannien	6,32
Japan	5,24
Schweden	4,37
Niederlande	3,28
Vereinigte Arabische Emirate	1,29
Schweiz	1,12
Norwegen	0,94
China	0,92
Spanien	0,76
Singapur	0,51
Finnland	0,51
Südkorea	0,31
Curaçao	0,21
Chile	0,19
Neuseeland	0,18
<b>Wertpapierbestand insgesamt und geldnahe Anlagen</b>	<b>98,92</b>
Bankguthaben und andere Aktiva/(Passiva)	1,08
<b>Summe</b>	<b><u>100,00</u></b>

JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund

Wertpapierbestand

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>				
<b>Anleihen</b>					<i>Kanada</i>				
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					Bank of Montreal 5,33% 03/06/2024				
US Treasury 2,25% 31/10/2024	USD	120.000.000	118.737.571	0,21	USD	250.000.000	250.000.000	0,43	
US Treasury 4,375% 31/10/2024	USD	90.000.000	89.795.887	0,16	Bank of Nova Scotia (The) 5,33% 03/06/2024	USD	350.000.000	350.000.000	0,61
US Treasury 0,75% 15/11/2024	USD	307.000.000	301.405.823	0,52	Canadian Imperial Bank of Commerce 5,33% 03/06/2024	USD	750.000.000	750.000.000	1,30
US Treasury 2,25% 15/11/2024	USD	197.000.000	194.727.174	0,34	Rbc Dominion Securities, Inc. 5,33% 03/06/2024	USD	250.000.000	250.000.000	0,43
US Treasury 1,5% 30/11/2024	USD	154.000.000	151.486.078	0,26			<b>1.600.000.000</b>	<b>2,77</b>	
US Treasury 2,125% 30/11/2024	USD	115.000.000	113.464.713	0,20					
US Treasury 4,5% 30/11/2024	USD	37.000.000	36.929.692	0,06	<i>Frankreich</i>				
US Treasury 1% 15/12/2024	USD	47.000.000	46.065.288	0,08	BNP Paribas SA 5,33% 03/06/2024	USD	100.000.000	100.000.000	0,17
US Treasury 1,5% 15/02/2025	USD	150.000.000	146.438.028	0,25	BNP Paribas SA 5,33% 03/06/2024	USD	485.496.183	485.496.183	0,84
US Treasury 2% 15/02/2025	USD	180.000.000	176.334.942	0,30	Credit Agricole Corporate and Investment Bank SA 5,33% 03/06/2024	USD	1.000.000.000	1.000.000.000	1,73
US Treasury 1,125% 28/02/2025	USD	180.000.000	174.946.294	0,30	Natixis SA 5,33% 03/06/2024	USD	500.000.000	500.000.000	0,86
US Treasury 1,75% 15/03/2025	USD	120.000.000	116.991.741	0,20			<b>2.085.496.183</b>	<b>3,60</b>	
US Treasury, FRN 5,363% 31/07/2024	USD	2.145.000.000	2.145.031.698	3,71					
US Treasury, FRN 5,466% 31/10/2024	USD	1.885.000.000	1.885.644.154	3,26	<i>Deutschland</i>				
US Treasury, FRN 5,526% 31/01/2025	USD	1.021.667.000	1.022.210.284	1,77	Deutsche Bank AG 5,33% 03/06/2024	USD	3.500.000.000	3.500.000.000	6,05
US Treasury, FRN 5,495% 30/04/2025	USD	913.000.000	913.663.334	1,58			<b>3.500.000.000</b>	<b>6,05</b>	
US Treasury Bill 0% 13/06/2024	USD	659.440.000	658.475.970	1,14	<i>Japan</i>				
US Treasury Bill 0% 20/06/2024	USD	838.000.000	835.969.945	1,44	Nomura Securities Co. Ltd. 5,33% 03/06/2024	USD	550.000.000	550.000.000	0,95
US Treasury Bill 0% 27/06/2024	USD	920.000.000	916.884.267	1,58	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 5,33% 03/06/2024	USD	400.000.000	400.000.000	0,69
US Treasury Bill 0% 05/07/2024	USD	710.000.000	706.807.584	1,22			<b>950.000.000</b>	<b>1,64</b>	
US Treasury Bill 0% 11/07/2024	USD	288.000.000	286.470.880	0,50	<i>Norwegen</i>				
US Treasury Bill 0% 08/08/2024	USD	1.053.000.000	1.043.256.228	1,80	Norges Bank 5,34% 03/06/2024	USD	5.601.060.345	5.601.060.345	9,68
US Treasury Bill 0% 05/09/2024	USD	430.000.000	424.251.378	0,73			<b>5.601.060.345</b>	<b>9,68</b>	
US Treasury Bill 0% 03/10/2024	USD	695.000.000	682.901.836	1,18	<i>Spanien</i>				
US Treasury Bill 0% 29/11/2024	USD	600.000.000	584.572.439	1,01	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 5,33% 03/06/2024	USD	1.500.000.000	1.500.000.000	2,59
US Treasury Bill 0% 26/12/2024	USD	780.000.000	759.495.275	1,31			<b>1.500.000.000</b>	<b>2,59</b>	
US Treasury Bill 0% 23/01/2025	USD	300.000.000	291.088.499	0,50	<i>Großbritannien</i>				
US Treasury Bill 0% 20/02/2025	USD	210.000.000	202.445.667	0,35	Natwest Markets Securities, Inc. 5,33% 03/06/2024	USD	250.000.000	250.000.000	0,43
US Treasury Bill 0% 17/04/2025	USD	671.000.000	641.719.620	1,11			<b>250.000.000</b>	<b>0,43</b>	
			<b>15.668.212.289</b>	<b>27,07</b>	<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>				
<b>Anleihen insgesamt</b>			<b>15.668.212.289</b>	<b>27,07</b>	Barclays Capital, Inc. 5,33% 03/06/2024	USD	200.671.000	200.671.000	0,35
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>15.668.212.289</b>	<b>27,07</b>	BOFA Securities, Inc. 5,33% 03/06/2024	USD	100.000.000	100.000.000	0,17
<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					Citibank NA 5,33% 03/06/2024	USD	22.900.763	22.900.763	0,04
<b>Anleihen</b>					Citigroup Global Markets Holdings, Inc. 5,33% 03/06/2024	USD	520.000.000	520.000.000	0,90
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					Citigroup Global Markets Holdings, Inc. 5,33% 03/06/2024	USD	1.400.000.000	1.400.000.000	2,42
US Treasury Bill 0% 06/06/2024	USD	1.200.000.000	1.199.476.250	2,07	Daiwa Capital Markets America, Inc. 5,33% 03/06/2024	USD	500.000.000	500.000.000	0,86
US Treasury Bill 0% 25/06/2024	USD	600.000.000	598.088.750	1,03	Fixed Income Clearing Corporation 5,33% 03/06/2024	USD	4.500.000.000	4.500.000.000	7,78
US Treasury Bill 0% 18/07/2024	USD	1.750.180.000	1.739.003.820	3,01	HSBC Securities USA, Inc. 5,33% 03/06/2024	USD	50.000.000	50.000.000	0,09
US Treasury Bill 0% 25/07/2024	USD	900.000.000	893.474.000	1,55	HSBC Securities USA, Inc. 5,33% 03/06/2024	USD	175.000.000	175.000.000	0,30
US Treasury Bill 0% 01/08/2024	USD	600.000.000	595.098.083	1,03	Mizuho Securities USA LLC 5,33% 03/06/2024	USD	825.000.000	825.000.000	1,43
US Treasury Bill 0% 13/08/2024	USD	1.407.000.000	1.392.481.059	2,41					
US Treasury Bill 0% 15/08/2024	USD	300.000.000	296.918.792	0,51					
US Treasury Bill 0% 20/08/2024	USD	1.407.000.000	1.391.026.673	2,40					
US Treasury Bill 0% 27/08/2024	USD	1.106.000.000	1.092.294.618	1,89					
US Treasury Bill 0% 29/08/2024	USD	600.000.000	592.561.500	1,02					
US Treasury Bill 0% 03/09/2024	USD	288.000.000	284.140.338	0,49					
US Treasury Bill 0% 10/09/2024	USD	600.000.000	591.354.000	1,02					
US Treasury Bill 0% 12/09/2024	USD	300.000.000	295.696.979	0,51					
US Treasury Bill 0% 17/09/2024	USD	600.000.000	590.751.583	1,02					
US Treasury Bill 0% 19/09/2024	USD	600.000.000	590.780.446	1,02					
US Treasury Bill 0% 24/09/2024	USD	900.000.000	885.196.999	1,53					
US Treasury Bill 0% 26/09/2024	USD	600.000.000	590.215.417	1,02					
US Treasury Bill 0% 01/10/2024	USD	600.000.000	589.606.838	1,02					
US Treasury Bill 0% 10/10/2024	USD	600.000.000	588.986.626	1,02					
US Treasury Bill 0% 17/10/2024	USD	600.000.000	588.315.333	1,02					
US Treasury Bill 0% 24/10/2024	USD	549.000.000	537.743.209	0,93					
US Treasury Bill 0% 14/11/2024	USD	300.000.000	292.941.167	0,51					
US Treasury Bill 0% 21/11/2024	USD	215.000.000	209.724.608	0,36					
US Treasury Bill 0% 15/05/2025	USD	250.000.000	238.136.237	0,41					
			<b>16.664.013.325</b>	<b>28,80</b>					
<b>Anleihen insgesamt</b>			<b>16.664.013.325</b>	<b>28,80</b>					
<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>16.664.013.325</b>	<b>28,80</b>					
<b>Wertpapierbestand insgesamt</b>			<b>32.332.225.614</b>	<b>55,87</b>					

# JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund

Wertpapierbestand (Fortsetzung)

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Wells Fargo Securities LLC 5,33% 03/06/2024	USD	91.603.053	91.603.054	0,16
Wells Fargo Securities LLC 5,33% 03/06/2024	USD	900.000.000	900.000.000	1,55
			<b>9.285.174.817</b>	<b>16,05</b>
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>			<b>24.771.731.345</b>	<b>42,81</b>
<b>Bankguthaben</b>			<b>1.682.678.127</b>	<b>2,91</b>
<b>Andere Aktiva/(Passiva)</b>			<b>(921.109.011)</b>	<b>(1,59)</b>
<b>Nettovermögen insgesamt</b>			<b>57.865.526.075</b>	<b>100,00</b>

Geografische Aufteilung des Wertpapierbestandes zum 31. Mai 2024	% des Netto- vermögens
Vereinigte Staaten von Amerika	71,92
Norwegen	9,68
Deutschland	6,05
Frankreich	3,60
Kanada	2,77
Spanien	2,59
Japan	1,64
Großbritannien	0,43
<b>Wertpapierbestand insgesamt und geldnahe Anlagen</b>	<b>98,68</b>
Bankguthaben und andere Aktiva/(Passiva)	1,32
<b>Summe</b>	<b>100,00</b>



JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund

Wertpapierbestand

zum 31. Mai 2024

Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anlagen	Währung	Anzahl/ Nennwert	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<i>Kanada</i>					
<b>Anleihen</b>					Bank of Nova Scotia (The) 3,86% 03/06/2024					
<i>Frankreich</i>					EUR 28.000.000 28.000.000 5,01					
					<b>28.000.000 5,01</b>					
France Treasury Bill BTF, Reg. S 0% 31/07/2024	EUR	200.000	198.801	0,04	<i>Frankreich</i>					
France Treasury Bill BTF, Reg. S 0% 14/08/2024	EUR	45.000.000	44.664.496	7,99	Credit Agricole Corporate and Investment Bank SA 3,85% 03/06/2024					
France Treasury Bill BTF, Reg. S 0% 21/08/2024	EUR	200.000	198.387	0,04	Credit Agricole Corporate and Investment Bank SA 3,85% 03/06/2024					
France Treasury Bill BTF, Reg. S 0% 28/08/2024	EUR	20.000.000	19.823.266	3,55	EUR 50.000.000 50.000.000 8,95					
France Treasury Bill BTF, Reg. S 0% 16/10/2024	EUR	200.000	197.291	0,03	<b>77.000.000 13,78</b>					
France Treasury Bill BTF, Reg. S 0% 30/10/2024	EUR	200.000	197.041	0,03	<i>Großbritannien</i>					
France Treasury Bill BTF, Reg. S 0% 14/11/2024	EUR	25.200.000	24.787.504	4,44	Citigroup Global Markets Ltd. 3,87% 03/06/2024					
France Treasury Bill BTF, Reg. S 0% 27/11/2024	EUR	200.000	196.527	0,03	Citigroup Global Markets Ltd. 3,92% 03/06/2024					
				<b>90.263.313</b>	<b>16,15</b>	Natwest Markets Securities, Inc. 3,8% 03/06/2024				
<i>Supranational</i>					Natwest Markets Securities, Inc. 3,82% 03/06/2024					
European Stability Mechanism Treasury Bill 0% 18/07/2024	EUR	50.000	49.768	0,01	Standard Chartered Bank 3,85% 03/06/2024					
European Stability Mechanism Treasury Bill 0% 08/08/2024	EUR	200.000	198.643	0,04	EUR 1.000.000 1.000.000 0,18					
European Stability Mechanism Treasury Bill 0% 22/08/2024	EUR	200.000	198.361	0,04	<b>146.000.000 26,13</b>					
European Stability Mechanism Treasury Bill 0% 19/09/2024	EUR	200.000	197.815	0,04	<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>					
European Stability Mechanism Treasury Bill 0% 17/10/2024	EUR	200.000	197.281	0,03	Goldman Sachs International Bank 3,88% 03/06/2024					
European Stability Mechanism Treasury Bill 0% 21/11/2024	EUR	200.000	196.605	0,03	JPMorgan Chase Bank NA 3,6% 03/06/2024					
European Union Bill, Reg. S 0% 08/11/2024	EUR	20.000.000	19.684.562	3,52	JPMorgan Chase Bank NA 3,78% 03/06/2024					
				<b>20.723.035</b>	<b>3,71</b>	<b>93.000.000 16,64</b>				
<b>Anleihen insgesamt</b>					<b>424.000.000 75,87</b>					
<b>Börsennotierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>					<b>896.662 0,16</b>					
					<b>(20.750.211) (3,71)</b>					
					<b>558.806.121 100,00</b>					
<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>										
<b>Anleihen</b>										
<i>Finnland</i>										
Finland Treasury Bill, Reg. S 0% 13/11/2024	EUR	20.000.000	19.673.969	3,52						
				<b>19.673.969</b>	<b>3,52</b>					
<b>Anleihen insgesamt</b>					<b>19.673.969 3,52</b>					
<b>Commercial Papers</b>										
<i>Österreich</i>										
Republik Österreich 0% 03/06/2024	EUR	21.000.000	21.000.000	3,76						
Republik Österreich 0% 05/06/2024	EUR	3.000.000	2.999.353	0,54						
				<b>23.999.353</b>	<b>4,30</b>					
<b>Commercial Papers insgesamt</b>					<b>23.999.353 4,30</b>					
<b>An sonstigen geregelten Märkten gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt</b>					<b>43.673.322 7,82</b>					
<b>Wertpapierbestand insgesamt</b>					<b>154.659.670 27,68</b>					
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>										
<i>Australien</i>										
National Australia Bank Ltd. 3,8% 03/06/2024	EUR	80.000.000	80.000.000	14,31						
				<b>80.000.000</b>	<b>14,31</b>					

Geografische Aufteilung des Wertpapierbestandes zum 31. Mai 2024	% des Netto- vermögens
Frankreich	29,93
Großbritannien	26,13
Vereinigte Staaten von Amerika	16,64
Australien	14,31
Kanada	5,01
Österreich	4,30
Supranational	3,71
Finnland	3,52
<b>Wertpapierbestand insgesamt</b>	<b>103,55</b>
Bankguthaben und andere Aktiva/(Passiva)	(3,55)
<b>Summe</b>	<b>100,00</b>



# JPMorgan Liquidity Funds

## Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben

### 1. Gesamtkostenquoten

	Für den Zeitraum zum 31. Mai 2024 <sup>+</sup>	Für den Zeitraum zum 31. Mai 2024 <sup>++</sup>	Für das Geschäftsjahr zum 30. November 2023 <sup>+</sup>	Für das Geschäftsjahr zum 30. November 2022 <sup>+</sup>	Kostenquote mit Obergrenze 31. Mai 2024 <sup>+</sup>	Auflegungs- datum
<b>JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund</b>						
JPM AUD Liquidity LVNAV A (acc.)	0,55%	0,55%	0,55%	0,55%	-	12-Okt-10
JPM AUD Liquidity LVNAV Agency (dist.)	0,25%	0,25%	0,25%	0,25%	-	17-Mär-11
JPM AUD Liquidity LVNAV B (acc.)	0,45%	0,45%	0,45%	0,45%	-	12-Okt-10
JPM AUD Liquidity LVNAV C (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	12-Okt-10
JPM AUD Liquidity LVNAV C (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	04-Nov-15
JPM AUD Liquidity LVNAV E (acc.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	22-Jan-18
JPM AUD Liquidity LVNAV E (dist.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	22-Jan-18
JPM AUD Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	12-Okt-10
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund</b>						
JPM EUR Liquidity LVNAV A (acc.)	0,55%	0,55%	0,55%	0,55%	-	03-Dez-18
JPM EUR Liquidity LVNAV C (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	03-Dez-18
JPM EUR Liquidity LVNAV Capital (dist.)	0,16%	0,16%	0,16%	-	-	19-Jun-23
JPM EUR Liquidity LVNAV D (acc.)	0,65%	0,65%	0,65%	0,65%	-	03-Dez-18
JPM EUR Liquidity LVNAV E (acc.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	03-Dez-18
JPM EUR Liquidity LVNAV E (dist.)	0,11%	0,11%	0,11%	-	-	19-Jun-23
JPM EUR Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	-	-	19-Jun-23
JPM EUR Liquidity LVNAV Institutional (TO acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	24-Okt-12
JPM EUR Liquidity LVNAV W (acc.)	0,16%	0,16%	0,16%	-	-	03-Dez-18
JPM EUR Liquidity LVNAV W (dist.)	0,16%	0,16%	-	-	-	22-Apr-24
JPM EUR Liquidity LVNAV X (acc.)	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	03-Dez-18
JPM EUR Liquidity LVNAV X (dist.)	0,05%	0,05%	0,05%	-	0,05%	19-Jun-23
JPM EUR Liquidity LVNAV X (TO acc.)	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%	24-Okt-12
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund</b>						
JPM EUR Standard Money Market VNAV A (acc.)	0,55%	0,55%	0,55%	0,55%	-	25-Jul-22
JPM EUR Standard Money Market VNAV B (acc.)	0,45%	0,45%	0,45%	0,45%	-	25-Jul-22
JPM EUR Standard Money Market VNAV C (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	09-Jul-20
JPM EUR Standard Money Market VNAV Capital (acc.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	09-Jul-20
JPM EUR Standard Money Market VNAV D (acc.)	0,65%	0,65%	0,65%	0,65%	-	25-Jul-22
JPM EUR Standard Money Market VNAV E (acc.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	09-Jul-20
JPM EUR Standard Money Market VNAV Institutional (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	09-Jul-20
JPM EUR Standard Money Market VNAV R (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	09-Jul-20
JPM EUR Standard Money Market VNAV S (acc.)	0,06%	0,06%	0,06%	0,06%	-	09-Jul-20
JPM EUR Standard Money Market VNAV W (acc.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	09-Jul-20
JPM EUR Standard Money Market VNAV X (acc.)	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	09-Jul-20
<b>JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund</b>						
JPM SGD Liquidity LVNAV Agency (dist.)	0,25%	0,25%	0,25%	0,25%	-	07-Okt-09
JPM SGD Liquidity LVNAV C (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	29-Jan-10
JPM SGD Liquidity LVNAV C (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	04-Nov-15
JPM SGD Liquidity LVNAV E (acc.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	23-Jan-18
JPM SGD Liquidity LVNAV E (dist.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	23-Jan-18
JPM SGD Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	07-Okt-09

+ Berechnung der Kostenquoten erfolgt gemäß den Richtlinien vom 16. Mai 2008 (in der Fassung vom 20. April 2015) der Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA). Am 25. September 2020 erfolgte der Zusammenschluss der SFAMA und der Asset Management Plattform (AMP) Schweiz zur Asset Management Association Switzerland (AMAS). Die Gesamtkostenquote („TER“) stellt die gesamten Betriebskosten als Prozentsatz des durchschnittlichen täglichen Nettovermögens des Fonds dar. Die Gesamtbetriebskosten umfassen Verwaltungsgebühren, Verwahrungs-/Depotgebühren, Taxe d'abonnement und sonstige Aufwendungen, wie in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens dargestellt. Überziehungszinsen und an die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren sind von der Berechnung ausgeschlossen.

Die nach oben begrenzten Gebühren- und Kostenquoten einiger Aktienklassen haben sich unter Umständen im Verlauf der vorangegangenen zwei Jahre verändert. Alle diesbezüglichen Einzelheiten dieser Änderungen wurden in den Jahresabschlüssen der vorangegangenen Jahre offengelegt. Alle TER-Daten sind auf Jahresbasis angegeben. Diese Zahlen enthalten den Honorarverzicht für Managementgebühren bzw. Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen, die gegebenenfalls den im Verkaufsprospekt festgelegten Höchstsatz nicht überschreiten.

++ Es liegt im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft auf die Bestandsvergütungsgebühr, wo zutreffend, ganz oder teilweise zu verzichten.

# JPMorgan Liquidity Funds

## Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben (Fortsetzung)

### 1. Gesamtkostenquoten (Fortsetzung)

	Für den Zeitraum zum 31. Mai 2024 <sup>+</sup>	Für den Zeitraum zum 31. Mai 2024 <sup>++</sup>	Für das Geschäftsjahr zum 30. November 2023 <sup>+</sup>	Für das Geschäftsjahr zum 30. November 2022 <sup>+</sup>	Kostenquote mit Obergrenze 31. Mai 2024 <sup>+</sup>	Auflegungs- datum
<b>JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund</b>						
JPM GBP Liquidity LVNAV A (acc.)	0,55%	0,55%	0,55%	0,55%	-	03-Dez-18
JPM GBP Liquidity LVNAV Agency (dist.)	0,25%	0,25%	0,25%	0,25%	-	04-Sep-01
JPM GBP Liquidity LVNAV C (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	03-Dez-18
JPM GBP Liquidity LVNAV C (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	04-Nov-15
JPM GBP Liquidity LVNAV Capital (dist.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	25-Sep-06
JPM GBP Liquidity LVNAV D (acc.)	0,65%	0,65%	0,65%	0,65%	-	03-Dez-18
JPM GBP Liquidity LVNAV E (acc.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	03-Dez-18
JPM GBP Liquidity LVNAV E (dist.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	23-Jan-18
JPM GBP Liquidity LVNAV G (acc.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	03-Dez-18
JPM GBP Liquidity LVNAV G (dist.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	23-Jan-18
JPM GBP Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	04-Sep-00
JPM GBP Liquidity LVNAV Premier (dist.)	0,45%	0,45%	0,45%	0,45%	-	04-Apr-00
JPM GBP Liquidity LVNAV R (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	03-Dez-18
JPM GBP Liquidity LVNAV R (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	14-Jun-13
JPM GBP Liquidity LVNAV Reserves (dist.)	0,79%	0,79%	0,79%	0,79%	-	01-Jul-03
JPM GBP Liquidity LVNAV W (acc.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	03-Dez-18
JPM GBP Liquidity LVNAV W (dist.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	28-Dez-16
JPM GBP Liquidity LVNAV X (acc.)	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	03-Dez-18
JPM GBP Liquidity LVNAV X (dist.)	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%	04-Nov-99
<b>JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund</b>						
JPM GBP Standard Money Market VNAV A (acc.)	0,55%	0,55%	0,55%	0,55%	-	15-Apr-96
JPM GBP Standard Money Market VNAV B (acc.)	0,45%	0,45%	0,45%	0,45%	-	10-Apr-01
JPM GBP Standard Money Market VNAV C (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	26-Mai-99
JPM GBP Standard Money Market VNAV Capital (acc.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	29-Mär-18
JPM GBP Standard Money Market VNAV D (acc.)	0,65%	0,65%	0,65%	0,65%	-	07-Mai-08
JPM GBP Standard Money Market VNAV E (acc.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	23-Jan-18
JPM GBP Standard Money Market VNAV Institutional (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	04-Nov-15
JPM GBP Standard Money Market VNAV Morgan (acc.)	0,59%	0,59%	0,59%	0,59%	-	03-Aug-22
JPM GBP Standard Money Market VNAV R (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	14-Jun-13
JPM GBP Standard Money Market VNAV W (acc.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	28-Dez-16
JPM GBP Standard Money Market VNAV X (acc.)	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	23-Mai-00
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund</b>						
JPM USD Liquidity LVNAV A (acc.)	0,55%	0,55%	0,55%	0,55%	-	03-Dez-18
JPM USD Liquidity LVNAV Agency (dist.)	0,25%	0,25%	0,25%	0,25%	-	04-Sep-01
JPM USD Liquidity LVNAV C (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	03-Dez-18
JPM USD Liquidity LVNAV C (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	05-Nov-15
JPM USD Liquidity LVNAV Capital (acc.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	14-Aug-19
JPM USD Liquidity LVNAV Capital (dist.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	22-Sep-16
JPM USD Liquidity LVNAV D (acc.)	0,65%	0,65%	0,65%	0,65%	-	03-Dez-18
JPM USD Liquidity LVNAV E (acc.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	03-Dez-18
JPM USD Liquidity LVNAV E (dist.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	22-Jan-18
JPM USD Liquidity LVNAV G (acc.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	03-Dez-18
JPM USD Liquidity LVNAV G (dist.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	22-Jan-18
JPM USD Liquidity LVNAV Institutional (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	03-Dez-18
JPM USD Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	22-Dez-99
JPM USD Liquidity LVNAV Morgan (dist.)	0,59%	0,59%	0,59%	0,59%	-	18-Apr-02
JPM USD Liquidity LVNAV Premier (dist.)	0,45%	0,45%	0,45%	0,45%	-	27-Apr-00
JPM USD Liquidity LVNAV R (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	-	-	03-Dez-18
JPM USD Liquidity LVNAV R (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	13-Jun-13
JPM USD Liquidity LVNAV Reserves (dist.)	0,79%	0,79%	0,79%	0,79%	-	13-Jun-02
JPM USD Liquidity LVNAV W (acc.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	03-Dez-18
JPM USD Liquidity LVNAV W (dist.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	29-Dez-16
JPM USD Liquidity LVNAV X (dist.)	0,02%	0,02%	0,02%	0,02%	0,02%	26-Sep-00

