

## 【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<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | キャピタル・グローバル・アロケーション・ファンドF（限定為替ヘッジ）                 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>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)<br>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>

委託会社の概況（2018年12月28日現在）  
（前略）  
（以下略）

<訂正後>

委託会社の概況（2019年6月28日現在）  
（前略）  
（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  
（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  
（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 >

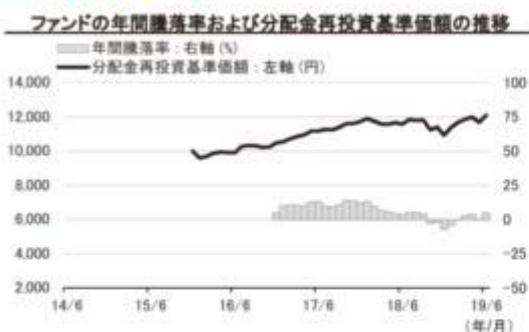
（前略）

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、2016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。

### <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。

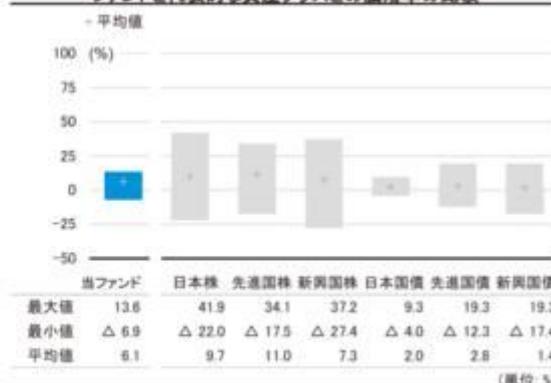
「先進国債」の資産クラスはFTSE世界国債インデックス(除く日本/円ベース)を表示しております。

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。

### ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(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、2016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。

## 4【手数料等及び税金】

### (3)【信託報酬等】

#### <訂正前>

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0.7344%(税抜0.68%)**の率を乗じて得た額とします。

(中略)

#### <投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担>

|                        |                    |
|------------------------|--------------------|
| 当ファンドの信託報酬             | 年率0.7344%(税抜0.68%) |
| 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0.7414%程度（税込）**

（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。

（以下略）

<訂正後>

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0.7344%<sup>1</sup>（税抜0.68%）**の率を乗じて得た額とします。

（中略）

<投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担>

当ファンドの信託報酬

年率0.7344%<sup>1</sup>（税抜0.68%）

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0.7414%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0.748%**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0.755%程度（税込）**となります。

（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%<sup>1</sup>（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。

（以下略）

## （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・グローバル・アロケーション・ファンドF（限定為替ヘッジ）

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   | 8,553,117,113 | 100.04  |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |      | 3,624,495     | 0.04    |
| 合計（純資産総額）           |      | 8,549,492,618 | 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・グローバル・アロケーション・マザーファンド（限定為替ヘッジ）

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      | 4,830,741     | 0.05    |
| 投資証券                | ルクセンブルク | 8,548,335,968 | 99.94   |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |         | 0             | 0.00    |
| 合計（純資産総額）           |         | 8,553,166,709 | 100.00  |

(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資産の時価の比率をいいます。

(参考) キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド（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    | 米国    | 12,907,467,830 | 23.03   |
|       | 英国    | 3,004,895,535  | 5.36    |
|       | スイス   | 2,012,533,032  | 3.59    |
|       | フランス  | 1,461,493,703  | 2.61    |
|       | 香港    | 1,402,853,816  | 2.50    |
|       | オランダ  | 1,353,536,608  | 2.41    |
|       | 日本    | 1,187,518,000  | 2.12    |
|       | デンマーク | 935,934,756    | 1.67    |
|       | 台湾    | 931,473,155    | 1.66    |
|       | ブラジル  | 883,376,551    | 1.58    |
|       | ドイツ   | 761,749,945    | 1.36    |
|       | カナダ   | 744,269,066    | 1.33    |
|       | ロシア   | 667,676,471    | 1.19    |
|       | 中国    | 664,085,317    | 1.18    |
|       | インド   | 507,846,986    | 0.91    |
|       | 韓国    | 417,136,103    | 0.74    |

