

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年8月16日提出
【発行者名】	キャピタル・インターナショナル株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 トーマス・クワントリル
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内二丁目1番1号 明治安田生命ビル
【事務連絡者氏名】	原田 伸健
【電話番号】	03(6366)1000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF（米ドル売り円買い）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額(2019年2月15日から2020年2月13日まで) 3,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2019年2月14日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、「第二部ファンド情報」及び「第三部委託会社等の情報」における訂正事項を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書を以下の内容に訂正します。下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示します。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (3)【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

(前略)

ファミリーファンド方式

(中略)

・委託会社は、マザーファンドに投資を行なう当ファンド以外のベビーファンドの設定・運用を行なうことがあります。2019年2月14日現在、その他のベビーファンドは次のとおりです。

(中略)

委託会社の概況（2018年12月28日現在）

(以下略)

< 訂正後 >

(前略)

ファミリーファンド方式

(中略)

・委託会社は、マザーファンドに投資を行なう当ファンド以外のベビーファンドの設定・運用を行なうことがあります。2019年8月16日現在、その他のベビーファンドは次のとおりです。

(中略)

委託会社の概況（2019年6月28日現在）

(以下略)

#### 2【投資方針】

##### (2)【投資対象】

< 訂正前 >

(前略)

< 参考情報 2 > 投資対象ファンドの概要等

ファンド名称	キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ (LUX) (クラスCfdh-JPY)
	(中略)
決算日	毎年3月31日
	(中略)

上記は、2018年12月28日現在のものであり、今後、投資顧問会社等の判断その他理由により変更される場合があります。

(中略)

上記は、2018年12月28日現在のものであり、今後、委託会社の判断その他理由により変更される場合があります。

< 訂正後 >

（前略）

< 参考情報 2 > 投資対象ファンドの概要等

ファンド名称	キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ (LUX) (クラスCfdh-JPY)
--------	---

（中略）

決算日	毎年12月31日
-----	----------

（中略）

上記は、2019年6月28日現在のものであり、今後、投資顧問会社等の判断その他理由により変更される場合があります。

（中略）

上記は、2019年6月28日現在のものであり、今後、委託会社の判断その他理由により変更される場合があります。

（3）【運用体制】

< 訂正前 >

（前略）

内部管理体制

（中略）

（参考情報）

キャピタル・インターナショナル株式会社の運用部門等の人員体制（2018年12月28日現在）

運用部（3名）/法務コンプライアンス部（2名）/オペレーション部（8名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

上記は2018年12月28日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

< 訂正後 >

（前略）

内部管理体制

（中略）

（参考情報）

キャピタル・インターナショナル株式会社の運用部門等の人員体制（2019年6月28日現在）

運用部（3名）/法務コンプライアンス部（3名）/オペレーション部（6名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

上記は2019年6月28日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

3 【投資リスク】

< 訂正前 >

（前略）

上記は2018年12月28日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

<訂正後>

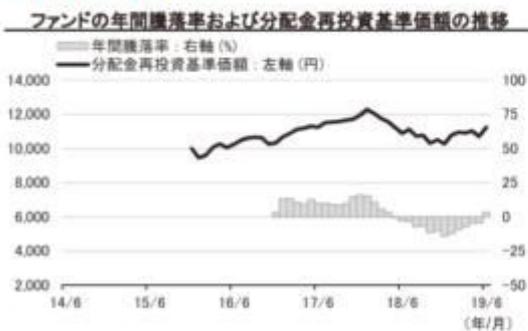
（前略）

上記は2019年6月28日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

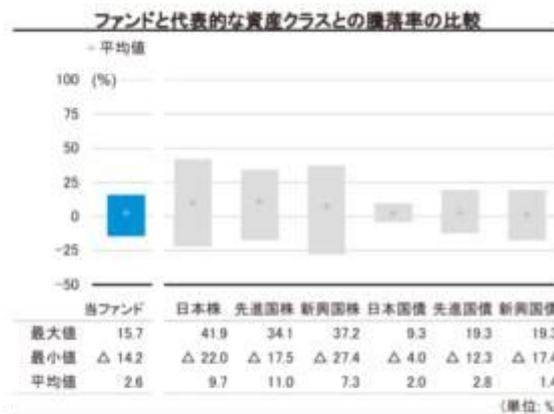
原届出書の第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 3投資リスク リスクの定量的比較につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

## リスクの定量的比較



(注1) 年間騰落率は、2014年12月から2019年6月までの各月末における1年間の騰落率を表示したもので、分配金再投資基準価額を基に算出しています。  
 (注2) 分配金再投資基準価額は、設定日(2015年12月30日)を10,000として指数化しています。  
 (注3) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。



(注1) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。  
 (注2) 代表的な資産クラスの騰落率は、2014年7月から2019年6月までの5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
 (注3) ファンドの騰落率は、2014年12月から2019年6月までの各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

## <各資産クラスの指数>

日本株・・・TOPIX(配当込み)  
 先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)  
 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)  
 日本国債・・・NOMURA-BPI国債  
 先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本/円ベース)  
 新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)  
 ※ 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 「ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数について

「日本株」の資産クラスはTOPIX(配当込み)を表示しております。

TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所((株)東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。なお、ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

「先進国株」の資産クラスはMSCIコクサイ・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)を表示しております。

MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

「新興国株」の資産クラスはMSCIエマージング・マーケット・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)を表示しております。

MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

「日本国債」の資産クラスはNOMURA-BPI国債を表示しております。

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスを用いて行なわれる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

「先進国債」の資産クラスはFTSE世界国債インデックス(除く日本/円ベース)を表示しております。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

「新興国債」の資産クラスはJPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)を表示しております。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイドは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが発表しており、著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しています。

## 4【手数料等及び税金】

## (3)【信託報酬等】

&lt;訂正前&gt;

信託報酬の総額（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に**年0.9774%（税抜0.905%）**（\*1）の率を乗じて得た額とします。

（中略）

	委託会社	受託会社	販売会社
役務の内容	委託した資金の運用等の対価として	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価として	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価として
配分（年率／税抜）	0.875%（*2）	0.02%	0.01%

（中略）

（\*1）信託報酬は、2019年3月4日より、**年率0.8424%（税抜0.78%）**となります。

（\*2）委託会社配分は、2019年3月4日より、0.75%となります。

&lt;投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担&gt;

当ファンドの信託報酬	年率0.9774%（税抜0.905%）
投資対象とする外国投資信託の信託報酬（*1）	年率0.00%
投資対象とする国内投資信託の信託報酬（*2）	年率0.007%

実質的な負担（\*3） **年率0.9844%程度（税込）**（\*4）

（中略）

（\*2）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）は、年率0.1404%（税込）を上限とする信託報酬がかかりますが、当該ファンドの実質的な組入比率は低位を維持するため、受益者が実質的に負担する信託報酬の算出にあたっては、年率0.007%程度と見込み、当該年率を表示しています。

（\*3）当ファンドは他の投資信託証券を実質的な投資対象としており、投資対象ファンドにおける所定の信託報酬を含めて受益者が実質的に負担する信託報酬の概算を表示していますが、投資対象ファンドの実質組入比率は運用状況に応じて変動するため、受益者が実質的に負担する実際の信託報酬の率および上限額は事前に表示することができません。

（\*4）実質的な負担は、2019年3月4日より、**年率0.8494%程度（税込）**となります。

&lt;訂正後&gt;

信託報酬の総額（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に**年率0.8424%<sup>-1</sup>（税抜0.78%）**の率を乗じて得た額とします。

（中略）

	委託会社	受託会社	販売会社
役務の内容	委託した資金の運用等の対価として	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価として	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価として
配分（年率／税抜）	0.75%	0.02%	0.01%

（中略）

&lt;投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担&gt;

当ファンドの信託報酬	年率0.8424% <sup>-1</sup> （税抜0.78%）
投資対象とする外国投資信託の信託報酬（*1）	年率0.00%

投資対象とする国内投資信託の信託報酬（\*2） 年率0.007%

実質的な負担（\*3）

**年率0.8494%程度（税込）<sup>2</sup>**

1 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、**年率0.858%**となります。

2 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、**年率0.865%程度（税込）**となります。

（\*1）キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ（LUX）（クラス Cfdh-JPY）の投資顧問会社への報酬は、委託会社の報酬中より支払います。このため、当該ファンドに信託報酬はかかりませんが、後記「（4）その他の手数料等」に表示するファンド管理費用（上限年率0.15%）が別途かかります。

（\*2）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）は、年率0.1404%（税抜0.13%）を上限とする信託報酬がかかりますが、当該ファンドの実質的な組入比率は低位を維持するため、受益者が実質的に負担する信託報酬の算出にあたっては、年率0.007%程度と見込み、当該年率を表示しています。2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、0.143%となります。

（\*3）当ファンドは他の投資信託証券を実質的な投資対象としており、投資対象ファンドにおける所定の信託報酬を含めて受益者が実質的に負担する信託報酬の概算を表示していますが、投資対象ファンドの実質組入比率は運用状況に応じて変動するため、受益者が実質的に負担する実際の信託報酬の率および上限額は事前に表示することができません。

#### （5）【課税上の取扱い】

##### <訂正前>

課税上は、株式投資信託として取扱われ、個人受益者、法人受益者毎に以下の取扱いとなります。以下の取扱内容は、2018年12月28日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご注意ください。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

（以下略）

##### <訂正後>

課税上は、株式投資信託として取扱われ、個人受益者、法人受益者毎に以下の取扱いとなります。以下の取扱内容は、2019年6月28日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご注意ください。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

（以下略）

#### 5【運用状況】

原届出書の第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

##### <更新・訂正後>

#### （1）【投資状況】

キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF（米ドル売り円買い）

2019年6月28日現在

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

親投資信託受益証券	日本	6,800,508,940	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,833,296	0.04
合計(純資産総額)		6,797,675,644	100.00

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(参考)キャピタル・エマージング・ストラテジー・マザーファンド(米ドル売り円買い)

2019年6月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	4,885,395	0.06
投資証券	ルクセンブルク	7,115,470,331	99.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		368	0.00
合計(純資産総額)		7,120,356,094	100.00

(注)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(参考)キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ(LUX)