+ Berechnung der Kostenquoten erfolgt gemäß den Richtlinien vom 16. Mai 2008 (in der Fassung vom 20. April 2015) der Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA). Am 25. September 2020 erfolgte der Zusammenschluss der SFAMA und der Asset Management Plattform (AMP) Schweiz zur Asset Management Association Switzerland (AMAS). Die Gesamtkostenquote („TER“) stellt die gesamten Betriebskosten als Prozentsatz des durchschnittlichen täglichen Nettovermögens des Fonds dar. Die Gesamtbetriebskosten umfassen Verwaltungsgebühren, Verwahrungs-/Depotgebühren, Taxe d'abonnement und sonstige Aufwendungen, wie in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens dargestellt. Überziehungszinsen und an die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren sind von der Berechnung ausgeschlossen.

Die nach oben begrenzten Gebühren- und Kostenquoten einiger Aktienklassen haben sich unter Umständen im Verlauf der vorangegangenen zwei Jahre verändert. Alle diesbezüglichen Einzelheiten dieser Änderungen wurden in den Jahresabschlüssen der vorangegangenen Jahre offengelegt. Alle TER-Daten sind auf Jahresbasis angegeben. Diese Zahlen enthalten den Honorarverzicht für Managementgebühren bzw. Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen, die gegebenenfalls den im Verkaufsprospekt festgelegten Höchstsatz nicht überschreiten.

++ Es liegt im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft auf die Bestandsvergütungsgebühr, wo zutreffend, ganz oder teilweise zu verzichten.

# JPMorgan Liquidity Funds

## Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben (Fortsetzung)

### 1. Gesamtkostenquoten (Fortsetzung)

	Für den Zeitraum zum 31. Mai 2024 <sup>+</sup>	Für den Zeitraum zum 31. Mai 2024 <sup>++</sup>	Für das Geschäftsjahr zum 30. November 2023 <sup>+</sup>	Für das Geschäftsjahr zum 30. November 2022 <sup>+</sup>	Kostenquote mit Obergrenze 31. Mai 2024 <sup>+</sup>	Auflegungs- datum
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund</b>						
JPM USD Standard Money Market VNAV A (acc.)	0,55%	0,55%	0,55%	0,55%	-	12-Jan-87
JPM USD Standard Money Market VNAV B (acc.)	0,45%	0,45%	0,45%	0,45%	-	16-Okt-00
JPM USD Standard Money Market VNAV C (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	03-Mär-98
JPM USD Standard Money Market VNAV Capital (acc.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	14-Nov-22
JPM USD Standard Money Market VNAV D (acc.)	0,65%	0,65%	0,65%	0,65%	-	07-Jan-09
JPM USD Standard Money Market VNAV E (acc.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	22-Jan-18
JPM USD Standard Money Market VNAV G (acc.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	22-Jan-18
JPM USD Standard Money Market VNAV Institutional (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	05-Nov-15
JPM USD Standard Money Market VNAV R (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	13-Jun-13
JPM USD Standard Money Market VNAV W (acc.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	28-Dez-16
JPM USD Standard Money Market VNAV X (acc.)	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	19-Dez-97
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund</b>						
JPM USD Treasury CNAV A (acc.)	0,55%	0,55%	0,55%	0,55%	-	03-Dez-18
JPM USD Treasury CNAV Agency (dist.)	0,25%	0,25%	0,25%	0,25%	-	22-Okt-03
JPM USD Treasury CNAV C (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	03-Dez-18
JPM USD Treasury CNAV C (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	05-Nov-15
JPM USD Treasury CNAV Capital (acc.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	03-Dez-18
JPM USD Treasury CNAV Capital (dist.)	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	-	24-Jul-19
JPM USD Treasury CNAV D (acc.)	0,65%	0,65%	0,65%	0,65%	-	03-Dez-18
JPM USD Treasury CNAV E (acc.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	03-Dez-18
JPM USD Treasury CNAV E (dist.)	0,11%	0,11%	0,11%	0,11%	-	22-Jan-18
JPM USD Treasury CNAV Institutional (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	03-Dez-18
JPM USD Treasury CNAV Institutional (dist.)	0,21%	0,21%	0,21%	0,21%	-	22-Okt-03
JPM USD Treasury CNAV Morgan (dist.)	0,59%	0,59%	0,59%	0,59%	-	22-Okt-03
JPM USD Treasury CNAV Premier (dist.)	0,45%	0,45%	0,45%	0,45%	-	22-Okt-03
JPM USD Treasury CNAV R (acc.)	0,21%	0,21%	0,21%	-	-	03-Dez-18
JPM USD Treasury CNAV Reserves (dist.)	0,79%	0,79%	0,79%	0,79%	-	03-Okt-05
JPM USD Treasury CNAV W (acc.)	0,16%	0,16%	0,16%	-	-	22-Mai-23
JPM USD Treasury CNAV X (dist.)	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	22-Okt-03
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)</b>						
JPM EUR Government CNAV C (acc.)	0,21%	0,21%	-	-	-	13-Mai-24
JPM EUR Government CNAV Capital (dist.)	0,16%	0,16%	-	-	-	13-Mai-24
JPM EUR Government CNAV E (dist.)	0,11%	0,11%	-	-	-	13-Mai-24
JPM EUR Government CNAV G (dist.)	0,11%	0,11%	-	-	-	13-Mai-24
JPM EUR Government CNAV Institutional (dist.)	0,21%	0,21%	-	-	-	13-Mai-24
JPM EUR Government CNAV S (dist.)	0,06%	0,06%	-	-	-	13-Mai-24
JPM EUR Government CNAV W (TO acc.)	0,16%	0,16%	-	-	-	13-Mai-24
JPM EUR Government CNAV X (dist.)	0,05%	0,05%	-	-	0,05%	13-Mai-24

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

+ Berechnung der Kostenquoten erfolgt gemäß den Richtlinien vom 16. Mai 2008 (in der Fassung vom 20. April 2015) der Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA). Am 25. September 2020 erfolgte der Zusammenschluss der SFAMA und der Asset Management Plattform (AMP) Schweiz zur Asset Management Association Switzerland (AMAS). Die Gesamtkostenquote („TER“) stellt die gesamten Betriebskosten als Prozentsatz des durchschnittlichen täglichen Nettovermögens des Fonds dar. Die Gesamtbetriebskosten umfassen Verwaltungsgebühren, Verwahrungs-/Depotgebühren, Taxe d'abonnement und sonstige Aufwendungen, wie in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens dargestellt. Überziehungszinsen und an die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren sind von der Berechnung ausgeschlossen.

Die nach oben begrenzten Gebühren- und Kostenquoten einiger Aktienklassen haben sich unter Umständen im Verlauf der vorangegangenen zwei Jahre verändert. Alle diesbezüglichen Einzelheiten dieser Änderungen wurden in den Jahresabschlüssen der vorangegangenen Jahre offengelegt. Alle TER-Daten sind auf Jahresbasis angegeben. Diese Zahlen enthalten den Honorarverzicht für Managementgebühren bzw. Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen, die gegebenenfalls den im Verkaufsprospekt festgelegten Höchstsatz nicht überschreiten.

++ Es liegt im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft auf die Bestandsvergütungsgebühr, wo zutreffend, ganz oder teilweise zu verzichten.

## 2. Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds

Die Teilfonds erzielen in der Referenzwährung entsprechend den vorherrschenden Sätzen am Geldmarkt eine Rendite und versuchen gleichzeitig, das Kapital im Einklang mit solchen Sätzen zu erhalten und einen hohen Liquiditätsgrad zu erlangen.

## 3. Wertentwicklung und Volatilität†

### Wertentwicklung

Die Gesamterrendite für Zeiträume von mehr als einem Jahr wird auf Jahresbasis angegeben. Die Wertentwicklung der SICAV versteht sich einschließlich der Wiederanlage der Erträge und abzüglich aller Aufwendungen.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Hinweis auf die aktuelle oder künftige Wertentwicklung.

Die Wertentwicklungsdaten berücksichtigen keine Provisionen und Kosten, die mit der Ausgabe und Rücknahme von Aktien entstehen.

### Volatilität

Die Standardabweichung (D) des Kurses wird während des gesamten Geschäftsjahres der SICAV täglich berechnet.

Die nachstehenden Angaben beziehen sich auf den Berichtszeitraum vom 1. Dezember 2023 bis zum 31. Mai 2024.

Ist D kleiner oder gleich 0,1, besteht eine niedrige Volatilität.

Ist D größer als 0,1, aber kleiner oder gleich 1,0, besteht eine mittlere Volatilität.

Ist D größer als 1,0, aber kleiner oder gleich 2,4, besteht eine hohe Volatilität.

Ist D größer als 2,4, besteht eine sehr hohe Volatilität.

Aktienklasse	Basiswährung	3 Monate	6 Monate	9 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	Volatilität
<b>JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund</b>								
JPM AUD Liquidity LVNAV A (acc.)	AUD	0,99%	1,97%	2,88%	3,82%	3,00%	1,98%	Niedrig
JPM AUD Liquidity LVNAV Agency (dist.)	AUD	1,01%	2,00%	2,96%	5,29%	2,65%	1,79%	Niedrig
JPM AUD Liquidity LVNAV B (acc.)	AUD	1,01%	2,02%	2,96%	3,92%	3,11%	2,05%	Niedrig
JPM AUD Liquidity LVNAV C (acc.)	AUD	1,08%	2,14%	3,15%	4,17%	3,36%	2,22%	Niedrig
JPM AUD Liquidity LVNAV C (dist.)	AUD	1,02%	1,67%	1,67%	2,46%	1,24%	0,85%	Niedrig
JPM AUD Liquidity LVNAV E (acc.)	AUD	1,10%	2,19%	3,22%	4,28%	3,47%	-	Niedrig
JPM AUD Liquidity LVNAV E (dist.)	AUD	1,05%	1,71%	1,71%	2,55%	1,29%	0,90%	Niedrig
JPM AUD Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	AUD	-	3,19%	3,19%	3,98%	1,99%	1,35%	Niedrig
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund</b>								
JPM EUR Liquidity LVNAV A (acc.)	EUR	0,89%	1,77%	2,63%	3,41%	-	-	Niedrig
JPM EUR Liquidity LVNAV C (acc.)	EUR	0,98%	1,94%	2,90%	3,77%	2,48%	1,41%	Niedrig
JPM EUR Liquidity LVNAV Capital (dist.)	EUR	0,95%	1,24%	1,96%	-	-	-	Niedrig
JPM EUR Liquidity LVNAV D (acc.)	EUR	0,86%	1,72%	2,55%	3,31%	-	-	Niedrig
JPM EUR Liquidity LVNAV E (acc.)	EUR	1,00%	1,99%	2,97%	3,87%	2,56%	1,46%	Niedrig
JPM EUR Liquidity LVNAV E (dist.)	EUR	0,96%	1,25%	1,99%	-	-	-	Niedrig
JPM EUR Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	EUR	-	0,28%	1,00%	-	-	-	Niedrig
JPM EUR Liquidity LVNAV Institutional (TO acc.)	EUR	0,98%	1,94%	2,90%	3,77%	2,48%	1,41%	Niedrig
JPM EUR Liquidity LVNAV W (acc.)	EUR	0,99%	1,97%	2,95%	3,82%	-	-	Niedrig
JPM EUR Liquidity LVNAV W (dist.)+	EUR	-	-	-	-	-	-	Niedrig
JPM EUR Liquidity LVNAV X (acc.)	EUR	1,02%	2,03%	3,02%	3,93%	2,62%	1,52%	Niedrig
JPM EUR Liquidity LVNAV X (dist.)	EUR	0,98%	1,26%	2,02%	-	-	-	Niedrig
JPM EUR Liquidity LVNAV X (TO acc.)	EUR	1,02%	2,04%	3,04%	3,96%	2,64%	1,54%	Niedrig
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund</b>								
JPM EUR Standard Money Market VNAV A (acc.)	EUR	0,90%	1,81%	2,70%	3,52%	-	-	Niedrig
JPM EUR Standard Money Market VNAV B (acc.)	EUR	0,93%	1,87%	2,78%	3,62%	-	-	Niedrig
JPM EUR Standard Money Market VNAV C (acc.)	EUR	0,99%	1,99%	2,96%	3,85%	2,55%	1,48%	Niedrig
JPM EUR Standard Money Market VNAV Capital (acc.)	EUR	1,02%	2,04%	3,02%	3,92%	2,58%	1,50%	Niedrig
JPM EUR Standard Money Market VNAV D (acc.)	EUR	0,87%	1,76%	2,62%	3,42%	-	-	Niedrig
JPM EUR Standard Money Market VNAV E (acc.)	EUR	1,01%	2,04%	3,04%	3,94%	2,59%	1,51%	Niedrig
JPM EUR Standard Money Market VNAV Institutional (acc.)	EUR	0,99%	1,99%	2,96%	3,85%	2,55%	1,48%	Niedrig
JPM EUR Standard Money Market VNAV R (acc.)	EUR	0,99%	1,99%	2,96%	3,85%	2,55%	1,48%	Niedrig
JPM EUR Standard Money Market VNAV S (acc.)	EUR	1,03%	2,07%	3,08%	3,99%	2,62%	1,54%	Niedrig
JPM EUR Standard Money Market VNAV W (acc.)	EUR	1,00%	2,02%	3,00%	3,89%	2,57%	1,49%	Niedrig
JPM EUR Standard Money Market VNAV X (acc.)	EUR	1,03%	2,07%	3,09%	4,00%	2,63%	1,87%	Niedrig
<b>JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund</b>								
JPM SGD Liquidity LVNAV Agency (dist.)	SGD	0,86%	1,72%	2,65%	5,32%	2,73%	1,83%	Niedrig
JPM SGD Liquidity LVNAV C (acc.)	SGD	0,90%	1,78%	2,67%	3,65%	3,26%	2,22%	Niedrig
JPM SGD Liquidity LVNAV C (dist.)	SGD	0,87%	1,74%	2,68%	5,39%	2,78%	1,87%	Niedrig
JPM SGD Liquidity LVNAV E (acc.)	SGD	0,93%	1,84%	2,75%	3,75%	3,36%	-	Niedrig
JPM SGD Liquidity LVNAV E (dist.)	SGD	0,90%	1,78%	2,75%	5,56%	2,86%	-	Niedrig
JPM SGD Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	SGD	-	0,86%	1,81%	4,52%	2,29%	1,54%	Niedrig

+ Für diese Aktienklassen sind keine Daten verfügbar, weil sie innerhalb von 3 Monaten vor dem Ende des Berichtszeitraums aufgelegt bzw. reaktiviert wurden.

† Gemäß dem Verhaltenskodex der Institutional Money Market Fund Association („IMMFA“) kann die Verwaltungsgesellschaft beschließen, realisierte Gewinne oder Verluste über einen Zeitraum, der die dreimonatigen IMMFA-Empfehlung nicht überschreitet, erfolgswirksam zu glätten.

## JPMorgan Liquidity Funds

Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben (Fortsetzung)

### 3. Wertentwicklung und Volatilität<sup>†</sup> (Fortsetzung)

Aktienklasse	Basiswährung	3 Monate	6 Monate	9 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	Volatilität
<b>JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund</b>								
JPM GBP Liquidity LVNAV A (acc.)	GBP	1,21%	2,42%	3,70%	4,87%	-	-	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV Agency (dist.)	GBP	1,27%	2,11%	2,11%	2,90%	1,51%	1,01%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV C (acc.)	GBP	1,30%	2,60%	3,96%	5,23%	4,03%	2,72%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV C (dist.)	GBP	1,28%	2,13%	2,13%	2,93%	1,54%	1,03%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV Capital (dist.)	GBP	1,29%	2,15%	2,15%	2,97%	1,57%	1,05%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV D (acc.)	GBP	1,18%	2,37%	3,62%	4,76%	-	-	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV E (acc.)	GBP	1,32%	2,65%	4,04%	5,33%	4,13%	2,80%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV E (dist.)	GBP	1,30%	2,17%	2,17%	3,01%	1,60%	1,08%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV G (acc.)	GBP	1,32%	2,65%	4,04%	5,33%	4,13%	2,80%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV G (dist.)	GBP	1,30%	2,17%	2,17%	3,01%	1,60%	1,08%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	GBP	-	0,85%	0,85%	1,66%	0,83%	0,56%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV Premier (dist.)	GBP	1,22%	2,03%	2,03%	2,74%	1,41%	0,94%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV R (acc.)	GBP	1,30%	2,60%	3,98%	5,23%	-	-	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV R (dist.)	GBP	1,28%	2,13%	2,13%	2,93%	1,54%	1,03%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV Reserves (dist.)	GBP	1,13%	1,89%	1,89%	2,46%	1,23%	0,82%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV W (acc.)	GBP	1,31%	2,62%	4,00%	5,28%	4,08%	2,76%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV W (dist.)	GBP	1,29%	2,15%	2,15%	2,97%	1,57%	1,05%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV X (acc.)	GBP	1,34%	2,68%	4,09%	5,40%	4,19%	2,86%	Niedrig
JPM GBP Liquidity LVNAV X (dist.)	GBP	1,32%	2,20%	2,20%	3,08%	1,66%	1,14%	Niedrig
<b>JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund</b>								
JPM GBP Standard Money Market VNAV A (acc.)	GBP	1,20%	2,45%	3,83%	5,00%	3,71%	2,47%	Niedrig
JPM GBP Standard Money Market VNAV B (acc.)	GBP	1,23%	2,51%	3,91%	5,11%	3,81%	2,55%	Niedrig
JPM GBP Standard Money Market VNAV C (acc.)	GBP	1,29%	2,63%	4,09%	5,36%	4,07%	2,75%	Niedrig
JPM GBP Standard Money Market VNAV Capital (acc.)	GBP	1,31%	2,66%	4,13%	5,41%	-	-	Niedrig
JPM GBP Standard Money Market VNAV D (acc.)	GBP	1,18%	2,40%	3,75%	4,89%	3,60%	2,39%	Niedrig
JPM GBP Standard Money Market VNAV E (acc.)	GBP	1,32%	2,68%	4,17%	5,47%	4,18%	2,84%	Niedrig
JPM GBP Standard Money Market VNAV Institutional (acc.)	GBP	1,29%	2,63%	4,09%	5,36%	-	-	Niedrig
JPM GBP Standard Money Market VNAV Morgan (acc.)	GBP	1,19%	2,43%	3,80%	4,96%	-	-	Niedrig
JPM GBP Standard Money Market VNAV R (acc.)	GBP	1,29%	2,63%	4,09%	5,36%	4,07%	2,75%	Niedrig
JPM GBP Standard Money Market VNAV W (acc.)	GBP	1,31%	2,66%	4,13%	5,41%	4,13%	2,80%	Niedrig
JPM GBP Standard Money Market VNAV X (acc.)	GBP	1,45%	2,84%	4,35%	5,66%	4,32%	2,95%	Niedrig
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund</b>								
JPM USD Liquidity LVNAV A (acc.)	USD	1,26%	2,53%	3,84%	5,14%	4,25%	2,84%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV Agency (dist.)	USD	1,31%	2,64%	3,94%	7,39%	3,73%	2,52%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV C (acc.)	USD	1,34%	2,70%	4,11%	5,50%	4,62%	3,11%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV C (dist.)	USD	1,32%	2,66%	3,97%	7,45%	3,78%	2,55%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV Capital (acc.)	USD	1,36%	2,73%	4,15%	5,55%	-	-	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV Capital (dist.)	USD	1,34%	2,69%	4,01%	7,54%	3,83%	2,60%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV D (acc.)	USD	1,23%	2,48%	3,76%	5,03%	-	-	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV E (acc.)	USD	1,37%	2,76%	4,19%	5,61%	4,73%	3,19%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV E (dist.)	USD	1,35%	2,71%	4,04%	7,63%	3,88%	2,65%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV G (acc.)	USD	1,37%	2,76%	4,19%	5,61%	4,73%	3,19%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV G (dist.)	USD	1,35%	2,71%	4,04%	7,63%	3,88%	2,65%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV Institutional (acc.)	USD	1,34%	2,70%	4,11%	5,50%	4,62%	3,11%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV Institutional (dist.)	USD	-	1,34%	2,65%	6,13%	3,07%	2,08%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV Morgan (dist.)	USD	1,23%	2,47%	3,69%	6,79%	3,41%	2,28%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV Premier (dist.)	USD	1,26%	2,54%	3,79%	7,04%	3,54%	2,37%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV R (acc.)	USD	1,34%	2,70%	4,13%	5,50%	-	-	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV R (dist.)	USD	1,32%	2,66%	3,97%	7,46%	3,77%	2,55%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV Reserves (dist.)	USD	1,18%	2,38%	3,54%	6,44%	3,23%	2,16%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV W (acc.)	USD	1,36%	2,73%	4,15%	5,55%	4,68%	3,15%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV W (dist.)	USD	1,34%	2,69%	4,01%	7,54%	3,82%	2,59%	Niedrig
JPM USD Liquidity LVNAV X (dist.)	USD	1,37%	2,76%	4,11%	7,79%	4,01%	2,76%	Niedrig
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund</b>								
JPM USD Standard Money Market VNAV A (acc.)	USD	1,27%	2,59%	3,99%	5,34%	4,37%	2,92%	Niedrig
JPM USD Standard Money Market VNAV B (acc.)	USD	1,29%	2,64%	4,07%	5,45%	4,48%	2,99%	Niedrig
JPM USD Standard Money Market VNAV C (acc.)	USD	1,35%	2,77%	4,26%	5,70%	4,75%	3,19%	Niedrig
JPM USD Standard Money Market VNAV Capital (acc.)	USD	1,37%	2,79%	4,30%	5,75%	-	-	Niedrig
JPM USD Standard Money Market VNAV D (acc.)	USD	1,24%	2,54%	3,91%	5,23%	4,27%	2,84%	Niedrig
JPM USD Standard Money Market VNAV E (acc.)	USD	1,38%	2,82%	4,34%	5,81%	4,86%	3,28%	Niedrig
JPM USD Standard Money Market VNAV G (acc.)	USD	1,38%	2,82%	4,34%	5,81%	4,86%	3,28%	Niedrig
JPM USD Standard Money Market VNAV Institutional (acc.)	USD	1,35%	2,77%	4,26%	5,70%	4,75%	3,19%	Niedrig
JPM USD Standard Money Market VNAV R (acc.)	USD	1,35%	2,77%	4,26%	5,70%	4,75%	3,19%	Niedrig
JPM USD Standard Money Market VNAV W (acc.)	USD	1,37%	2,79%	4,30%	5,75%	4,80%	3,23%	Niedrig
JPM USD Standard Money Market VNAV X (acc.)	USD	1,40%	2,85%	4,39%	5,87%	4,92%	3,34%	Niedrig

<sup>†</sup> Gemäß dem Verhaltenskodex der Institutional Money Market Fund Association („IMMFA“) kann die Verwaltungsgesellschaft beschließen, realisierte Gewinne oder Verluste über einen Zeitraum, der die dreimonatigen IMMFA-Empfehlung nicht überschreitet, erfolgswirksam zu glätten.