2019年6月28日現在

資産の種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	中国	9,801,096,773	5.97
	ブラジル	7,935,018,372	4.83
	香港	6,362,289,378	3.88
	インド	6,177,564,104	3.76
	ロシア	4,617,372,786	2.81
	台湾	3,852,723,154	2.35
	韓国	3,771,029,774	2.30
	南アフリカ	3,106,100,728	1.89
	アラブ首長国連邦	2,743,220,068	1.67
	インドネシア	2,498,246,402	1.52
	シンガポール	2,188,081,454	1.33
	英国	2,097,375,802	1.28
	メキシコ	2,037,417,399	1.24
	米国	1,914,829,989	1.17
	カナダ	1,780,224,217	1.08
	デンマーク	1,512,372,500	0.92
	スロベニア	1,118,369,426	0.68
	スイス	1,075,701,719	0.66
	スウェーデン	902,377,775	0.55
	日本	894,641,999	0.54
	フィリピン	869,896,518	0.53
	オーストラリア	736,543,926	0.45
	チリ	608,700,171	0.37
	ルーマニア	363,448,784	0.22
	ベトナム	340,340,322	0.21
	アルゼンチン	288,300,677	0.18
	フランス	237,313,012	0.14

	オランダ	221,022,031	0.13
債券	メキシコ	8,774,778,100	5.35
	アルゼンチン	5,476,705,875	3.34
	トルコ	5,452,095,129	3.32
	ブラジル	5,419,857,064	3.30
	中国	4,398,860,513	2.68
	パキスタン	4,237,223,811	2.58
	インドネシア	3,833,485,731	2.34
	エジプト	3,818,117,005	2.33
	ドミニカ共和国	3,480,490,036	2.12
	ルーマニア	3,413,708,782	2.08
	スリランカ	3,043,191,256	1.85
	ギリシャ	2,883,893,552	1.76
	ロシア	2,659,082,590	1.62
	インド	2,433,982,966	1.48
	南アフリカ	2,419,493,492	1.47
	チュニジア	2,311,784,276	1.41
	パナマ	2,160,353,416	1.32
	ウクライナ	2,001,245,959	1.22
	サウジアラビア	1,930,653,007	1.18
	ペルー	1,634,886,767	1.00
	ナイジェリア	1,517,344,062	0.92
	ベニン	1,284,184,661	0.78
	ガーナ	1,272,610,655	0.78
	ケニア	1,130,658,467	0.69
	ガボン	1,101,680,046	0.67
	ホンジュラス	1,062,040,867	0.65
	カメルーン	1,022,026,283	0.62
	オマーン	880,629,148	0.54
	パラグアイ	672,127,902	0.41
	ウルグアイ	657,200,678	0.40
	セネガル	631,143,061	0.38
	バーレーン	594,713,416	0.36
	コロンビア	543,837,064	0.33
	コスタリカ	480,313,582	0.29
	コートジボワール	443,750,899	0.27
	オランダ	432,568,434	0.26
	米国	423,932,963	0.26
	韓国	388,141,769	0.24
	クロアチア	376,610,046	0.23
	カタール	304,166,961	0.19
ポーランド	218,971,303	0.13	
タイ	122,013,664	0.07	
モロッコ	112,784,705	0.07	
	銀行預金、その他資産（負債控除後）	6,653,334,255	4.05
	純資産総額	164,162,293,482	100.00

（注）投資比率は、キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ（LUX）の純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（参考）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)の投資対象である日本短期債券マザーファンド

2019年1月23日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	日本	1,806,984,000	97.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		53,032,841	2.85
合計(純資産総額)		1,860,016,841	100.00

(注)投資比率は、日本短期債券マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(注)当該情報は委託会社が入手可能な直近日(2019年1月23日)現在の情報です。

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF(米ドル売り円買い)

#### a. 上位30銘柄

2019年6月28日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	キャピタル・エマージング・ストラテジー・マザーファンド(米ドル売り円買い)	6,488,416,125	0.9741	6,320,477,380	1.0481	6,800,508,940	100.04

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

#### b. 種類別投資比率

2019年6月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

（参考）キャピタル・エマージング・ストラテジー・マザーファンド(米ドル売り円買い)

#### a. 上位30銘柄

2019年6月28日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
----	------	----	-----	-------	---------	---------	---------	---------	---------

1	ルクセンブルク	投資証券	キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ（LUX）（クラスCfdh-JPY）	8,501,159,297	828.03	7,039,222,681	837	7,115,470,331	99.93
2	日本	投資信託受益証券	日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）	4,631,585	1.0548	4,885,395	1.0548	4,885,395	0.06

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

#### b. 種類別投資比率

2019年6月28日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	0.06
投資証券	99.93
合計	99.99

#### (参考) キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ（LUX）

上位30銘柄

2019年6月28日現在

順位	銘柄	利率(%) (上段) 償還日 (下段)	国/地域(上段) 資産(中段) 業種/種類 (下段)	数量	評価単価(上段) 通貨(下段)	評価金額(円)	投資比率 (%)
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD COM	- -	韓国 株式 情報技術	642,167	46,500.00 韓国ウォン	2,778,659,991	1.69
2	PAKISTAN REP REG S	6.875 2027/12/5	パキスタン 債券 国債証券	24,215,000	101.125 米ドル	2,639,131,556	1.61
3	AIA GROUP LTD	- -	香港 株式 金融	2,199,400	84.20 香港ドル	2,553,826,968	1.56
4	BONOS MEXICAN MXN	10.0 2024/12/5	メキシコ 債券 国債証券	382,250,000	111.1214 メキシコ・ペソ	2,386,076,969	1.45
5	AMERICA MOVIL SAB DE CV L ADR	- -	メキシコ 株式 コミュニケーション・サービス	1,290,400	14.65 米ドル	2,037,417,399	1.24
6	DP WORLD PLC	- -	アラブ首長国 連邦 株式 資本財・サービス	1,071,343	15.90 米ドル	1,835,877,470	1.12
7	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	- -	香港 株式 一般消費財・サービス	2,494,000	52.35 香港ドル	1,800,479,959	1.10
8	BARRICK GOLD CORP (USD)	- -	カナダ 株式 素材	1,052,100	15.70 米ドル	1,780,224,217	1.08

9	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO	- -	台湾 株式 情報技術	2,080,879	240.50 台湾ドル	1,735,257,769	1.06
10	CENTRAL BANK OF TUNISIA EUR REG S	6.75 2023/10/31	チュニジア 債券 国債証券	13,640,000	102.985 ユーロ	1,721,189,308	1.05
11	EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA SR UNSEC	3.053 2020/6/8	中国 債券 国債証券	15,620,000	100.0849 米ドル	1,684,874,173	1.03
12	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ADR	- -	中国 株式 一般消費財・ サービス	88,800	170.90 米ドル	1,635,584,778	1.00
13	HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	- -	中国 株式 ヘルスケア	500,941	30.20 米ドル	1,630,465,272	0.99
14	CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP E PART ON	- -	ブラジル 株式 一般消費財・ サービス	2,840,700	20.05 ブラジル・レアル	1,601,679,497	0.98
15	CCR SA ON	- -	ブラジル 株式 資本財・ サービス	3,998,329	13.72 ブラジル・レアル	1,542,653,918	0.94
16	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	- -	英国 株式 生活必需品	404,900	27.50 英ポンド	1,520,760,382	0.93
17	CARLSBERG A/S B	- -	デンマーク 株式 生活必需品	106,582	864.40 デンマーク・ク ローネ	1,512,372,500	0.92
18	ALROSA PJSC (USD)	- -	ロシア 株式 素材	9,831,353	1.3845 米ドル	1,466,960,432	0.89
19	NASPERS LIMITED N	- -	南アフリカ 株式 一般消費財・ サービス	57,172	3,369.65 南アフリカ・ラ ンド	1,464,361,376	0.89
20	DISCOVERY LTD	- -	南アフリカ 株式 金融	1,254,939	149.78 南アフリカ・ラ ンド	1,428,750,939	0.87
21	HYPERA SA ON	- -	ブラジル 株式 ヘルスケア	1,716,600	29.35 ブラジル・レアル	1,416,814,790	0.86
22	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	- -	インドネシア 株式 金融	6,240,600	29,675.00 インドネシア・ ルピー	1,411,515,646	0.86
23	TURKEY REP OF	5.75 2047/5/11	トルコ 債券 国債証券	15,490,000	84.092 米ドル	1,403,861,070	0.86
24	BRAZIL NTNBR I/L	6.0 2028/8/15	ブラジル 債券 国債証券	12,700,000	384.3608 ブラジル・レアル	1,372,709,621	0.84

25	GREECE GOVT BOND EUR 144A LIFE/REG S	3.375 2025/2/15	ギリシャ 債券 国債証券	9,955,000	109.6766 ユーロ	1,337,813,392	0.81
26	DOMINICAN REPUBLIC REG S	5.95 2027/1/25	ドミニカ共和 国 債券 国債証券	11,311,000	108.126 米ドル	1,318,102,461	0.80
27	PEMEX MXN	7.47 2026/11/12	メキシコ 債券 社債券	293,340,000	79.5041 メキシコ・ペソ	1,310,086,779	0.80
28	REPUBLIC OF BENIN EUR REG S	5.75 2026/3/26	ベニン 債券 国債証券	10,250,000	102.25 ユーロ	1,284,184,661	0.78
29	SRI LANKA REP OF REG S	6.2 2027/5/11	スリランカ 債券 国債証券	12,435,000	94.978 米ドル	1,272,877,575	0.78
30	CEMIG REG S SR UNSEC	9.25 2024/12/5	ブラジル 債券 社債券	9,810,000	115.175 米ドル	1,217,713,890	0.74

(注) 投資比率は、キャピタル・グループ・エマージング・マーケッツ・トータル・オポチュニティーズ(LUX)の純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

(参考) 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)の投資対象である日本短期債券マザーファンドの投資有価証券の明細

2019年1月23日現在

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	
日本	第4回クレディ・ア グリコル・エス・ エー円貨社債 (2014)	0.425	2019/11/28	社債券	100,000	100.208	100,208,000	5.39
日本	第19回ルノー円貨社 債(2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	99.503	99,503,000	5.35
日本	第11回ウエストパッ ク・バンキング・ コーポレーション円 貨社債(2016)	0.3	2021/1/22	社債券	100,000	100.213	100,213,000	5.39
日本	第3回ソシエテ・ ジェネラル非上位円 貨社債(2018)	0.804	2023/10/12	社債券	100,000	98.616	98,616,000	5.30
日本	第488回中部電力	1.562	2019/2/25	社債券	100,000	100.127	100,127,000	5.38
日本	第521回関西電力	0.18	2023/9/20	社債券	100,000	99.863	99,863,000	5.37
日本	第4回富士フイルム ホールディングス (社債間限定同順位 特約付)	0.005	2020/3/3	社債券	100,000	99.949	99,949,000	5.37