## JPMorgan Liquidity Funds

Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben (Fortsetzung)

### 3. Wertentwicklung und Volatilität<sup>†</sup> (Fortsetzung)

Aktienklasse	Basiswährung	3 Monate	6 Monate	9 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	Volatilität
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund</b>								
JPM USD Treasury CNAV A (acc.)	USD	1,24%	2,47%	3,71%	4,94%	-	-	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV Agency (dist.)	USD	1,26%	2,55%	3,80%	6,94%	3,50%	2,34%	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV C (acc.)	USD	1,33%	2,64%	3,98%	5,30%	4,36%	2,94%	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV C (dist.)	USD	1,27%	2,57%	3,83%	7,03%	3,56%	2,38%	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV Capital (acc.)	USD	1,34%	2,67%	4,02%	5,35%	4,42%	2,98%	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV Capital (dist.)	USD	1,29%	2,59%	3,87%	7,12%	3,60%	2,41%	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV D (acc.)	USD	1,22%	2,41%	3,63%	4,83%	-	-	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV E (acc.)	USD	1,36%	2,69%	4,06%	5,41%	-	-	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV E (dist.)	USD	1,30%	2,62%	3,90%	7,21%	3,65%	2,45%	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV Institutional (acc.)	USD	1,33%	2,64%	3,98%	5,30%	-	-	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV Institutional (dist.)	USD	-	1,29%	2,56%	5,76%	2,88%	1,93%	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV Morgan (dist.)	USD	1,18%	2,38%	3,55%	6,35%	3,18%	2,12%	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV Premier (dist.)	USD	1,21%	2,45%	3,65%	6,60%	3,31%	2,21%	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV R (acc.)	USD	1,33%	2,64%	3,99%	5,30%	-	-	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV Reserves (dist.)	USD	1,13%	2,28%	3,40%	6,00%	3,01%	2,01%	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV W (acc.)	USD	1,34%	2,67%	4,02%	5,35%	-	-	Niedrig
JPM USD Treasury CNAV X (dist.)	USD	1,31%	2,64%	3,95%	7,29%	3,70%	2,50%	Niedrig
<b>JPMorgan Liquidity Funds -EUR Government CNAV Fund (1)</b>								
JPM EUR Government CNAV C (acc.)+	EUR	-	-	-	-	-	-	Niedrig
JPM EUR Government CNAV Capital (dist.)+	EUR	-	-	-	-	-	-	Niedrig
JPM EUR Government CNAV E (dist.)+	EUR	-	-	-	-	-	-	Niedrig
JPM EUR Government CNAV G (dist.)+	EUR	-	-	-	-	-	-	Niedrig
JPM EUR Government CNAV Institutional (dist.)+	EUR	-	-	-	-	-	-	Niedrig
JPM EUR Government CNAV S (dist.)+	EUR	-	-	-	-	-	-	Niedrig
JPM EUR Government CNAV W (TO acc.)+	EUR	-	-	-	-	-	-	Niedrig
JPM EUR Government CNAV X (dist.)+	EUR	-	-	-	-	-	-	Niedrig

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

+ Für diese Aktienklassen sind keine Daten verfügbar, weil sie innerhalb von 3 Monaten vor dem Ende des Geschäftsjahres aufgelegt bzw. reaktiviert wurden.

† Gemäß dem Verhaltenskodex der Institutional Money Market Fund Association („IMMFA“) kann die Verwaltungsgesellschaft beschließen, realisierte Gewinne oder Verluste über einen Zeitraum, der die dreimonatigen IMMFA-Empfehlung nicht überschreitet, erfolgswirksam zu glätten.

### 4. Haben- und Sollzinssätze auf Bankkonten

#### Grundlage der Bankzinssätze

Die Zinssätze beruhen auf den Treasury-Sätzen von JPMorgan Chase und können sich deshalb täglich ändern. Die Bankzinsen auf die Bankguthaben des Vormonats werden monatlich am dritten Geschäftstag des Folgemonats auf den jeweiligen Bankkonten der SICAV verbucht.

### 5. Portfolio Turnover Ratio

Die Portfolio Turnover Ratio ist ein Hinweis auf die Relevanz der Zusatzkosten, die dem Fonds beim Kauf und Verkauf von Wertpapieranlagen gemäß dieser Anlagepolitik entstehen. Die Portfolio Turnover Ratio wird wie folgt berechnet:

$$\frac{\text{(Gesamte Wertpapierkäufe und -verkäufe - Gesamte Zeichnung und Rücknahme von Teilfondsaktien)}}{\text{Durchschnittliche Nettoinventarwerte des Teilfonds in der Teilfondswährung}}$$

Die Portfolio Turnover Ratio wird als Prozentzahl angegeben. Da die zugrunde liegenden Vermögensanlagen kurzfristige Fälligkeiten haben und da sie lediglich bei Fälligkeit ersetzt werden, wird keine Portfolio Turnover Ratio für die SICAV errechnet.

### 6. Berechnung des Risikopotenzials

Die Methodik für alle Teilfonds der JPMorgan Liquidity Funds zur Berechnung des weltweiten Risikos ist der Commitmentansatz in Übereinstimmung mit CSSF-Rundschreiben 11/512.



## JPMorgan Liquidity Funds

### Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben (Fortsetzung)

#### 7. Erhaltene Sicherheiten

##### Für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhaltene Sicherheiten:

Beschreibung der Sicherheit	Gegenpartei	Währung	Wert der erhaltenen Sicherheit (in Teilfonds-Währung)
<b>JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund</b>			
Australia Government Bond 2032 to 2035; 1,75% to 2,75%	BNP Paribas	AUD	51.236.463
Australia Government Bond 2034 to 2035; 2,75% to 3,75%	National Australia Bank	AUD	152.071.203
Australia Government Bond 2026 to 2051; 0,5% to 3,75%	RBC Sydney	AUD	152.775.917
Australia Government Bond 2033; 4,5%	Standard Chartered Bank London	AUD	102.318.036
			<b>458.401.619</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund</b>			
UK Treasury 2028; 3,125%	Bank Of Montreal	EUR	65.000.000
UK Treasury 2028; 3,125%	Bank Of Montreal	EUR	65.000.000
Italy Government Bond 2029 to 2072; 2,15% to 3,35%	Bank Of Nova Scotia	EUR	47.225.561
Spain Government Bond 2024 to 2052; 0% to 6%	Bank Of Nova Scotia	EUR	344.904.849
Spain Government Bond 2026 to 2043; 0,8% to 6%	Bank Of Nova Scotia	EUR	204.000.000
Belgium Government Bond 2034 to 2055; 2,85% to 3,5%	Bank Of Nova Scotia	EUR	16.251.226
France Treasury 2034 to 2038; 0,1% to 1,25%	Bank Of Nova Scotia	EUR	22.058.367
Italy Government Bond 2025 to 2072; 0,15% to 5%	BofA Securities Europe	EUR	265.200.084
Italy Government Bond 2034 to 2067; 0,15% to 5%	BofA Securities Europe	EUR	135.515.337
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2026; 2,5%	BofA Securities Europe	EUR	17.484.822
Italy Government Bond 2024 to 2052; 0,95% to 5,75%	Citigroup Global Markets Ltd	EUR	661.107.598
Spain Government Bond 2032; 2,55%	Citigroup Global Markets Ltd	EUR	71.208
Grand Duchy of Luxembourg 2030 to 2031; 0%	Citigroup Global Markets Ltd	EUR	38.721
UK Treasury 2027 to 2053; 0,75% to 5,75%	Commonwealth Bank Of Australia	EUR	800.000.000
Italy Government Bond 2024 to 2049; 0,4% to 5,77%	Credit Agricole Corp And Inv Bank	EUR	218.636.265
Spain Government Bond 2024 to 2050; 0% to 4,9%	Credit Agricole Corp And Inv Bank	EUR	314.823.735
Italy Government Bond 2024 to 2048; 0% to 7,25%	Goldman Sachs	EUR	281.192.866
Italy Government Bond 2024 to 2072; 0% to 6,5%	Goldman Sachs	EUR	281.345.456
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2026; 2,9%	JPM Securities Plc	EUR	193
France Treasury 2027 to 2036; 0,1% to 2,75%	JPM Securities Plc	EUR	35.156.519
Italy Government Bond 2024 to 2051; 0,15% to 3,1%	JPMorgan Chase Bank	EUR	277.497.387
Italy Government Bond 2024 to 2072; 0% to 7,25%	Natwest Markets Plc	EUR	846.255.556
Italy Government Bond 2024 to 2039; 0% to 5,012%	Natwest Markets Plc	EUR	365.868.916
Spain Government Bond 2024 to 2071; 0% to 5,9%	Natwest Markets Plc	EUR	97.724.862
Spain Government Bond 2024 to 2071; 0% to 5,75%	Natwest Markets Plc	EUR	44.408.451
Belgium Government Bond 2033; 0%	Natwest Markets Plc	EUR	347
Austria Government Bond 2027 to 2039; 0% to 3,2%	Natwest Markets Plc	EUR	45.003.656
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2024 to 2041; 0% to 6,5%	Natwest Markets Plc	EUR	117.889.159
Netherlands Government Bond 2026 to 2054; 0% to 5,5%	Natwest Markets Plc	EUR	147.866.951
France Treasury 2057; 0%	Natwest Markets Plc	EUR	8
Grand Duchy of Luxembourg 2033; 3%	Natwest Markets Plc	EUR	3.306.973
Italy Government Bond 2025 to 2053; 0% to 5,75%	RBC Europe Limited	EUR	31.058.932
Spain Government Bond 2023; 3,55%	RBC Europe Limited	EUR	20.278.565
France Treasury 2024; 0,25%	Santander UK Plc	EUR	25.500.000
Italy Government Bond 2024 to 2053; 0% to 5%	Societe Generale	EUR	204.000.952
Italy Government Bond 2025 to 2039; 0,85% to 6%	Societe Generale	EUR	102.000.810
Belgium Government Bond 2030; 0,1%	Societe Generale	EUR	5.163.517
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2031 to 2054; 0% to 2,5%	Societe Generale	EUR	9.347.963
Netherlands Government Bond 2033 to 2037; 2,5% to 4%	Societe Generale	EUR	36.488.521
			<b>6.154.674.333</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund</b>			
Italy Government Bond 2032 to 2072; 2,15% to 3,35%	BofA Securities Europe	EUR	40.800.284
			<b>40.800.284</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund</b>			
Singapore Government Bond 2024 to 2051; 0% to 2,75%	National Australia Bank	SGD	233.717.945
Singapore Government Bond 2024; 0%	Standard Chartered Bank London	SGD	153.000.865
			<b>386.718.810</b>



## JPMorgan Liquidity Funds

### Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben (Fortsetzung)

#### 7. Erhaltene Sicherheiten (Fortsetzung)

##### Für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhaltene Sicherheiten:

Beschreibung der Sicherheit	Gegenpartei	Währung	Wert der erhaltenen Sicherheit (in Teilfonds-Währung)
<b>JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund</b>			
UK Treasury 2033; 0,75%	Banco Santander	GBP	100.000.000
UK Treasury 2037; 1,75%	Bank Of Montreal	GBP	120.000.000
UK Treasury 2037; 1,75%	Bank Of Montreal	GBP	120.000.000
UK Treasury 2035 to 2036; 2% to 4,25%	Barclays Bank	GBP	86.000.000
UK Treasury 2027 to 2055; 0,875% to 4,25%	BNP Paribas	GBP	200.000.000
UK Treasury 2032 to 2037; 1% to 1,75%	Citigroup	GBP	391.000.000
UK Treasury 2028 to 2055; 0,125% to 1,25%	Commonwealth Bank Of Australia	GBP	700.000.000
UK Treasury 2027 to 2073; 0,125% to 3,75%	Credit Agricole	GBP	102.000.000
UK Treasury 2027 to 2045; 0,125% to 3,5%	DBS Bank Ltd	GBP	198.200.000
UK Treasury 2027 to 2045; 0,125% to 3,5%	DBS Bank Ltd	GBP	198.600.000
UK Treasury 2032; 1%	Goldman Sachs International	GBP	200.000.000
UK Treasury 2028 to 2054; 0,875% to 4,5%	JPM Securities Plc	GBP	199.934.883
UK Treasury 2039; 0%	JPMorgan Chase Bank	GBP	66.951
UK Treasury 2032; 1%	Merrill Lynch International	GBP	150.000.000
UK Treasury 2024 to 2073; 0% to 4,625%	MUFG Securities EMEA Plc	GBP	102.688.295
UK Treasury 2037; 1,125%	National Australia Bank	GBP	100.000.000
UK Treasury 2024 to 2073; 0,125% to 4,5%	Natwest Markets Plc	GBP	183.301.888
UK Treasury 2039; 0%	Natwest Markets Plc	GBP	17.168.103
UK Treasury 2028; 4,5%	Royal Bank Of Canada	GBP	50.000.000
UK Treasury 2034; 4,5%	Santander	GBP	302.739.755
UK Treasury 2039; 0%	Societe Generale	GBP	47.345.889
UK Treasury 2026 to 2058; 0,125% to 4,25%	Societe Generale	GBP	153.576.711
UK Treasury 2027 to 2055; 1,125% to 4,75%	Standard Chartered Bank	GBP	154.026.824
UK Treasury 2053; 3,75%	The Bank Of Nova Scotia	GBP	500.000.000
UK Treasury 2024 to 2073; 0% to 5%	The Toronto Dominion Bank	GBP	510.000.001
			<b>4.886.649.300</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund</b>			
UK Treasury 2029; 4,125%	Barclays Bank	GBP	14.394.560
UK Treasury 2033 to 2043; 0,875% to 4,75%	Citigroup	GBP	34.958.193
UK Treasury 2028; 4,5%	JPM Securities Plc	GBP	20.563.480
			<b>69.916.233</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund</b>			
US Treasury 2025 to 2054; 0% to 2,125%	BNP Paribas	USD	824.815.584
US Treasury 2024; 0,125% to 4,125%	Citibank	USD	38.804.726
US Treasury 2029; 1,5% to 4,875%	Fixed Income Clearing Corporation	USD	2.040.000.169
US Treasury 2024 to 2036; 0%	Wells Fargo Securities	USD	155.725.191
			<b>3.059.345.670</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund</b>			
US Treasury 2024 to 2053; 0,125% to 4,875%	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A .	USD	1.524.135.422
US Treasury 2024 to 2031; 0,625% to 3,875%	Bank Of Montreal	USD	253.423.188
US Treasury 2024 to 2053; 0% to 4,75%	Bank Of Nova Scotia	USD	355.777.392
US Treasury 2024 to 2046; 0% to 4,5%	Barclays Capital Inc	USD	204.112.960
US Treasury 2025 to 2054; 0% to 4,875%	BNP Paribas	USD	101.832.297
US Treasury 2029 to 2039; 0%	BNP Paribas	USD	495.206.107
Australia Government Bond 2024; 5,83%	BofA Securities, Inc	USD	346.443
US Treasury 2024 to 2047; 0% to 4,125%	BofA Securities, Inc	USD	101.807.663
Apollo Aviation Securitization Equity Trust 2040; 4,335%	BofA Securities, Inc	USD	2.505.900
ALASKA AIRLINES 2020 TR 2027; 4,8%	BofA Securities, Inc	USD	345.327
Alesco Preferred Funding Ltd 2036; 6,282%	BofA Securities, Inc	USD	17.482.147
AMERN AIRLINE 16-2 A PTT 2028; 3,65%	BofA Securities, Inc	USD	1.231
American Airlines 2016-1 Class A Pass Through Trust 2028; 4,1%	BofA Securities, Inc	USD	24.041
BRAVO Residential Funding Trust 2057 to 2069; 4,03% to 7,735%	BofA Securities, Inc	USD	19.464.058
CLI Funding LLC 2047; 2,72%	BofA Securities, Inc	USD	10.990.957
Home Partners of America Trust 2039; 4,73%	BofA Securities, Inc	USD	129.927
MASTR Asset Backed Securities Trust 2037; 6,06%	BofA Securities, Inc	USD	3.007.122
Residential Asset Mortgage Products, INC. 2036; 6,06%	BofA Securities, Inc	USD	375.199
Santander Drive Auto Receivables Trust 2030; 5,09%	BofA Securities, Inc	USD	29.356.795
Sapphire Aviation Finance I Limited 2040; 3,228%	BofA Securities, Inc	USD	961.891
SLM Student Loan Trust 2040; 5,819%	BofA Securities, Inc	USD	82.555
Taco Bell Funding, LLC 2051; 2,294%	BofA Securities, Inc	USD	18.888.642
Towd Point Mortgage Trust 2062; 4,577% to 4,745%	BofA Securities, Inc	USD	650.823
United Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 2025; 4,3%	BofA Securities, Inc	USD	83.768
United Airlines 2018-1 Class A Pass Through Trust 2030; 3,7%	BofA Securities, Inc	USD	434.260
Wellfleet CLO Ltd 2034; 9,39%	BofA Securities, Inc	USD	731.340
ALEXANDRIA REAL ESTATE E 2051; 3%	BofA Securities, Inc	USD	113.340
Altria Group, Inc. 2051; 3,7%	BofA Securities, Inc	USD	5.876.200
AMERICAN WATER CAPITAL C 2030 to 2047; 2,8% to 3,75%	BofA Securities, Inc	USD	377.031
Amgen, Inc. 2053; 5,65%	BofA Securities, Inc	USD	6.836.128
Banco Santander SA 2025; 5,147%	BofA Securities, Inc	USD	2.179.188
BANK OF NY MELLON CORP 2028 to 2030; 3,992% to 4,975%	BofA Securities, Inc	USD	59.153
BAXALTA INC 2045; 5,25%	BofA Securities, Inc	USD	25.350

## 7. Erhaltene Sicherheiten (Fortsetzung)

## Für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhaltene Sicherheiten:

Beschreibung der Sicherheit	Gegenpartei	Währung	Wert der erhaltenen Sicherheit (in Teilfonds-Währung)
Bimbo Bakeries USA Inc 2036; 5,375%	BofA Securities, Inc	USD	4.681.288
Biogen Inc 2050; 3,15%	BofA Securities, Inc	USD	7746.134
BLUE OWL FINANCE LLC 2032; 4,375%	BofA Securities, Inc	USD	885.820
BNP PARIBAS 2032; 2,871%	BofA Securities, Inc	USD	2.587.770
BRIXMOR OPERATING PART 2034; 5,5%	BofA Securities, Inc	USD	613.934
Brown & Brown Inc. 2029; 4,5%	BofA Securities, Inc	USD	6.718
BURLINGTN NORTH SANTA FE 2051; 3,3%	BofA Securities, Inc	USD	786.506
CaixaBank SA 2035; 6,037%	BofA Securities, Inc	USD	1.263.744
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 2027 to 2030; 4,927% to 7,149%	BofA Securities, Inc	USD	1.790.628
CITIZENS FINANCIAL GROUP 2025; 4,3%	BofA Securities, Inc	USD	27.360
Tapestry Inc 2027; 4,125%	BofA Securities, Inc	USD	19.951
Columbia Pipelines Holding Co LLC 2028; 6,042%	BofA Securities, Inc	USD	5.932.047
Comcast Corp. 2035; 5,65%	BofA Securities, Inc	USD	174.348
CON EDISON CO OF NY INC 2053; 5,9%	BofA Securities, Inc	USD	400.188
UBS Group AG 2025; 2,593%	BofA Securities, Inc	USD	7.788.695
Crown Castle Inc 2027; 3,65%	BofA Securities, Inc	USD	952.792
Deutsche Bank AG 2026; 2,129%	BofA Securities, Inc	USD	3.295.555
Enbridge, Inc. 2029; 5,3%	BofA Securities, Inc	USD	2.957.853
ESSEX PORTFOLIO LP 2029; 4%	BofA Securities, Inc	USD	1.426.825
ESTEE LAUDER CO INC 2049; 3,125%	BofA Securities, Inc	USD	132.234
EVEREST REINSURANCE HLDG 2044; 4,868%	BofA Securities, Inc	USD	3.161.584
EXTRA SPACE STORAGE LP 2031; 2,55% to 5,9%	BofA Securities, Inc	USD	1.790.827
FS KKR CAPITAL CORP 2027; 2,625%	BofA Securities, Inc	USD	30.775
FirstEnergy Transmission LLC 2049; 4,55%	BofA Securities, Inc	USD	474.143
HCA Inc 2030 to 2053; 3,5% to 5,9%	BofA Securities, Inc	USD	923.005
HEALTHPEAK OP LLC 2026; 3,25%	BofA Securities, Inc	USD	14.304
HSBC Holdings plc 2032; 7,625%	BofA Securities, Inc	USD	72.315
HERSHEY COMPANY 2046; 3,375%	BofA Securities, Inc	USD	14.601
Host Hotels & Resorts LP 2029; 3,375%	BofA Securities, Inc	USD	324.637
HYATT HOTELS CORP 2030; 5,75%	BofA Securities, Inc	USD	10.346.468
ING Groep NV 2026; 6,994%	BofA Securities, Inc	USD	382.203
Intel Corp. 2050; 4,75%	BofA Securities, Inc	USD	1.064.650
INTACT FINANCIAL CORP 2032; 5,459%	BofA Securities, Inc	USD	1.047.842
International Paper Co 2041 to 2047; 4,4% to 6%	BofA Securities, Inc	USD	12.514.335
INVESCO FINANCE PLC 2026; 3,75%	BofA Securities, Inc	USD	59.233
JEFFERIES FIN GROUP INC 2030; 4,15%	BofA Securities, Inc	USD	55.108
KINDER MORGAN INC 2051; 3,6%	BofA Securities, Inc	USD	4.070
Lowe's Cos., Inc. 2024; 3,125%	BofA Securities, Inc	USD	75.420
MetLife, Inc. 2039; 10,75%	BofA Securities, Inc	USD	29.145
MIDAMERICAN ENERGY CO 2044; 4,4%	BofA Securities, Inc	USD	237.151
MOODY'S CORPORATION 2048; 4,875%	BofA Securities, Inc	USD	630.092
NiSource Inc 2042; 5,8%	BofA Securities, Inc	USD	127.659
Eversource Energy 2025; 3,15%	BofA Securities, Inc	USD	88.527
ONEOK INC 2030; 3,1%	BofA Securities, Inc	USD	57.364
Pacific Gas and Electric Co 2025 to 2046; 2,95% to 4,25%	BofA Securities, Inc	USD	665.280
FIRSTENERGY PENN ELECTRI 2026; 5,15%	BofA Securities, Inc	USD	630.146
Penske Truck Leasing Co. LP 2029; 5,35%	BofA Securities, Inc	USD	581.975
Phillips 66 Co 2029; 3,15%	BofA Securities, Inc	USD	337.392
PRIMERICA INC 2031; 2,8%	BofA Securities, Inc	USD	74.106
PROSPECT CAPITAL CORP 2026; 3,706%	BofA Securities, Inc	USD	118.030
Coöperatieve Rabobank UA 2026; 1,339%	BofA Securities, Inc	USD	381.660
Royal Bank of Canada 2026; 5,2%	BofA Securities, Inc	USD	140.605
Simon Property Group LP 2049; 3,25%	BofA Securities, Inc	USD	832.071
Southern California Edison Co. 2042; 4,05%	BofA Securities, Inc	USD	11.833
Southern Co Gas Capital Corp 2046; 3,95%	BofA Securities, Inc	USD	746.470
Standard Chartered plc 2031; 4,644%	BofA Securities, Inc	USD	680.522
SUNCOR ENERGY INC 2034; 5,95%	BofA Securities, Inc	USD	8.169
T-MOBILE USA INC 2055 to 2060; 3,6% to 5,5%	BofA Securities, Inc	USD	7956.820
VALE OVERSEAS LIMITED 2030; 3,75%	BofA Securities, Inc	USD	8.203.848
VIRGINIA ELEC & POWER CO 2048; 4,6%	BofA Securities, Inc	USD	50.485
WESTERN MIDSTREAM OPERAT 2026 to 2029; 4,65% to 6,35%	BofA Securities, Inc	USD	2.158.114
JBS USA HOLD/FOOD/LUX CO 2030; 5,5%	BofA Securities, Inc	USD	175.300
TRUST FIBRAUNO 2050; 6,39%	BofA Securities, Inc	USD	2.189.485
OVINTIV INC 2030; 8,125%	BofA Securities, Inc	USD	60.501
ARIZONA PUBLIC SERVICE 2033; 5,55%	BofA Securities, Inc	USD	251.668
Avolon Holdings Funding Ltd 2026; 4,25%	BofA Securities, Inc	USD	1.050.759
Bayer US Finance II LLC 2064; 4,7%	BofA Securities, Inc	USD	562.277
BROOKLYN UNION GAS CO 2049; 4,487%	BofA Securities, Inc	USD	3.777.939
Burlington Northern Santa Fe LLC 2027; 3,25%	BofA Securities, Inc	USD	95.160
CSL FINANCE PLC 2042; 4,625%	BofA Securities, Inc	USD	9.752
Canadian Pacific Railway Co. 2033; 5,75%	BofA Securities, Inc	USD	1.024
CANADIAN PACIFIC RR CO 2026; 3,7%	BofA Securities, Inc	USD	6.782
COMMONWEALTH EDISON CO 2052; 3,85%	BofA Securities, Inc	USD	13.302
Corning, Inc. 2057; 4,375%	BofA Securities, Inc	USD	6.138.659
Danske Bank A/S, 2025; 3,244%	BofA Securities, Inc	USD	24.508.403
DELL INT LLC / EMC CORP 2034; 5,4%	BofA Securities, Inc	USD	1.964
Electricite de France SA 2055; 5,25%	BofA Securities, Inc	USD	10.016.160
ENERGY TRANSFER LP 2049; 6,25%	BofA Securities, Inc	USD	4.948.919
GLENCORE FUNDING LLC 2033; 6,5%	BofA Securities, Inc	USD	5.826.608
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 2028; 3,691%	BofA Securities, Inc	USD	4.593.668
LYB International Finance III LLC 2025; 1,25%	BofA Securities, Inc	USD	596.216