日本	第50回日本電気(社債間限定同順位特約付)	0.29	2022/6/15	社債券	100,000	100.151	100,151,000	5.38
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	100.277	100,277,000	5.39
日本	第1回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.12	2020/10/30	社債券	100,000	100.148	100,148,000	5.38
日本	第22回あおぞら銀行(社債間限定同順位特約付)	0.1	2021/12/10	社債券	100,000	99.968	99,968,000	5.37
日本	第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	102.834	102,834,000	5.53
日本	第6回りそな銀行(劣後特約付)	2.084	2020/3/4	社債券	100,000	102.197	102,197,000	5.49
日本	第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	102.859	102,859,000	5.53
日本	第22回東京センチュリーリース(社債間限定同順位特約付)	0.06	2021/4/13	社債券	100,000	99.898	99,898,000	5.37
日本	第75回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.309	2023/2/28	社債券	100,000	99.826	99,826,000	5.37
日本	第69回日立キャピタル(社債間限定同順位特約付)	0.08	2020/12/18	社債券	100,000	100.026	100,026,000	5.38
日本	第33回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付)	0.297	2020/6/4	社債券	100,000	100.321	100,321,000	5.39

(注) 投資比率は、日本短期債券マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

(注) 当該情報は委託会社が入手可能な直近日(2019年1月23日)現在の情報です。

#### 【投資不動産物件】

キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF(米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

(参考) キャピタル・エマージング・ストラテジー・マザーファンド(米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF(米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

（参考）キャピタル・エマージング・ストラテジー・マザーファンド（米ドル売り円買い）

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF（米ドル売り円買い）

期	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期 (2016年11月21日)	491,832,437	491,832,437	1.0145	1.0145
第2期 (2017年11月20日)	3,998,622,434	3,998,622,434	1.1670	1.1670
第3期 (2018年11月20日)	7,028,968,271	7,028,968,271	1.0482	1.0482
2018年 6月末日	6,727,342,707		1.0882	
7月末日	7,209,895,561		1.1110	
8月末日	7,018,009,099		1.0713	
9月末日	6,839,725,163		1.0759	
10月末日	6,638,209,224		1.0285	
11月末日	6,854,274,967		1.0519	
12月末日	6,712,076,984		1.0254	
2019年 1月末日	6,962,952,143		1.0771	
2月末日	7,053,519,067		1.0933	
3月末日	7,062,310,870		1.0904	
4月末日	7,067,899,258		1.1013	
5月末日	6,892,385,376		1.0700	
6月末日	6,797,675,644		1.1226	

(注)表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

【分配の推移】

キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF（米ドル売り円買い）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2015年12月30日～2016年11月21日	0
第2期	2016年11月22日～2017年11月20日	0
第3期	2017年11月21日～2018年11月20日	0

【収益率の推移】

## キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF（米ドル売り円買い）

期	計算期間	収益率（％）
第1期	2015年12月30日～2016年11月21日	1.5
第2期	2016年11月22日～2017年11月20日	15.0
第3期	2017年11月21日～2018年11月20日	10.2
第4中間計算期間末	2018年11月21日～2019年 5月20日	1.9

(注)第1期の収益率は、計算期末の基準価額（分配付の額）から設定日の基準価額を控除した額を設定日の基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数です。

(注)収益率は、計算期末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期末の基準価額（分配落ちの額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。

## （４）【設定及び解約の実績】

## キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF（米ドル売り円買い）

下記計算期間中の設定および解約の実績ならびに当該計算期間末の発行済口数は次のとおりです。

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	2015年12月30日～2016年11月21日	492,067,019	7,258,469	484,808,550
第2期	2016年11月22日～2017年11月20日	3,034,441,372	92,932,185	3,426,317,737
第3期	2017年11月21日～2018年11月20日	4,591,689,336	1,312,531,045	6,705,476,028
第4中間計算期間末	2018年11月21日～2019年 5月20日	459,486,007	743,681,800	6,421,280,235

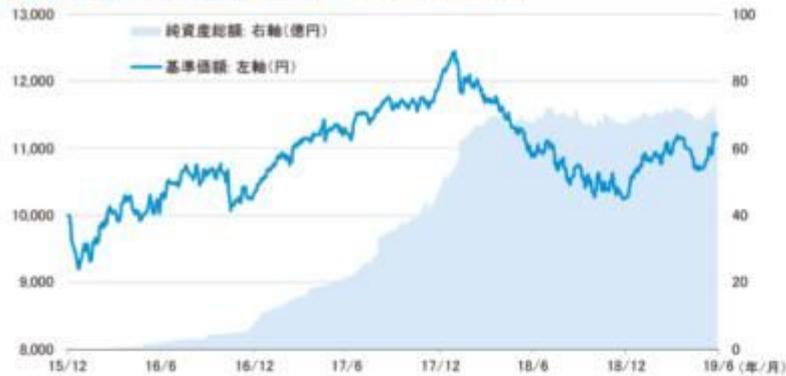
(注)第1期の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 参考情報

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移(設定～2019年6月28日)



## 分配金の推移

第1期	2016年11月	0円
第2期	2017年11月	0円
第3期	2018年11月	0円
	設定来累計	0円
分配金は1万口当たり、税引前		

## 主要な資産の状況(2019年6月28日現在)

&lt;キャピタル・エマージング・ストラテジー・マザーファンド(米ドル売り円買い)の主要な資産の状況等&gt;

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ(LUX)(クラス Cfd-JPY)	99.93
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.06

&lt;キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ(LUX)の主要な資産の状況等&gt;

(2019年6月28日現在)

## 上位10銘柄

順位	銘柄名	国名/地域名	資産	業種/証券種別	投資比率(%)
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD COM	韓国	株式	情報技術	1.89
2	PAKISTAN REP REG S 6.875% 12-05-27	パキスタン	債券	国債証券	1.81
3	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	1.56
4	BONOS MEXICAN MXN 10.0% 12-05-24	メキシコ	債券	国債証券	1.45
5	AMERICA MOVIL SAB DE CV L ADR	メキシコ	株式	コミュニケーション・サービス	1.24
6	DP WORLD PLC	アラブ首長国連邦	株式	資本財・サービス	1.12
7	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	香港	株式	一般消費財・サービス	1.10
8	BARRICK GOLD CORP (USD)	カナダ	株式	素材	1.08
9	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO	台湾	株式	情報技術	1.06
10	CENTRAL BANK OF TURKSA EUR REG S SR UNSEC 6.75% 10-31-23	チュニジア	債券	国債証券	1.05

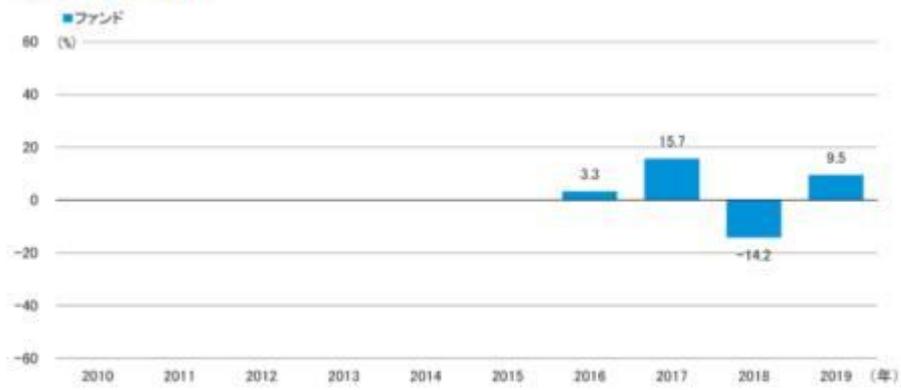
## 資産別構成比率

資産	証券種別	投資比率(%)
株式		42.67
債券		53.27
	国債証券	47.32
	社債券	5.56
	その他証券	0.40
現金・その他		4.05

## 国別構成比率

国名	株式	債券	合計	投資比率(%)
中国	5.97	2.68		8.65
ブラジル	4.83	3.30		8.14
メキシコ	1.24	5.35		6.59
インド	3.76	1.48		5.25
ロシア	2.81	1.62		4.43
その他国	24.05	38.85		62.90
現金・その他				4.05

## 年間収益率の推移



ファンドにはベンチマークはありません。

ファンドの年間収益率は、税引前分配金を再投資したものとして算出。

2019年は6月末までの収益率を表示。

\*ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

\*ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

## 第3【ファンドの経理状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表につきましては、以下の内容が追加されます。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間（2018年11月21日から2019年5月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF（米ドル売り円買い）】

## (1) 【中間貸借対照表】

	(単位：円)	
	第3期 2018年11月20日現在	第4期中間計算期間 2019年5月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	86,442,072	48,320,691
親投資信託受益証券	7,019,813,354	6,849,451,635
流動資産合計	7,106,255,426	6,897,772,326
資産合計	7,106,255,426	6,897,772,326
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	33,940,000	6,000,000
未払解約金	8,616,972	3,572,139
未払受託者報酬	750,159	746,521
未払委託者報酬	33,194,544	30,989,682
未払利息	236	139
その他未払費用	785,244	795,495
流動負債合計	77,287,155	42,103,976
負債合計	77,287,155	42,103,976
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,705,476,028	6,421,280,235
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	323,492,243	434,388,115
元本等合計	7,028,968,271	6,855,668,350
純資産合計	7,028,968,271	6,855,668,350
負債純資産合計	7,106,255,426	6,897,772,326

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	第3期中間計算期間 自 2017年11月21日 至 2018年5月20日	第4期中間計算期間 自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	234,379,913	160,127,062
<b>営業収益合計</b>	<b>234,379,913</b>	<b>160,127,062</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	38,028	13,499
受託者報酬	626,835	746,521
委託者報酬	27,737,429	30,989,682
その他費用	831,609	795,495
<b>営業費用合計</b>	<b>29,233,901</b>	<b>32,545,197</b>
営業利益又は営業損失( )	263,613,814	127,581,865
経常利益又は経常損失( )	263,613,814	127,581,865
中間純利益又は中間純損失( )	263,613,814	127,581,865
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	4,578,306	14,188,569
期首剰余金又は期首欠損金( )	572,304,697	323,492,243
剰余金増加額又は欠損金減少額	612,126,823	33,614,036
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	612,126,823	33,614,036
剰余金減少額又は欠損金増加額	119,801,028	36,111,460
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	119,801,028	36,111,460
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>分配金</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
中間剰余金又は中間欠損金( )	805,594,984	434,388,115