## JPMorgan Liquidity Funds

### Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben (Fortsetzung)

#### 7. Erhaltene Sicherheiten (Fortsetzung)

##### Für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhaltene Sicherheiten:

Beschreibung der Sicherheit	Gegenpartei	Währung	Wert der erhaltenen Sicherheit (in Teilfonds-Währung)
LAZARD GROUP LLC 2031; 6%	BofA Securities, Inc	USD	8.646.096
Lincoln National Corp. 2034; 5,852%	BofA Securities, Inc	USD	9.891
MOSAIC CO 2041; 4,875%	BofA Securities, Inc	USD	3.136.314
NATIONAL GRID PLC 2034; 5,418%	BofA Securities, Inc	USD	166.756
Oshkosh Corp. 2028; 4,6%	BofA Securities, Inc	USD	24.292
PUBLIC SERVICE ENTERPRIS 2029; 5,2%	BofA Securities, Inc	USD	618.463
Ryder System, Inc. 2025 to 2026; 1,75% to 4,625%	BofA Securities, Inc	USD	158.649
Starbucks Corp. 2045; 4,3%	BofA Securities, Inc	USD	4.974.371
TRUIST FIN CORP 2026; 6%	BofA Securities, Inc	USD	269.726
SUTTER HEALTH 2053; 5,547%	BofA Securities, Inc	USD	20.183
Telefonica Europe BV 2030; 8,25%	BofA Securities, Inc	USD	12.380
Wyeth LLC 2034; 6,5%	BofA Securities, Inc	USD	4.341
DELTA AIR LINES/SKYMILES 2025; 4,5%	BofA Securities, Inc	USD	148.044
AUTORIDAD CANAL DE PANAM 2035; 4,95%	BofA Securities, Inc	USD	8.273.164
MITSUBISHI CORP 2024; 0%	BofA Securities, Inc	USD	9.261.283
BELL CDA 2024; 0%	BofA Securities, Inc	USD	3.831.613
BROOKFIELD INFRASTRUCTURE 2024; 0%	BofA Securities, Inc	USD	23.533.047
BROOKFIELD 2024; 0%	BofA Securities, Inc	USD	13.915.580
THE CIGNA GROUP 2024; 0%	BofA Securities, Inc	USD	388.017
CANADIAN NATL 2024; 0%	BofA Securities, Inc	USD	19.839.600
DANSKE 2024; 0%	BofA Securities, Inc	USD	138.883.576
US Treasury 2024 to 2052; 0% to 5%	Canadian Imperial Bank Of Commerce	USD	760.276.399
US Treasury 2024 to 2049; 0,125% to 2,375%	Citibank	USD	23.347.077
US Treasury 2024 to 2043; 0,125% to 6,125%	Citigroup Global Markets Inc.	USD	1.951.822.584
US Treasury 2024 to 2054; 0% to 5,5%	Credit Agricole	USD	1.017.490.811
US Treasury 2024 to 2052; 0% to 7,5%	Daiwa Capital Markets America Inc.	USD	506.977.424
US Treasury 2024 to 2052; 0,375% to 4,875%	Deutsche Bank	USD	3.554.351.255
US Treasury 2028 to 2029; 1,75% to 4,5%	Fixed Income Clearing Corporation	USD	4.590.000.002
US Treasury 2024 to 2048; 0% to 5,5%	HSBC Securities (USA) Inc	USD	50.834.787
US Treasury 2024 to 2052; 0% to 4,25%	HSBC Securities (USA) Inc	USD	178.279.848
US Treasury 2024 to 2025; 0%	Mizuho Securities USA LLC	USD	841.500.073
US Treasury 2024 to 2054; 0% to 6,125%	Natixis New York Branch	USD	507.508.377
US Treasury 2026 to 2030; 0,375% to 4,875%	Natwest Markets Securities Inc	USD	253.750.557
US Treasury 2024 to 2043; 0% to 5,475%	Nomura Securities International	USD	559.002.532
US Treasury 2026 to 2052; 1,125% to 4,375%	Norges	USD	5.824.515.489
US Treasury 2025 to 2049; 0,375% to 4,625%	Sumitomo Mitsui Banking Corporation	USD	406.559.898
US Treasury 2024 to 2034; 0% to 5%	Wells Fargo	USD	1.006.988.545
			<b>25.592.342.809</b>
<b>JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)</b>			
Belgium Government Bond 2045 to 2055; 3,5% to 3,75%	Bank Of Nova Scotia	EUR	98.365
France Treasury 2034; 1,25%	Bank Of Nova Scotia	EUR	28.461.634
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2028 to 2054; 2,1% to 4,75%	Citigroup Global Markets Ltd	EUR	69.836.794
French Republic Government Bond 2030; 2,75%	Citigroup Global Markets Ltd	EUR	854.056
France Treasury 2025 to 2043; 0,5% to 0,95%	Citigroup Global Markets Ltd	EUR	14.451.014
France Treasury 2024; 0%	Credit Agricole Corp And Inv Bank	EUR	78.540.001
Spain Government Bond 2032; 5,75%	Goldman Sachs Intl London	EUR	25.707.536
Belgium Government Bond 2053; 1,4%	JPM Securities PLC	EUR	179.583
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2029; 2,1%	JPM Securities PLC	EUR	113.478
Netherlands Government Bond 2031; 0%	JPM Securities PLC	EUR	163.698
France Treasury 2029 to 2050; 0,1% to 3%	JPM Securities PLC	EUR	40.674.441
Spain Government Bond 2025 to 2050; 0% to 6%	JPMorgan Chase Bank	EUR	28.722.399
Austria Government Bond 2027; 6,25%	National Australia Bank	EUR	322
French Republic Government Bond 2029; 2,75%	National Australia Bank	EUR	179.821
France Treasury 2030 to 2040; 0% to 0,5%	National Australia Bank	EUR	81.419.859
Spain Government Bond 2024 to 2046; 0% to 5,9%	Natwest Markets Plc	EUR	28.721.023
Austria Government Bond 2031; 0%	Natwest Markets Plc	EUR	24.726.409
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2024; 0%	Natwest Markets Plc	EUR	1.032.791
France Treasury 2029; 5,5%	Natwest Markets Plc	EUR	9.119.904
Belgium Government Bond 2025; 0,8%	Standard Chartered Bank	EUR	7411
France Treasury 2048 to 2066; 1,75% to 2%	Standard Chartered Bank	EUR	1.020.810
			<b>434.031.349</b>

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

## JPMorgan Liquidity Funds

### Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben (Fortsetzung)

#### 8. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die SICAV setzt Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (laut Definition gemäß Artikel 3 der Verordnung (EU) 2015/2365 gehören dazu Pensionsgeschäfte, Wertpapier- oder Warenverleihgeschäfte, Wertpapier- oder Warenentleihgeschäfte, Kauf-/Rückverkaufgeschäfte, Verkauf-/Rückkaufgeschäfte und Lombardgeschäfte) im Rahmen des Engagements in umgekehrte Pensionsgeschäfte während des Jahresverlaufs ein. Gemäß Artikel 13 der Verordnung werden die Angaben zu umgekehrten Pensionsgeschäften wie folgt erteilt.

Im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erhaltene oder gegebene Sicherheiten werden per Transaktionsdatum verbucht.

##### Allgemeine Angaben

*Betrag der verliehenen Vermögenswerte in umgekehrten Pensionsgeschäften*

Die Höhe der Vermögenswerte, die in umgekehrten Pensionsgeschäften eingesetzt sind, einschließlich ihres Anteils am verwalteten Vermögen des Teilfonds, ist im Wertpapierbestand angegeben.

##### Angaben zur Konzentration

*Die zehn wichtigsten Emittenten von Sicherheiten*

Die nachstehende Tabelle enthält die zehn wichtigsten Emittenten nach nicht zahlungswirksamen Sicherheiten, die der Teilfonds für umgekehrte Pensionsgeschäfte zum Berichtsstichtag erhielt:

JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund		JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund		JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund	
Nicht zahlungswirksame Sicherheit		Nicht zahlungswirksame Sicherheit		Nicht zahlungswirksame Sicherheit	
Emittent	AUD	Emittent	EUR	Emittent	EUR
Australia Government Bond	458.401.619	Italy Government Bond	3.716.905.721	Italy Government Bond	40.800.284
		Spain Government Bond	1.026.211.669		
		UK Treasury	930.000.000		
		Netherlands Government Bond	184.355.472		
		Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	144.722.135		
		France Treasury	82.714.895		
		Austria Government Bond	45.003.656		
		Belgium Government Bond	21.415.090		
		Grand Duchy of Luxembourg	3.345.695		
JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund		JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund		JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund	
Nicht zahlungswirksame Sicherheit		Nicht zahlungswirksame Sicherheit		Nicht zahlungswirksame Sicherheit	
Emittent	SGD	Emittent	GBP	Emittent	GBP
Singapore Government Bond	386.718.810	UK Treasury	4.886.649.300	UK Treasury	69.916.233
JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund		JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund		JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)	
Nicht zahlungswirksame Sicherheit		Nicht zahlungswirksame Sicherheit		Nicht zahlungswirksame Sicherheit	
Emittent	USD	Emittent	USD	Emittent	USD
US Treasury	3.059.345.670	US Treasury	25.069.500.684	France Treasury	253.687.663
		Danske	138.883.576	Spain Government Bond	83.150.957
		Santander Drive Auto Receivables Trust	29.356.795	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	70.983.061
		Danske Bank A/S	24.508.403	Austria Government Bond	24.726.731
		Brookfield Infrastructure	23.533.047	French Republic Government Bond	1.033.877
		Canadian Natl	19.839.600	Belgium Government Bond	285.361
		Bravo Residential Funding Trust	19.464.058	Netherlands Government Bond	163.699
		Taco Bell Funding, Llc	18.888.642		
		Alesco Preferred Funding Ltd	17.482.147		
		Brookfield	13.915.580		

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

##### *Die zehn wichtigsten Gegenparteien*

Alle Gegenparteien im Hinblick auf umgekehrte Pensionsgeschäfte zum Berichtsstichtag sind aus dem Wertpapierbestand in Anhang 7 ersichtlich. Erhaltene Sicherheiten.

## JPMorgan Liquidity Funds

Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben (Fortsetzung)

### 8. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Fortsetzung)

#### Aggregierte Transaktionsdaten

##### Art und Qualität der Sicherheiten

Vom Teilfonds im Hinblick auf umgekehrte Pensionsgeschäfte erhaltene Sicherheiten zum Berichtsstichtag sind Schuldtitel, wobei es sich vorwiegend um Staatsanleihen handelt. Es folgt die Qualität der Sicherheiten:

Teilfonds	Teilfonds-Währung	Wert der Sicherheiten (in Teilfonds-Währung)			Summe
		Investment-Grade	Unter Investment-Grade	Ohne Bonitätseinstufung*	
JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund	AUD	458.401.619	-	-	458.401.619
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund	EUR	6.154.674.333	-	-	6.154.674.333
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund	EUR	40.800.284	-	-	40.800.284
JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund	SGD	386.718.810	-	-	386.718.810
JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund	GBP	4.886.649.300	-	-	4.886.649.300
JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund	GBP	69.916.233	-	-	69.916.233
JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund	USD	3.059.345.670	-	-	3.059.345.670
JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund	USD	25.592.342.809	-	-	25.592.342.809
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)	EUR	434.031.349	-	-	434.031.349

Die Qualität der Sicherheiten gilt als zu den Anleiheinstrumenten gehörend, die dahingehend bewertet und ausgewiesen worden sind, ob sie Investment-Grade, unter Investment-Grade oder ohne Bonitätseinstufung sind. Wertpapiere mit Investment-Grade sind von Unternehmen emittiert, die von einer weltweit anerkannten Ratingagentur eine Bonitätseinstufung von mindestens Investment-Grade erhielt.

\*Sicherheiten ohne Rating umfassen staatlich unterstützte hypotheckenbesicherte Wertpapiere. In Übereinstimmung mit dem Verkaufsprospekt handelt es sich dabei um Sicherheiten vergleichbarer Kreditqualität mit Investment-Grade.