## (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-----------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2018年11月20日現在	第4期中間計算期間 2019年5月20日現在
1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 6,705,476,028口	1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数 6,421,280,235口
2. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0482円 (1万口当たり純資産額) (10,482円)	2. 当該中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0676円 (1万口当たり純資産額) (10,676円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 自 2017年11月21日 至 2018年11月20日	第4期中間計算期間 自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

当ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第3期	第4期中間計算期間
	自 2017年11月21日 至 2018年11月20日	自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
期首元本額	3,426,317,737円	6,705,476,028円
期中追加設定元本額	4,591,689,336円	459,486,007円
期中一部解約元本額	1,312,531,045円	743,681,800円

（参考）

#### キャピタル・エマージング・ストラテジー・マザーファンド（米ドル売り円買い）

当ファンドは、「キャピタル・エマージング・ストラテジー・マザーファンド（米ドル売り円買い）」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

開示対象ファンドの中間計算期間末日（以下「計算日」という。）における同マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

#### 貸借対照表

（単位：円）

2019年5月20日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	466
投資信託受益証券	4,880,764
投資証券	7,148,358,877
未収入金	6,008,000
流動資産合計	7,159,248,107
資産合計	7,159,248,107
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	6,000,000
未払解約金	8,000
流動負債合計	6,008,000
負債合計	6,008,000
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	7,183,168,760
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	29,928,653
元本等合計	7,153,240,107
純資産合計	7,153,240,107
負債純資産合計	7,159,248,107

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-----------------	--

	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>
--	---

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年5月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数		7,183,168,760口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	29,928,653円
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	0.9958円
	(1万口当たり純資産額)	(9,958円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) 投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

開示対象ファンドの中間計算期間における当該親投資信託の元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	2019年5月20日現在
同計算期間の期首元本額	7,521,860,618円
同計算期間の追加設定元本額	356,876,910円
同計算期間の一部解約元本額	695,568,768円
計算日の元本額	7,183,168,760円
元本額の内訳	
キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドAコース（年2回決算/米ドル売り円買い）	293,191,299円
キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドCコース（毎月分配/米ドル売り円買い）	11,636,795円
キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF（米ドル売り円買い）	6,878,340,666円

キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ（LUX）

「キャピタル・エマージング・ストラテジー・マザーファンド（米ドル売り円買い）」は、円建ての「キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ（LUX）（クラスC f d h J P Y）」（ルクセンブルク籍外国投資法人（以下、当外国投資法人といいます。）の発行する外国投資証券）を主な投資対象としております。

当外国投資法人を含むアンブレラファンド（CIP）については、2018年3月31日付けで、ルクセンブルクにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務書類が作成されております。この財務書類は独立監査人であるプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コオペラティブの監査を受けております。以下の「投資明細表」および「損益および純資産変動計算書」は、原文の財務書類から委託会社が抜粋・翻訳したものでありますが、これらは監査意見の対象外であります。

キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ（LUX）

投資明細表

2018年3月31日現在

投資銘柄	通貨	数量/額面	評価額 (USD)	投資比率 (%)
公的取引所に上場している譲渡可能な有価証券と短期金融商品 債券				
<i>Argentina</i>				
Argentina Government Bond 6.875% 22/04/2021	USD	21,730,000	23,074,544	0.86
Argentina Government Bond 4.625% 11/01/2023	USD	21,820,000	21,061,973	0.78
Argentina Government Bond 3.375% 15/01/2023	EUR	9,000,000	10,984,350	0.41
Argentina Government Bond 7.5% 22/04/2026	USD	25,520,000	27,319,160	1.01
Argentina Government Bond, FRN 27.25% 21/06/2020	ARS	250,023,000	13,199,732	0.49
Argentina Treasury Bill 0% 13/04/2018	USD	5,000,000	4,995,360	0.19
Argentina Treasury Bill 0% 13/04/2018	USD	7,600,000	7,594,566	0.28

Argentina Treasury Bill 0% 27/04/2018	USD	3,637,616	3,629,412	0.13
Argentina Treasury Bill 0% 24/05/2018	USD	20,769,403	20,684,513	0.77
Argentina Treasury Bill 0% 11/05/2018	USD	526,000	524,655	0.02
Argentina Treasury Bill 0% 15/06/2018	USD	18,902,652	18,791,688	0.70
Argentina Treasury Bill 0% 29/06/2018	USD	9,144,688	9,080,917	0.34
Argentina Treasury Bill 0% 13/07/2018	USD	24,381,316	24,191,301	0.90
Argentina Treasury Bill 0% 27/07/2018	USD	10,549,668	10,476,699	0.39
Argentina Treasury Bill 0% 10/08/2018	USD	5,902,297	5,859,561	0.22
Argentina Treasury Bill 0% 14/09/2018	ARS	281,584,500	14,018,332	0.52
Argentina Treasury BONCER 2.5% 22/07/2021	ARS	218,000,000	15,146,122	0.56
Argentine Bonos del Tesoro 16% 17/10/2023	ARS	38,900,500	1,891,386	0.07
YPF SA, Reg. S 8.5% 28/07/2025	USD	3,270,000	3,617,699	0.13
			236,141,970	8.77
<i>Armenia</i>				
Armenia Government Bond, Reg. S 6% 30/09/2020	USD	8,498,000	8,819,224	0.33
			8,819,224	0.33
<i>Bahrain</i>				
Bahrain Government Bond, Reg. S 6.75% 20/09/2029	USD	29,329,000	27,466,022	1.02
Bahrain Government Bond, Reg. S 7.5% 20/09/2047	USD	2,200,000	2,013,000	0.07
			29,479,022	1.09
<i>Brazil</i>				
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/07/2020	BRL	3,000,000	772,614	0.03
Brazil Notas do Tesouro Nacional 6% 15/08/2018	BRL	4,435,000	4,167,245	0.15
Brazil Notas do Tesouro Nacional 100% 01/01/2021	BRL	10,500,000	33,424,272	1.24
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2025	BRL	63,600,000	20,009,129	0.74
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2027	BRL	7,400,000	2,316,088	0.09
BRAZIL NTN, FRN 183.228% 15/08/2024	BRL	440,000	4,451,388	0.17
Cemig Geracao e Transmissao SA, Reg. S 9.25% 05/12/2024	USD	12,905,000	13,914,816	0.52
Vale Overseas Ltd. 6.25% 10/08/2026	USD	4,095,000	4,597,866	0.17
			83,653,418	3.11
<i>Chile</i>				
Banco Santander Chile, Reg. S, FRN 3.91% 07/06/2018	USD	7,660,000	7,686,810	0.29
Emgesa SA ESP, Reg. S 8.75% 25/01/2021	COP	2,937,000,000	1,104,193	0.04
			8,791,003	0.33
<i>China</i>				
Bank of China Ltd., Reg. S 1.875% 09/11/2019	USD	6,100,000	5,983,923	0.22
China Development Bank Corp., Reg. S, FRN 2.575% 06/03/2020	USD	5,725,000	5,731,526	0.21
Export—Import Bank of China, Reg. S, FRN 2.647% 08/06/2020	USD	15,275,000	15,306,925	0.57
State Grid Overseas Investment 2014 Ltd., Reg. S 2.75% 07/05/2019	USD	8,000,000	7,984,921	0.30
			35,007,295	1.30
<i>Colombia</i>				
Ecopetrol SA 5.875% 18/09/2023	USD	3,210,000	3,442,725	0.13
Ecopetrol SA 5.375% 26/06/2026	USD	8,026,000	8,383,157	0.31

			11,825,882	0.44
<i>Dominican Republic</i>				
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 5.5% 27/01/2025	USD	8,865,000	9,143,893	0.34
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.875% 29/01/2026	USD	400,000	444,724	0.02
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 5.95% 25/01/2027	USD	6,017,000	6,302,808	0.23
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.85% 27/01/2045	USD	6,430,000	6,952,437	0.26
			22,843,862	0.85
<i>Egypt</i>				
Arab Republic of Egypt 18.4% 30/05/2024	EGP	80,150,000	5,199,912	0.19
Arab Republic of Egypt 15.9% 09/09/2024	EGP	375,875,000	22,357,207	0.83
			27,557,119	1.02
<i>Guatemala</i>				
Guatemala Government Bond, Reg. S 4.5% 03/05/2026	USD	2,300,000	2,283,325	0.09
Guatemala Government Bond, Reg. S 4.375% 05/06/2027	USD	3,150,000	3,071,250	0.11
			5,354,575	0.20
<i>Honduras</i>				
Honduras Government Bond, Reg. S 8.75% 16/12/2020	USD	3,720,000	4,124,141	0.15
Honduras Government Bond, Reg. S 7.5% 15/03/2024	USD	1,920,000	2,121,600	0.08
Honduras Government Bond, Reg. S 6.25% 19/01/2027	USD	6,885,000	7,311,663	0.27
			13,557,404	0.50
<i>Hungary</i>				
Hungary Government Bond 5.75% 22/11/2023	USD	17,940,000	19,851,507	0.74
			19,851,507	0.74
<i>India</i>				
India Government Bond 8.6% 02/06/2028	INR	975,800,000	15,870,176	0.59
			15,870,176	0.59
<i>Indonesia</i>				
Indonesia Government Bond, Reg. S 3.75% 25/04/2022	USD	1,300,000	1,304,623	0.05
Indonesia Government Bond, Reg. S 4.125% 15/01/2025	USD	14,600,000	14,743,722	0.55
Indonesia Government Bond, Reg. S 4.75% 08/01/2026	USD	8,330,000	8,721,435	0.32
			24,769,780	0.92
<i>Kenya</i>				
Kenya Government Bond 12.5% 18/11/2024	KES	715,000,000	7,517,147	0.28
Kenya Government Bond, Reg. S 5.875% 24/06/2019	USD	10,375,000	10,664,058	0.40
			18,181,205	0.68
<i>Mexico</i>				
Comision Federal de Electricidad 7.35% 25/11/2025	MXN	23,320,000	1,173,476	0.04

Mexican Bonos 8% 11/06/2020	MXN	84,000,000	4,697,254	0.17
Mexican Bonos 10% 05/12/2024	MXN	228,850,000	14,453,300	0.54
Mexican Bonos 5.75% 05/03/2026	MXN	93,500,000	4,675,000	0.17
Mexican Udibonos 4.5% 04/12/2025	MXN	7,300,000	2,568,933	0.10
Petroleos Mexicanos 7.47% 12/11/2026	MXN	194,000,000	9,452,719	0.35
Red de Carreteras de Occidente SAPIB de CV, Reg. S 9% 10/06/2028	MXN	73,470,000	3,915,507	0.15
			40,936,189	1.52
<i>Netherlands</i>				
IHS Netherlands Holdco BV, Reg. S 9.5% 27/10/2021	USD	3,650,000	3,839,041	0.14
			3,839,041	0.14
<i>Nigeria</i>				
Federal Republic of Nigeria 14.5% 15/07/2021	NGN	4,026,530,000	11,457,715	0.43
Federal Republic of Nigeria 16.288% 17/03/2027	NGN	1,715,000,000	5,393,198	0.20
			16,850,913	0.63
<i>Pakistan</i>				
Pakistan Government Bond, Reg. S 7.25% 15/04/2019	USD	5,560,000	5,675,337	0.21
Second Pakistan International Sukuk Co. Ltd. (The), Reg. S 6.75% 03/12/2019	USD	24,220,000	24,774,783	0.92
Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd. (The), Reg. S 5.5% 13/10/2021	USD	14,380,000	14,156,434	0.53
			44,606,554	1.66
<i>Panama</i>				
ENA Norte Trust, Reg. S 4.95% 25/04/2028	USD	3,184,991	3,273,374	0.12
Panama Government Bond 7.125% 29/01/2026	USD	3,200,000	3,960,000	0.15
Panama Government Bond 4.5% 15/05/2047	USD	6,700,000	6,817,250	0.25
			14,050,624	0.52
<i>Paraguay</i>				
Paraguay Government Bond, Reg. S 4.7% 27/03/2027	USD	8,740,000	8,871,100	0.33
			8,871,100	0.33
<i>Peru</i>				
Peru Government Bond, Reg. S, 144A 6.15% 12/08/2032	PEN	18,755,000	6,418,634	0.24
			6,418,634	0.24
<i>Poland</i>				
Poland Government Bond 0% 25/04/2019	PLN	67,000,000	19,305,450	0.72
Poland Government Bond 5.75% 23/09/2022	PLN	2,500,000	839,723	0.03
Poland Government Bond 3.25% 25/07/2025	PLN	64,750,000	19,380,076	0.72
			39,525,249	1.47
<i>Russian Federation</i>				
Russian Federal Bond — OFZ 7.6% 14/04/2021	RUB	754,600,000	13,620,170	0.51
Russian Federal Bond — OFZ 7.5% 18/08/2021	RUB	737,500,000	13,304,159	0.49
Russian Federal Bond — OFZ 7% 25/01/2023	RUB	2,342,752,000	41,947,887	1.56
Russian Federal Bond — OFZ 7.05% 19/01/2028	RUB	240,000,000	4,223,874	0.16
			73,096,090	2.72
<i>Saudi Arabia</i>				
Saudi Government Bond, Reg. S 3.25% 26/10/2026	USD	12,600,000	11,820,778	0.44

			11,820,778	0.44
<i>Slovenia</i>				
Slovenia Government Bond, Reg. S 4.75%	USD	12,140,000	12,174,271	0.45
10/05/2018				
			12,174,271	0.45
<i>South Africa</i>				
Myriad International Holdings BV, Reg. S 5.5%	USD	2,800,000	2,977,254	0.11
21/07/2025				
South Africa Government Bond 7.75% 28/02/2023	ZAR	29,300,000	2,514,151	0.09
South Africa Government Bond 6.25% 31/03/2036	ZAR	44,400,000	2,924,131	0.11
			8,415,536	0.31
<i>South Korea</i>				
Export—Import Bank of Korea 1.5% 21/10/2019	USD	4,060,000	3,970,712	0.15
			3,970,712	0.15
<i>Spain</i>				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Reg. S, FRN 0.271% 12/04/2022	EUR	9,700,000	12,080,690	0.45
			12,080,690	0.45
<i>Sri Lanka</i>				
National Savings Bank, Reg. S 8.875% 18/09/2018	USD	46,150,000	47,001,467	1.75
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6%	USD	7,600,000	7,747,387	0.29
14/01/2019				
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 5.75%	USD	4,080,000	4,135,296	0.15
18/01/2022				
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 5.875%	USD	3,640,000	3,698,899	0.14
25/07/2022				
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.825%	USD	5,138,000	5,294,915	0.20
18/07/2026				
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.2%	USD	14,555,000	14,353,573	0.53
11/05/2027				
			82,231,537	3.06
<i>Turkey</i>				
Turkey Government Bond 9.5% 12/01/2022	TRY	17,050,000	3,837,579	0.14
Turkey Government Bond 3% 23/02/2022	TRY	42,070,000	17,581,897	0.65
Turkey Government Bond 11% 02/03/2022	TRY	17,077,000	4,025,451	0.15
Turkey Government Bond 6.25% 26/09/2022	USD	8,350,000	8,857,279	0.33
Turkey Government Bond 4.25% 14/04/2026	USD	12,200,000	11,133,183	0.41
Turkey Government Bond 6% 25/03/2027	USD	10,000,000	10,143,170	0.38
Turkey Government Bond 5.75% 11/05/2047	USD	10,500,000	9,352,392	0.35
			64,930,951	2.41
<i>Ukraine</i>				
Ukraine Government Bond, Reg. S 7.75%	USD	4,550,000	4,695,541	0.17
01/09/2024				
			4,695,541	0.17
<i>United States of America</i>				
US Treasury Inflation Indexed 0.125% 15/04/2020	USD	20,500,000	21,626,689	0.80
US Treasury Inflation Indexed 0.125% 15/04/2022	USD	32,100,000	32,273,905	1.20
Weatherford International Ltd. 9.875% 15/02/2024	USD	1,750,000	1,605,625	0.06
			55,506,219	2.06
<i>Uruguay</i>				

Uruguay Government Bond, Reg. S 9.875% 20/06/2022	UYU	456,755,000	16,412,639	0.61
Uruguay Government Bond, Reg. S 8.5% 15/03/2028	UYU	213,417,000	6,964,789	0.26
			23,377,428	0.87
<i>Zambia</i>				
Zambia Government Bond 11% 21/11/2021	ZMW	107,175,000	9,430,498	0.35
Zambia Government Bond 13% 21/11/2026	ZMW	19,825,000	1,590,066	0.06
			11,020,564	0.41
<b>債券合計</b>			1,100,122,063	40.88
<b>転換社債型新株予約権付社債</b>				
<i>India</i>				
Piramal Enterprises Ltd. CV DEB 7.8% 26/04/2019*	INR	951,400	13,843,246	0.51
			13,843,246	0.51
<b>転換社債型新株予約権付社債合計</b>			13,843,246	0.51
<b>株式</b>				
<i>Argentina</i>				
Loma Negra Cia Industrial Argentina SA, ADR	USD	722,361	15,400,737	0.57
			15,400,737	0.57
<i>Australia</i>				
Newcrest Mining Ltd.	AUD	1,337,892	20,099,228	0.75
			20,099,228	0.75
<i>Brazil</i>				
CCR SA	BRL	6,411,729	24,276,185	0.90
Hypera SA	BRL	1,552,500	17,004,165	0.63
IRB Brasil Resseguros S/A	BRL	951,000	12,057,993	0.45
Lojas Americanas SA	BRL	361,400	1,534,728	0.06
Lojas Americanas SA Preference	BRL	2,625,600	14,983,205	0.56
Nexa Resources SA	USD	1,293,753	22,653,615	0.84
Petroleo Brasileiro SA, ADR	USD	339,813	4,804,956	0.18
Petroleo Brasileiro SA, ADR Preference	USD	1,178,600	15,310,014	0.57
Vale SA, ADR	USD	1,654,401	21,043,981	0.78
			133,668,842	4.97
<i>Canada</i>				
Barrick Gold Corp.	USD	1,672,800	20,826,360	0.78
Nutrien Ltd.	CAD	235,400	11,125,475	0.41
			31,951,835	1.19
<i>Chile</i>				
Enel Americas SA, ADR	USD	1,259,139	14,631,195	0.54
Inversiones La Construccion SA	CLP	1,021,200	20,094,254	0.75
			34,725,449	1.29
<i>China</i>				
Alibaba Group Holding Ltd., ADR	USD	11,700	2,147,418	0.08
Bank of China Ltd. 'H'	HKD	29,845,000	16,047,846	0.60
Boer Power Holdings Ltd.	HKD	14,026,000	2,787,989	0.10
Brilliance China Automotive Holdings Ltd.	HKD	1,860,000	3,882,036	0.14
China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 'H'	HKD	854,800	3,828,446	0.14
China Resources Land Ltd.	HKD	1,402,000	5,100,196	0.19
China Unicom Hong Kong Ltd.	HKD	3,128,000	3,945,796	0.15