##### Fälligkeit der Sicherheiten

Die folgende Tabelle analysiert die Fälligkeit der für umgekehrte Pensionsgeschäfte zum Berichtsstichtag erhaltenen Sicherheiten:

Fälligkeit	Wert der Sicherheiten					
	JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund AUD	JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund EUR	JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund EUR	JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund SGD	JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund GBP	JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund GBP
<b>Nicht-Bankguthaben</b>						
weniger als 1 Tag	-	-	-	-	-	-
1-7 Tage	-	144.939	-	106.990.625	-	-
1-4 Wochen	-	1.785.814	-	-	16.697.173	-
1-3 Monate	-	75.941.461	-	153.000.865	30.418.059	-
3-12 Monate	-	644.509.699	-	-	94.742.964	-
über 1 Jahr	458.401.619	5.432.292.420	40.800.284	126.727.320	4.744.791.104	69.916.233
offene Fälligkeit	-	-	-	-	-	-
	<b>458.401.619</b>	<b>6.154.674.333</b>	<b>40.800.284</b>	<b>386.718.810</b>	<b>4.886.649.300</b>	<b>69.916.233</b>

Fälligkeit	Wert der Sicherheiten		
	JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund USD	JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund USD	JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1) EUR
<b>Nicht-Bankguthaben</b>			
weniger als 1 Tag	-	1.840.633	-
1-7 Tage	-	1.578.628	-
1-4 Wochen	-	56.579.339	-
1-3 Monate	22.259.926	1.009.135.750	78.540.001
3-12 Monate	25.490.127	1.267.938.869	6.577.830
über 1 Jahr	3.011.595.617	23.255.269.590	348.913.518
offene Fälligkeit	-	-	-
	<b>3.059.345.670</b>	<b>25.592.342.809</b>	<b>434.031.349</b>

##### Währung der Sicherheiten

Das Währungsprofil der erhaltenen Sicherheiten für umgekehrte Pensionsgeschäfte zum Berichtsstichtag ist aus Anhang 8 ersichtlich. Erhaltene Sicherheiten.

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

**8. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Fortsetzung)**

*Fälligkeit von umgekehrten Pensionsgeschäften*

Die folgende Tabelle analysiert die Fälligkeit der offenen umgekehrten Pensionsgeschäfte zum Berichtsstichtag:

Fälligkeit	Wert der Sicherheiten					
	JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund	JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund	JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund	JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund	JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund	JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund
	AUD	EUR	EUR	SGD	GBP	GBP
<b>Nicht-Bankguthaben</b>						
weniger als 1 Tag	-	-	-	-	-	-
1-7 Tage	450.000.000	6.041.462.108	40.000.000	380.000.000	4.863.800.000	68.000.000
1-4 Wochen	-	-	-	-	-	-
1-3 Monate	-	-	-	-	-	-
3-12 Monate	-	-	-	-	-	-
über 1 Jahr	-	-	-	-	-	-
offene Fälligkeit	-	-	-	-	-	-
	<b>450.000.000</b>	<b>6.041.462.108</b>	<b>40.000.000</b>	<b>380.000.000</b>	<b>4.863.800.000</b>	<b>68.000.000</b>

Fälligkeit	Wert der Sicherheiten		
	JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund	JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund	JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)
	USD	USD	EUR
<b>Nicht-Bankguthaben</b>			
weniger als 1 Tag	-	-	-
1-7 Tage	3.000.000.000	24.771.731.345	424.000.000
1-4 Wochen	-	-	-
1-3 Monate	-	-	-
3-12 Monate	-	-	-
über 1 Jahr	-	-	-
offene Fälligkeit	-	-	-
	<b>3.000.000.000</b>	<b>24.771.731.345</b>	<b>424.000.000</b>

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

Die obige Fälligkeitsanalyse beruht auf dem vertraglichen Fälligkeitsdatum.

*Land, in dem die Gegenparteien niedergelassen sind*

Land, in dem die Gegenparteien der umgekehrten Pensionsgeschäfte niedergelassen sind, ist dem Wertpapierbestand zu entnehmen.

*Abwicklung und Clearing*

Alle Teilfonds, die umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen, nutzen bilaterale Abwicklung und Clearing mit der Gegenpartei.

**Weiterverwendung von Sicherheiten**

*Anteil der erhaltenen Sicherheiten, die weiterverwendet werden, sowie Rendite aus der Wiederanlage*

Im Verlauf des Berichtszeitraums wurden keine erhaltene Sicherheiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften verkauft, wiederangelegt bzw. verpfändet.



## JPMorgan Liquidity Funds

Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben (Fortsetzung)

### 8. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Fortsetzung)

#### Verwahrung von Sicherheiten

##### Erhaltene Sicherheit

Die nachstehende Tabelle analysiert die bei jeder Verwahrstelle gehaltenen Beträge nicht zahlungswirksamer Sicherheiten des Teilfonds, die er für umgekehrte Pensionsgeschäfte zum Berichtsstichtag erhielt:

Teilfonds	Verwahrstelle	Teilfonds-Währung	Wert der Sicherheiten (in Teilfonds-Währung)
JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund	Euroclear	AUD	458.401.619
			<b>458.401.619</b>
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund	Euroclear	EUR	6.154.674.333
			<b>6.154.674.333</b>
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund	Euroclear	EUR	40.800.284
			<b>40.800.284</b>
JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund	Euroclear	SGD	386.718.810
			<b>386.718.810</b>
JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund	Euroclear	GBP	4.886.649.300
			<b>4.886.649.300</b>
JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund	Euroclear	GBP	69.916.233
			<b>69.916.233</b>
JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund	BNY Mellon	USD	3.059.345.670
			<b>3.059.345.670</b>
JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund	BNY Mellon	USD	25.592.342.809
			<b>25.592.342.809</b>
JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)	Euroclear	EUR	434.031.349
			<b>434.031.349</b>

##### Gewährte Sicherheiten

Zum Berichtsstichtag wurden keine gewährten Sicherheiten für umgekehrte Pensionsgeschäfte gehalten.

#### Rendite und Kosten

Alle Renditen aus umgekehrten Pensionsgeschäften laufen für den Teilfonds auf und unterliegen keinen Vereinbarungen zur Teilung der Rendite mit dem Anlageverwalter oder Dritten. Die Renditen aus umgekehrten Pensionsgeschäften sind aus Erläuterung 2f) des Abschlusses ersichtlich.

## 9. OGAW - Angaben zur Vergütung

JPMorgan Asset Management (Europe) S.à.r.l. (die „**Verwaltungsgesellschaft**“) ist der zugelassene Manager von JPMorgan Liquidity Funds (die „**Gesellschaft**“) und ist Teil der Unternehmensgruppe J.P. Morgan Chase & Co. In diesem Abschnitt bezieht sich der Begriff „**J.P. Morgan**“ bzw. „**Firma**“ auf diese Gruppe und jeden Rechtsträger der Gruppe weltweit, außer Gegenteiliges wurde angegeben.

Dieser Abschnitt des Abschlusses wurde gemäß der Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren (die „**OGAW-Richtlinie**“) und den „**Leitlinien für eine solide Vergütungspolitik**“ der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde laut OGAW-Richtlinie erstellt. Die Angaben in diesem Abschnitt beziehen sich auf den letzten vollständigen Vergütungszeitraum („**Ergebnisjahr**“) zum Bilanzstichtag.

### Vergütungspolitik

Eine Zusammenfassung der Vergütungspolitik (die „**Vergütungspolitik**“), die von der Verwaltungsgesellschaft angewandt wird, ist abrufbar unter <https://am.jpmorgan.com/lu/en/asset-management/adv/funds/policies/> („**Erklärung der Vergütungspolitik**“). Die Vergütungspolitik informiert, wie Vergütungen und Leistungen berechnet werden. In diesen Bereich fallen ebenso finanzielle und nicht-finanzielle Kriterien, die zur Leistungsbewertung herangezogen werden, die Verantwortlichkeiten und die Zusammensetzung des Vergütungs- und Management-Entwicklungsausschusses der Firma sowie die zur Vermeidung bzw. Handhabung von Interessenkonflikten ergriffenen Maßnahmen. Die Verwaltungsgesellschaft stellt auf Wunsch eine Kopie dieser Leitlinie kostenlos zur Verfügung.

Die Vergütungspolitik gilt für alle Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft, u. a. Einzelpersonen, deren professionellen Tätigkeiten ggf. einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Verwaltungsgesellschaft bzw. die von ihnen verwalteten OGAW-Fonds haben („**identifizierte OGAW-Mitarbeiter**“). Zu den identifizierten OGAW-Mitarbeitern zählen Mitglieder des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft (der „**Verwaltungsrat**“), leitendes Management, Leiter von relevanten Kontrollfunktionen sowie Leiter anderer wesentlicher Funktionen. Mindestens einmal jährlich werden Einzelpersonen über ihre Identifikation sowie die Auswirkungen ihres Status informiert.

Der Verwaltungsrat überprüft und führt die Vergütungspolitik jährlich ein und überwacht dessen Umsetzung, darunter die Klassifizierung von identifizierten OGAW-Mitarbeitern. Der Verwaltungsrat überprüfte und verabschiedete die für 2023 geltende Vergütungspolitik im Juni 2023 ohne wesentliche Änderungen und war mit ihrer Umsetzung zufrieden.

### Quantitative Angaben

Die nachstehende Tabelle ist ein Überblick der aggregierten Gesamtvergütung, die im Ergebnisjahr 2023 an die Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft und die Anzahl der Begünstigten bezahlt wurde.

Aufgrund der Struktur der Firma sind die erforderlichen Informationen für eine weitere Aufteilung der Vergütung, die der Gesellschaft zuzuordnen ist, nicht erhältlich und wäre weder relevant noch zuverlässig. In diesem Zusammenhang ist jedoch anzumerken, dass die Verwaltungsgesellschaft 45 alternative Investmentfonds (mit 50 Teilfonds) und 6 OGAW (mit 179 Teilfonds) mit einem kombinierten Vermögen von USD 16.602 Mio. bzw. USD 466.699 Mio. zum 31. Dezember 2023 verwaltet.

	Feste Vergütung	Variable Vergütung	Gesamtvergütung	Anzahl der Begünstigten
Mitarbeiter gesamt (USD Tsd.)	54.109	27.380	81.489	364

JPMorgan Liquidity Funds zahlte in diesem Jahr keinem Mitarbeitenden eine an die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühr.

Die an identifizierte OGAW-Mitarbeiter bezahlte aggregierte Gesamtvergütung betrug für das Ergebnisjahr 2023 USD 157.186 Tsd., wovon USD 7.138 Tsd. auf das leitende Management bzw. USD 150.048 Tsd. auf anderweitige identifizierte OGAW-Mitarbeiter entfielen<sup>(1)</sup>.

<sup>(1)</sup> Die Angaben zum identifizierten Personal enthält die Mitarbeiter von Unternehmen, an die das Portfoliomanagement in Übereinstimmung mit den neuesten ESMA-Leitlinien formell delegiert wurde.

## JPMorgan Liquidity Funds

Anhang - Ungeprüfte zusätzliche Angaben (Fortsetzung)

---

### 10. Offenlegungsverordnung

Diese Teilfonds wurden entsprechend Artikel 6 der Offenlegungsverordnung kategorisiert:

JPMorgan Liquidity Funds - USD Treasury CNAV Fund

JPMorgan Liquidity Funds - EUR Government CNAV Fund (1)

(1) Dieser Teilfonds wurde am 13. Mai 2024 aufgelegt.

Zum Ende des Berichtszeitraums berücksichtigten die den Finanzprodukten zugrunde liegenden Anlagen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Diese Teilfonds wurden entsprechend Artikel 8 der Offenlegungsverordnung kategorisiert.

#### Name des Teilfonds

JPMorgan Liquidity Funds - AUD Liquidity LVNAV Fund

JPMorgan Liquidity Funds - EUR Liquidity LVNAV Fund

JPMorgan Liquidity Funds - EUR Standard Money Market VNAV Fund

JPMorgan Liquidity Funds - GBP Liquidity LVNAV Fund

JPMorgan Liquidity Funds - GBP Standard Money Market VNAV Fund

JPMorgan Liquidity Funds - SGD Liquidity LVNAV Fund

JPMorgan Liquidity Funds - USD Liquidity LVNAV Fund

JPMorgan Liquidity Funds - USD Standard Money Market VNAV Fund

Der vorliegende Bericht ist eine Übersetzung des englischen Originals. Falls Unterschiede zwischen der englischen und dieser übersetzten Version bestehen, so ist die englische Version maßgebend.

---

## DIE NÄCHSTEN SCHRITTEN

**E-Mail:**

[fundinfo@jpmorgan.com](mailto:fundinfo@jpmorgan.com)

**Internetadresse:**

[www.jpmlgloballiquidity.com](http://www.jpmlgloballiquidity.com)

**Postanschrift:**

JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l.  
6, route de Trèves,  
L-2633 Senningerberg,  
Großherzogtum Luxemburg  
Telefon: (352) 34 101