Ctrip.com International Ltd., ADR	USD	398,500	18,578,070	0.69
Haitian International Holdings Ltd.	HKD	1,508,200	4,573,710	0.17
Hutchison China MediTech Ltd., ADR	USD	244,063	7,214,502	0.27
IMAX China Holding, Inc.	HKD	1,773,563	5,593,125	0.21
Longfor Properties Co. Ltd.	HKD	6,567,500	20,083,714	0.75
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co. Ltd. 'H'	HKD	5,058,000	31,064,085	1.15
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd. 'H'	HKD	1,662,900	4,449,571	0.16
			129,296,504	4.80
<i>Czech Republic</i>				
Moneta Money Bank A/S	CZK	969,093	4,013,614	0.15
			4,013,614	0.15
<i>Denmark</i>				
Carlsberg A/S 'B'	DKK	220,577	26,242,350	0.98
			26,242,350	0.98
<i>Germany</i>				
Hapag-Lloyd AG	EUR	254,533	9,928,127	0.37
			9,928,127	0.37
<i>Greece</i>				
Titan Cement Co. SA	EUR	89,389	2,216,272	0.08
			2,216,272	0.08
<i>Hong Kong</i>				
AIA Group Ltd.	HKD	2,492,600	21,088,873	0.78
Chow Sang Sang Holdings International Ltd.	HKD	4,306,700	9,054,433	0.34
CK Asset Holdings Ltd.	HKD	521,000	4,371,457	0.16
Galaxy Entertainment Group Ltd.	HKD	2,581,000	23,431,796	0.87
Sands China Ltd.	HKD	5,875,600	31,593,474	1.18
WH Group Ltd.	HKD	23,789,199	25,340,711	0.94
			114,880,744	4.27
<i>India</i>				
Bharti Airtel Ltd.	INR	3,345,123	20,448,724	0.76
Housing Development Finance Corp. Ltd.	INR	151,415	4,238,209	0.16
ICICI Bank Ltd.	INR	8,112,413	34,621,762	1.29
IDFC Bank Ltd.	INR	11,704,635	8,497,394	0.32
Info Edge India Ltd.	INR	852,336	15,360,466	0.57
Lupin Ltd.	INR	571,296	6,445,526	0.24
Piramal Enterprises Ltd.	INR	104,834	3,910,438	0.14
Steel Authority of India Ltd.	INR	12,448,649	13,398,841	0.50
Tata Steel Ltd.	INR	2,996,717	26,237,820	0.97
Torrent Power Ltd.	INR	1,771,522	6,226,784	0.23
			139,385,964	5.18
<i>Indonesia</i>				
Astra International Tbk. PT	IDR	7,274,800	3,857,348	0.14
Bank Central Asia Tbk. PT	IDR	7,013,000	11,868,742	0.44
Matahari Department Store Tbk. PT	IDR	5,998,612	4,771,004	0.18
Semen Indonesia Persero Tbk. PT	IDR	3,807,800	2,862,592	0.11
Surya Citra Media Tbk. PT	IDR	41,551,200	8,178,954	0.30
			31,538,640	1.17
<i>Italy</i>				
Tenaris SA, ADR	USD	399,800	13,861,066	0.52
			13,861,066	0.52

<i>Japan</i>				
Murata Manufacturing Co. Ltd.	JPY	31,200	4,248,748	0.16
			4,248,748	0.16
<i>Mexico</i>				
America Movil SAB de CV, ADR 'L'	USD	2,488,400	47,503,556	1.76
Grupo Sanborns SAB de CV	MXN	3,252,100	3,556,202	0.13
Urbi Desarrollos Urbanos SAB de CV	MXN	513,537	188,692	0.01
			51,248,450	1.90
<i>Norway</i>				
BW LPG Ltd.	NOK	4,937,454	22,725,843	0.84
			22,725,843	0.84
<i>Philippines</i>				
Bank of the Philippine Islands	PHP	2,360,000	5,291,936	0.20
Bloomberry Resorts Corp.	PHP	37,202,200	10,224,322	0.38
			15,516,258	0.58
<i>Russian Federation</i>				
Alrosa PJSC	USD	15,466,977	24,625,668	0.91
Global Ports Investments plc, GDR	USD	2,109,712	8,143,488	0.30
Globaltrans Investment plc, GDR	USD	161,745	1,918,296	0.07
MegaFon PJSC	USD	30,166	283,296	0.01
MegaFon PJSC, GDR	USD	505,300	4,997,417	0.19
Sberbank of Russia PJSC, ADR	USD	196,500	3,660,795	0.14
TCS Group Holding plc, GDR	USD	627,600	13,775,820	0.51
Yandex NV 'A'	USD	573,500	22,624,575	0.84
			80,029,355	2.97
<i>Singapore</i>				
City Developments Ltd.	SGD	2,089,400	20,716,318	0.77
DBS Group Holdings Ltd.	SGD	727,300	15,254,357	0.57
Oversea — Chinese Banking Corp. Ltd.	SGD	1,765,900	17,266,398	0.64
			53,237,073	1.98
<i>South Africa</i>				
Discovery Ltd.	ZAR	997,543	14,366,473	0.54
MTN Group Ltd.	ZAR	380,000	3,820,302	0.14
Naspers Ltd. 'N'	ZAR	100,988	24,668,241	0.92
Shoprite Holdings Ltd.	ZAR	167,185	3,566,896	0.13
			46,421,912	1.73
<i>South Korea</i>				
Hyundai Motor Co.	KRW	132,721	17,867,965	0.66
Hyundai Motor Co. Preference	KRW	60,321	5,274,338	0.20
Samsung Electronics Co. Ltd.	KRW	13,209	30,386,029	1.13
			53,528,332	1.99
<i>Spain</i>				
Banco Santander SA	EUR	2,284,399	14,883,391	0.55
			14,883,391	0.55
<i>Switzerland</i>				
LafargeHolcim Ltd.	CHF	182,912	10,006,587	0.37
			10,006,587	0.37
<i>Taiwan</i>				
Asustek Computer, Inc.	TWD	375,000	3,491,872	0.13
CTCI Corp.	TWD	9,103,000	14,829,801	0.55

Ginko International Co. Ltd.	TWD	495,000	3,675,532	0.14
MediaTek, Inc.	TWD	1,142,000	12,964,365	0.48
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	4,471,179	37,417,007	1.39
			72,378,577	2.69
<i>United Arab Emirates</i>				
DP World Ltd.	USD	627,331	14,114,948	0.53
First Abu Dhabi Bank PJSC	AED	4,972,567	15,839,434	0.59
Union National Bank PJSC	AED	7,047,394	6,811,301	0.25
			36,765,683	1.37
<i>United Kingdom</i>				
British American Tobacco plc	GBP	448,500	25,994,131	0.96
PZ Cussons plc	GBP	4,754,097	15,247,616	0.57
Tullow Oil plc	GBP	1,267,815	3,486,339	0.13
			44,728,086	1.66
<i>United States of America</i>				
AES Corp.	USD	2,962,700	33,685,899	1.25
EnSCO plc 'A'	USD	5,459,450	23,966,985	0.89
MercadoLibre, Inc.	USD	80,200	28,582,478	1.06
Weatherford International plc	USD	1,501,900	3,439,351	0.13
			89,674,713	3.33
株式合計			1,302,602,380	48.41
公的取引所に上場している譲渡可能な有価証券と短期金融商品の合計			2,416,567,689	89.80
その他の規制のある市場で取引されている譲渡可能な有価証券と短期金融商品				
債券				
<i>Brazil</i>				
QGOG Atlantic, Reg. S 5.25% 30/07/2019	USD	112,500	110,250	-
			110,250	-
<i>China</i>				
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 3.231% 13/11/2019	USD	8,000,000	8,004,064	0.30
			8,004,064	0.30
<i>Egypt</i>				
Egypt Treasury Bill 0% 03/04/2018	EGP	137,650,000	7,790,755	0.29
Egypt Treasury Bill 0% 24/07/2018	EGP	113,700,000	6,128,477	0.23
Egypt Treasury Bill 0% 10/04/2018	EGP	14,925,000	842,002	0.03
Egypt Treasury Bill 0% 17/04/2018	EGP	257,100,000	14,457,230	0.54
Egypt Treasury Bill 0% 01/05/2018	EGP	29,050,000	1,624,376	0.06
Egypt Treasury Bill 0% 08/05/2018	EGP	150,400,000	8,374,957	0.31
			39,217,797	1.46
<i>Mexico</i>				
BBVA Bancomer SA, Reg. S 6.5% 10/03/2021	USD	2,110,000	2,247,150	0.08
Elementia SAB de CV, Reg. S 5.5% 15/01/2025	USD	1,600,000	1,616,000	0.06
			3,863,150	0.14
<i>Nigeria</i>				
Nigeria Treasury Bill 0% 13/09/2018	NGN	2,650,000,000	6,788,363	0.25
			6,788,363	0.25
<i>Paraguay</i>				
Paraguay Government Bond, Reg. S 5.6% 13/03/2048	USD	10,825,000	11,041,500	0.41
			11,041,500	0.41

<i>Peru</i>					
Banco de Credito del Peru, Reg. S, FRN 6.875%	USD	5,610,000	6,123,371	0.23	
16/09/2026					
Banco de Credito del Peru, Reg. S, FRN 6.125%	USD	2,200,000	2,352,350	0.09	
24/04/2027					
			8,475,721	0.32	
<i>South Korea</i>					
KT Corp., Reg. S 2.625% 22/04/2019	USD	4,040,000	4,020,176	0.15	
			4,020,176	0.15	
債券合計			81,521,021	3.03	
転換社債型新株予約権付社債					
<i>United States of America</i>					
Weatherford International Ltd. 5.875% 01/07/2021	USD	24,056,000	21,624,828	0.80	
			21,624,828	0.80	
転換社債型新株予約権付社債合計			21,624,828	0.80	
その他の規制のある市場で取引されている譲渡可能な有価証券と短期金融商品の合計			103,145,849	3.83	
その他譲渡可能な有価証券と短期金融商品					
転換社債型新株予約権付社債					
<i>China</i>					
FU JI Food and Catering Services Holdings Ltd. 0%	CNY	3,500,000	-	-	
18/10/2010*§					
			-	-	
<i>United States of America</i>					
Cobalt International Energy, Inc. 2.625%	USD	6,645,000	149,513	0.01	
01/12/2019§					
Cobalt International Energy, Inc. 3.125%	USD	27,987,000	349,838	0.01	
15/05/2024§					
			499,351	0.02	
転換社債型新株予約権付社債合計			499,351	0.02	
新株予約権付社債					
<i>China</i>					
Midea Group Co. 11/10/2018*	USD	1,520,700	13,366,041	0.50	
			13,366,041	0.50	
新株予約権付社債合計			13,366,041	0.50	
その他譲渡可能な有価証券と短期金融商品の合計			13,865,392	0.52	
新規発行証券					
債券					
<i>Brazil</i>					
Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd., Reg. S	USD	1,200,291	1,161,282	0.05	
6.72% 01/12/2022					
Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd., Reg. S	USD	3,619,859	1,076,908	0.04	
7.72% 01/12/2026					
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd., Reg. S, FRN 0%	USD	571,938	14,012	-	
31/12/2049					
			2,252,202	0.09	
債券合計			2,252,202	0.09	
新規発行証券合計			2,252,202	0.09	
UCITS準拠ファンド、もしくは他の譲渡可能証券への集合投資事業 集団投資スキームー UCITS					
<i>Luxembourg</i>					
US Dollar Treasury Liquidity Fund — JPM US Dollar Treasury Liquidity Institutional (dist.)	USD	53,890,755	53,890,755	2.00	

	53,890,755	2.00
集団投資スキーム合計ー UCITS	53,890,755	2.00
UCITS準拠ファンド、もしくは他の譲渡可能証券への集合投資事業合計	53,890,755	2.00
投資総額	2,589,721,887	96.24
銀行預金	97,060,304	3.61
その他の純資産 / (負債)	4,229,169	0.15
純資産総額	2,691,011,360	100.00

\*債務不履行中

\*証券は取締役会により公正な価値で評価されている。

## 先物為替予約

買通貨	購入総額	売通貨	売却総額	決済日	カウンター ・パーティ	未実現利益 / (損失) (USD)	投資比率 (%)
USD	10,350,388	BRL	33,764,000	13/04/2018	J.P. Morgan	131,028	0.01
USD	5,841,672	TWD	169,759,000	27/04/2018	Citibank	10,349	-
先物為替予約の未実現損						141,377	0.01
CHF Hedged Share Class							
USD		CHF	6,884	20/04/2018	J.P. Morgan	59	-
						7,269	
EUR Hedged Share Class							
EUR	8,052	USD	9,896	20/04/2018	J.P. Morgan	23	-
USD	400,473	EUR	322,981	20/04/2018	J.P. Morgan	2,612	-
GBP Hedged Share Class							
GBP	449,507,420	USD	626,399,853	20/04/2018	J.P. Morgan	4,683,827	0.18
USD	16,037,931	GBP	11,313,033	20/04/2018	J.P. Morgan	155,056	-
ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現利益						4,841,577	0.18
先物為替予約の未実現利益合計						4,982,954	0.19
USD	4,915,733	EUR	4,025,000	05/04/2018	J.P. Morgan	(37,171)	-
USD	14,077,328	MXN	267,427,000	09/04/2018	Bank of America	(621,486)	(0.02)
USD	16,418,289	MXN	311,826,000	09/04/2018	J.P. Morgan	(720,864)	(0.03)
USD	9,281,438	KRW	9,969,657,000	12/04/2018	J.P. Morgan	(74,776)	-
CZK	399,924,490	USD	19,499,000	16/04/2018	Goldman Sachs	(115,288)	(0.01)
USD	10,607,771	GBP	7,641,000	16/04/2018	J.P. Morgan	(117,939)	(0.01)
USD	20,303,714	ZAR	241,066,000	16/04/2018	Citibank	(23,370)	-
HUF	4,891,324,150	USD	19,499,000	20/04/2018	Citibank	(212,406)	(0.01)
USD	4,955,498	GBP	3,550,000	20/04/2018	Goldman Sachs	(28,506)	-
USD	18,357,708	PLN	63,201,000	23/04/2018	Bank of America	(109,424)	-
USD	2,840,238	KRW	3,061,493,000	27/04/2018	Citibank	(34,286)	-
USD	30,982,441	BRL	106,750,000	19/11/2018	J.P. Morgan	(721,750)	(0.03)
先物為替予約の未実現損						(2,817,266)	(0.11)
CHF Hedged Share Class							
CHF	383,003	USD	405,729	20/04/2018	J.P. Morgan	(4,579)	-
EUR Hedged Share Class							
EUR	65,968,041	USD	81,644,516	20/04/2018	J.P. Morgan	(382,359)	(0.01)
USD	165,504	EUR	134,838	20/04/2018	J.P. Morgan	(595)	-
GBP Hedged Share Class							
GBP	14,275	USD	20,256	20/04/2018	J.P. Morgan	(214)	-
USD	4,059,067	GBP	2,900,471	20/04/2018	J.P. Morgan	(13,034)	-

ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現損	(400,781)	(0.01)
先物為替予約の未実現損合計	(3,218,047)	(0.12)
先物為替予約の未実現損益総額	1,764,907	0.07

国名はCIF Annual Report原本に基づき投資国を表示している。

キャピタル・グループ・エマージング・マーケット・トータル・オポチュニティーズ（LUX）

損益および純資産変動計算書

2018年3月31日現在

（USD）

**収益**

債券および転換社債に係る利息（源泉徴収税額控除後）	99,188,385
受取配当金（源泉徴収税額控除後）	29,964,193
銀行預金利息	356,688
収益小計	<b>129,509,266</b>

**費用**

運用報酬	24,329,430
デポジタリー・カストディ費用およびファンド管理手数料	1,282,533
管理手数料	695,163
専門家サービス	566,992
年次税	461,595
その他費用	282,254
印刷費用	119,271
費用小計	<b>27,737,238</b>

費用の払戻し 276,223

**投資純利益 / (損失) (a) 102,048,251**

実現純利益 / (損失)

投資有価証券の売却取引	96,356,901
為替取引	61,425,283

**当期実現純利益 / (損失) (b) 157,782,184**

未実現評価利益 / (損失)の増減

投資有価証券	76,354,392
為替取引	(13,918,472)

**当期末実現評価利益 / (損失)の増減 : (c) 62,435,920**

**当期損益 (a+b+c) 322,266,355**

**配当金の分配 (34,053,217)**

当期投資証券の差引増減額 (515,385,295)

期首純資産総額 2,918,183,517

期末純資産総額

2,691,011,360

## 日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

「キャピタル・エマージング・ストラテジー・マザーファンド（米ドル売り円買い）」の投資対象である「日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」は、「日本短期債券マザーファンド」受益証券を投資対象としており、同マザーファンドにおける計算日直近の組入有価証券は次のとおりであります。本情報は同マザーファンドの投信運用会社である三菱UFJ国際投信株式会社からの資料に基づき委託会社が作成したものでありますが、これらは監査意見の対象外であります。

なお、同ファンド（「日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」）は、三菱UFJ国際投信株式会社の委嘱に基づき、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に準じて、設定日（2007年9月26日）より各計算期間の財務諸表について、監査を受けております。なお、直近の計算期間は2018年7月24日から2019年1月23日までとなっております。ただし、同マザーファンド（「日本短期債券マザーファンド」）は当該監査の対象ではありません。

## 「日本短期債券マザーファンド」の組入有価証券の状況

（有価証券明細表）

（2019年1月23日現在）

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額	
						単価 (円)	評価金額(円)
日本	第4回クレディ・アグリ コル・エス・エー円貨社 債(2014)	0.425	2019/11/28	社債券	100,000	100.208	100,208,000
日本	第19回ルノー円貨社債 (2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	99.503	99,503,000
日本	第11回ウエストパック・ バンキング・コーポレー ション円貨社債(2016)	0.3	2021/1/22	社債券	100,000	100.213	100,213,000
日本	第3回ソシエテ・ジェネ ラル非上位円貨社債 (2018)	0.804	2023/10/12	社債券	100,000	98.616	98,616,000
日本	第488回中部電力	1.562	2019/2/25	社債券	100,000	100.127	100,127,000
日本	第521回関西電力	0.18	2023/9/20	社債券	100,000	99.863	99,863,000
日本	第4回富士フイルムホー ルディングス(社債間限 定同順位特約付)	0.005	2020/3/3	社債券	100,000	99.949	99,949,000
日本	第50回日本電気(社債間 限定同順位特約付)	0.29	2022/6/15	社債券	100,000	100.151	100,151,000
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	100.277	100,277,000
日本	第1回三井住友トラス ト・パナソニックファイ ナンス(社債間限定同順 位特約付)	0.12	2020/10/30	社債券	100,000	100.148	100,148,000
日本	第22回あおぞら銀行(社 債間限定同順位特約付)	0.1	2021/12/10	社債券	100,000	99.968	99,968,000
日本	第28回三菱東京UFJ銀 行(劣後特約付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	102.834	102,834,000
日本	第6回りそな銀行(劣後 特約付)	2.084	2020/3/4	社債券	100,000	102.197	102,197,000

日本	第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	102.859	102,859,000
日本	第22回東京センチュリーリース(社債間限定同順位特約付)	0.06	2021/4/13	社債券	100,000	99.898	99,898,000
日本	第75回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.309	2023/2/28	社債券	100,000	99.826	99,826,000
日本	第69回日立キャピタル(社債間限定同順位特約付)	0.08	2020/12/18	社債券	100,000	100.026	100,026,000
日本	第33回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付)	0.297	2020/6/4	社債券	100,000	100.321	100,321,000
合 計					1,800,000		1,806,984,000

## 2【ファンドの現況】

原届出書の第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況 2ファンドの現況につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

### 【純資産額計算書】

キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF(米ドル売り円買い)

2019年6月28日現在

資産総額	6,831,571,506円
負債総額	33,895,862円
純資産総額( - )	6,797,675,644円
発行済口数	6,055,512,550口
1口当たり純資産額( / )	1.1226円

(参考)キャピタル・エマージング・ストラテジー・マザーファンド(米ドル売り円買い)

2019年6月28日現在

資産総額	7,133,956,094円
負債総額	13,600,000円
純資産総額( - )	7,120,356,094円
発行済口数	6,793,586,570口
1口当たり純資産額( / )	1.0481円

(参考)日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

2019年1月23日現在

資産総額	162,220,138円
負債総額	116,509円
純資産総額（ - ）	162,103,629円
発行済口数	153,924,025口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0531円



### 3【委託会社等の経理状況】

原届出書の第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況につきましては、以下の訂正とともに、中間財務諸表の内容が追加されます。

#### < 訂正前 >

##### 1．財務諸表の作成方法について

委託会社であるキャピタル・インターナショナル株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づき作成しております。

財務諸表に記載している金額は、千円未満の端数を切捨てて表示しております。

##### 2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自平成29年7月1日 至平成30年6月30日）の財務諸表については有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

#### < 訂正後 >

##### 1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

委託会社であるキャピタル・インターナショナル株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づき作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

財務諸表及び中間財務諸表に記載している金額は、千円未満の端数を切捨てて表示しております。

##### 2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自2017年7月1日 至2018年6月30日）の財務諸表については有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間（自2018年7月1日 至2018年12月31日）の中間財務諸表については有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

#### < 中間財務諸表 >

### (3)【株主資本等変動計算書】

#### (1) 中間貸借対照表

当中間会計期間

(2018年12月31日現在)

科目	注記 番号	内訳 (千円)	金額 (千円)
(資産の部) ・流動資産			

1.現金・預金			2,890,845
2.前払費用			56,359
3.未収入金			673,554
4.未収委託者報酬			1,260,690
5.未収運用受託報酬			682,359
6.立替金			10,118
流動資産計			5,573,927
.固定資産			
1.有形固定資産			86,756
器具備品	*1	86,756	
2.無形固定資産			1,857
ソフトウェア		1,857	
3.投資その他の資産			537,154
(1)投資有価証券		367	
(2)保険積立金		11,637	
(3)長期差入保証金		275,321	
(4)繰延税金資産		249,828	
固定資産計			625,768
資産合計			6,199,696
(負債の部)			
.流動負債			
1.預り金			16,673
2.未払金			1,255,465
(1)未払手数料		753,053	
(2)その他未払金		502,412	
3.未払費用			77,472
4.未払法人税等			95,995
5.未払消費税等			33,531
6.賞与引当金			356,240
7.役員賞与引当金			1,075
流動負債計			1,836,454
.固定負債			
1.退職給付引当金			1,398,065
2.資産除去債務			248,863
固定負債計			1,646,929
負債合計			3,483,383
(純資産の部)			
.株主資本			
1.資本金			450,000
2.資本剰余金			582,736
資本準備金		582,736	
3.利益剰余金			1,683,608
その他利益剰余金		1,683,608	
繰越利益剰余金		1,683,608	
株主資本計			2,716,345
.評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金			32
評価・換算差額等合計			32
純資産合計			2,716,312

負債・純資産合計			6,199,696
----------	--	--	-----------

## (2) 中間損益計算書

当中間会計期間

(自 2018年 7月 1日 至 2018年 12月31日)

科 目	注記 番号	内訳 (千円)	金額 (千円)
. 営業収益			
1. 委託者報酬			2,386,183
2. 運用受託報酬			718,602
3. その他営業収益	*2		3,439,212
営業収益計			6,543,997
. 営業費用			
1. 支払手数料	*2		4,070,855
2. 広告宣伝費			48,946
3. 調査費			107,154
4. 営業雑経費			22,983
(1) 通信費		10,124	
(2) 印刷費		6,124	
(3) 協会費		6,734	
営業費用計			4,249,940
. 一般管理費			
1. 給料			1,340,085
(1) 役員報酬		30,621	
(2) 給料・手当		524,370	
(3) 賞与		542,784	
(4) 賞与引当金繰入額		241,233	
(5) 役員賞与引当金繰入額		1,075	
2. 交際費			11,715
3. 寄付金			1,713
4. 旅費交通費			58,827
5. 租税公課			23,460
6. 不動産賃借料			164,160
7. 退職給付費用			137,762
8. 固定資産減価償却費	*1		10,566
9. 器具備品賃借料			1,892
10. 消耗品費			8,488
11. 事務委託費			30,700
12. 採用費			7,744
13. 福利厚生費			110,863
14. 共通発生経費負担額	*3		95,112
15. 諸経費			4,354
一般管理費計			2,007,448
営業利益			286,609
. 営業外収益			
1. 受取利息及び配当金			4,402
2. 雑収入			105
営業外収益計			4,508
. 営業外費用			

1.為替差損			3,372
2.固定資産除却損			45
営業外費用計			3,418
経常利益			287,699
税引前中間純利益			287,699
法人税、住民税及び事業税			74,373
法人税等調整額			35,899
中間純利益			249,225

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自2018年7月1日 至2018年12月31日)

(単位:千円)

	株主資本					株主資本 合計	評価・換算差額等		純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			その他 有価 証券 評価 差額 金	評価・ 換算 差額 等合 計	
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
当期首残高	450,000	582,736	582,736	1,434,383	1,434,383	2,467,120	-	-	2,467,120
当中間期 変動額									
中間純 利益				249,225	249,225	249,225			249,225
株主資本 以外の項 目の当中 間期変動 額(純 額)							32	32	32
当中間期 変動額合 計	-	-	-	249,225	249,225	249,225	32	32	249,192
当中間期 末残高	450,000	582,736	582,736	1,683,608	1,683,608	2,716,345	32	32	2,716,312

[重要な会計方針]

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

## その他有価証券

## 時価のあるもの

中間会計期間末の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

## (1)有形固定資産

定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は、器具備品2～10年であります。

## (2)無形固定資産

定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づいております。

## 3．外貨建資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、当中間会計期間末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

## 4．引当金の計上基準

## (1)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、賞与支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (2)役員賞与引当金

役員の賞与の支給に備えるため、役員賞与支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (3)退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務額の見込額を計上しております。退職給付引当金及び退職給付費用の計算には、退職給付に係る当中間会計期間末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。

## 5．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## [表示方法の変更]

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

## [注記事項]

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間  
(2018年12月31日現在)

- \*1. 有形固定資産の減価償却累計額 49,338千円
- \*2. 消費税等の取扱い  
 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。

## (中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自2018年7月1日 至2018年12月31日)	
*1. 減価償却実施額	
有形固定資産	10,034千円
無形固定資産	531千円
*2. 当社はキャピタル・グループの日本拠点として、キャピタル・リサーチ・アンド・マネージメント・カンパニー（以下「CRMC社」という。）との役務提供契約に基づき、当社の最終の親会社であるキャピタル・グループ・カンパニーズ・インクの各グループ会社（以下「各グループ会社」という。）との間で各種投資運用サービスを相互に提供しております。	
当社の主要な事業は、当社が各グループ会社に対して提供している各種投資運用サービス（市場調査業務、投資運用関連業務、マーケティング業務、顧客リレーションサポート業務など）であり、当該サービスに係る対価は、営業費用及び一般管理費の合計額から一定の支払手数料を差引いた金額を基準に一定の利益率を加味して算定し、その他営業収益に計上しております。	
当社が各グループ会社から提供を受けている各種投資運用サービスは、市場調査業務、投資運用関連業務、ITサービスなどであり、当該サービスに係る対価は、当社の委託者報酬及び運用受託報酬を基準に算定し、支払手数料に含めて計上しております。	
*3. 共通発生経費負担額は、各グループ会社の利益規模に応じて負担しております。	

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自2018年7月1日 至2018年12月31日)				
発行済株式の種類及び総数				
株式の種類	当事業年度期首 (株)	増加 (株)	減少 (株)	当中間会計期間末 (株)
普通株式	56,400	-	-	56,400

## [リース取引関係]

当中間会計期間 (自2018年7月1日 至2018年12月31日)	
--------------------------------------	--

## 1. 所有権移転外ファイナンス・リース取引

当中間会計期間末現在、該当するリース取引はありません。

## 2. オペレーティング・リース取引

（借主側）

未経過リース料

1年以内 329,780千円

1年超 1,264,159千円

合計 1,593,939千円

## [金融商品関係]

当中間会計期間

（自2018年7月1日 至2018年12月31日）

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

	中間貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
長期差入保証金	275,321	272,690	2,631

時価については、下記の考え方によっております。その結果、2018年12月31日における上記以外のその他金融商品の中間貸借対照表計上額は、時価と同額または近似しているため、上記表における記載を省略しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

## (1)現金・預金、未収入金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬

これらは、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と同額または近似していると考えております。

## (2)投資有価証券

証券投資信託であります。証券投資信託の時価は、当社が算定し、公表している基準価額によっております。

## (3)長期差入保証金

主に本社事務所の賃借時に差入れている保証金であり、時価については、国債の利回り等適切な指標で割引き算定する方法によっております。

負債

## (1)未払金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と同額または近似していると考えております。

(注2)金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## [有価証券関係]

当中間会計期間  
(2018年12月31日現在)

(その他有価証券)

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
その他有価証券 (証券投資信託)	367	400	32

[デリバティブ取引関係]

当中間会計期間  
(自2018年7月1日 至2018年12月31日)

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

[資産除去債務関係]

当中間会計期間  
(2018年12月31日現在)

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減

当事業年度期首残高 247,065千円

時の経過による調整額 1,798千円

当中間会計期間末残高 248,863千円

[セグメント情報等]

当中間会計期間  
(自2018年7月1日 至2018年12月31日)

## （セグメント情報）

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## （関連情報）

## 1. サービスごとの情報

投資運用業の区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

日本	米国	その他	合計
3,024,850千円	3,439,212千円	79,934千円	6,543,997千円

（注）営業収益は、顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が、中間貸借対照表の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称又は氏名	営業収益
キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー	3,439,212千円

## [1株当たり情報]

## 当中間会計期間

（自2018年7月1日 至2018年12月31日）

1株当たり純資産額 48,161.56円

1株当たり中間純利益金額 4,418.88円

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

中間純利益	249,225千円
普通株主に帰属しない金額	- 千円
普通株式に係る中間純利益	249,225千円
期中平均株式数	56,400株

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

## (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額：324,279百万円（2018年9月30日現在）

（中略）

## (2) 販売会社

名称：みずほ証券株式会社

資本金の額：125,167百万円（2018年9月30日現在）  
（中略）

<再信託受託会社の概要>

名称：日本マスタートラスト信託銀行株式会社  
資本金の額：10,000百万円（2018年9月30日現在）  
（以下略）

<訂正後>

（1）受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社  
資本金の額：324,279百万円（2019年3月31日現在）  
（中略）

（2）販売会社

名称：みずほ証券株式会社  
資本金の額：125,167百万円（2019年3月31日現在）  
（中略）

<再信託受託会社の概要>

名称：日本マスタートラスト信託銀行株式会社  
資本金の額：10,000百万円（2019年3月31日現在）  
（以下略）

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年7月16日

キャピタル・インターナショナル株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 中島紀子 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているキャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF（米ドル売り円買い）の2018年11月21日から2019年5月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、キャピタル・エマージング・ストラテジー・ファンドF（米ドル売り円買い）の2019年5月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年11月21日から2019年5月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

キャピタル・インターナショナル株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年3月18日

キャピタル・インターナショナル株式会社  
取締役 会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐藤 誠 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 水野 龍也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているキャピタル・インターナショナル株式会社の2018年7月1日から2019年6月30日までの第35期事業年度の中間会計期間（2018年7月1日から2018年12月31日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、キャピタル・インターナショナル株式会社の2018年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2018年7月1日から2018年12月31日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- 
1. 上記は、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
  2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。