|        |            |                |       |
|--------|------------|----------------|-------|
|        | イタリア       | 366,678,533    | 0.65  |
|        | ベルギー       | 206,136,106    | 0.37  |
|        | スウェーデン     | 199,487,153    | 0.36  |
|        | ニュージーランド   | 178,891,903    | 0.32  |
|        | インドネシア     | 168,370,389    | 0.30  |
|        | フィンランド     | 114,484,117    | 0.20  |
|        | メキシコ       | 107,531,483    | 0.19  |
|        | スペイン       | 62,047,324     | 0.11  |
|        | イスラエル      | 53,822,835     | 0.10  |
| 債券     | 米国         | 10,752,083,836 | 19.18 |
|        | 日本         | 2,539,984,333  | 4.53  |
|        | メキシコ       | 513,659,709    | 0.92  |
|        | ギリシャ       | 434,047,093    | 0.77  |
|        | 英国         | 431,795,751    | 0.77  |
|        | ドイツ        | 428,443,317    | 0.76  |
|        | イタリア       | 394,164,234    | 0.70  |
|        | 中国         | 381,322,142    | 0.68  |
|        | 韓国         | 359,410,346    | 0.64  |
|        | フランス       | 293,847,812    | 0.52  |
|        | ノルウェー      | 282,485,113    | 0.50  |
|        | ルーマニア      | 246,568,758    | 0.44  |
|        | スペイン       | 235,368,135    | 0.42  |
|        | インド        | 232,499,270    | 0.41  |
|        | イスラエル      | 218,001,838    | 0.39  |
|        | 南アフリカ      | 192,427,902    | 0.34  |
|        | インドネシア     | 183,515,344    | 0.33  |
|        | チリ         | 177,798,000    | 0.32  |
|        | デンマーク      | 172,371,801    | 0.31  |
|        | ポーランド      | 170,070,968    | 0.30  |
|        | タイ         | 153,168,577    | 0.27  |
|        | コロンビア      | 147,928,919    | 0.26  |
|        | アイルランド     | 143,194,675    | 0.26  |
|        | ブラジル       | 139,492,376    | 0.25  |
|        | ベルギー       | 139,423,931    | 0.25  |
|        | マレーシア      | 129,893,352    | 0.23  |
|        | オランダ       | 127,903,727    | 0.23  |
|        | ロシア        | 122,483,193    | 0.22  |
|        | サウジアラビア    | 97,756,977     | 0.17  |
|        | アラブ首長国連邦   | 84,260,483     | 0.15  |
|        | カタール       | 78,965,264     | 0.14  |
|        | カナダ        | 69,551,169     | 0.12  |
|        | スイス        | 58,801,041     | 0.10  |
|        | モロッコ       | 45,113,882     | 0.08  |
| 国際機関   | 39,756,043 | 0.07           |       |
| ラトビア   | 34,731,782 | 0.06           |       |
| オーストリア | 31,976,442 | 0.06           |       |
| エジプト   | 22,821,149 | 0.04           |       |
| ウルグアイ  | 20,493,653 | 0.04           |       |
| ポルトガル  | 15,091,243 | 0.03           |       |
| セルビア   | 13,472,626 | 0.02           |       |

|                   |        |                |        |
|-------------------|--------|----------------|--------|
|                   | カザフスタン | 12,889,848     | 0.02   |
|                   | フィリピン  | 10,561,025     | 0.02   |
| 銀行預金、その他資産（負債控除後） |        | 4,373,873,442  | 7.80   |
| 純資産総額             |        | 56,054,767,238 | 100.00 |

（注）投資比率は、キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド（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・グローバル・アロケーション・ファンドF（限定為替ヘッジ）

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<br>(口)     | 簿価単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円)   | 評価単価<br>(円) | 評価金額<br>(円)   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|---------------|--|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | キャピタル・グローバル・アロ<br>ケーション・マザーファンド（限<br>定為替ヘッジ） | 6,773,136,770 | 1.1753      | 7,961,115,596 | 1.2628      | 8,553,117,113 | 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・グローバル・アロケーション・マザーファンド（限定為替ヘッジ）

## 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<br>(口)    | 簿価単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円)   | 評価単価<br>(円) | 評価金額<br>(円)   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|---------|----------|---|--------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1  | ルクセンブルク | 投資証券     | キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド（LUX）（クラスCh-JPY） | 3,845,405.29 | 2,070.06    | 7,960,248,490 | 2,223       | 8,548,335,968 | 99.94           |
| 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）                         | 4,579,770    | 1.0548      | 4,830,741     | 1.0548      | 4,830,741     | 0.05            |

(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 | 0.05     |
| 投資証券     | 99.94    |
| 合計       | 100.00   |

## (参考) キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド（LUX）

上位30銘柄

2019年6月28日現在

| 順位 | 銘柄                       | 利率(%)<br>(上段)<br>償還日<br>(下段) | 国/地域<br>(上段)<br>資産(中<br>段)<br>業種/種類<br>(下段) | 数量        | 評価単価(上<br>段)<br>通貨(下段) | 評価金額(円)       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------------------------|------------------------------|---|-----------|------------------------|---------------|-----------------|
| 1  | MERCK & CO INC           | -<br>-                       | 米国<br>株式<br>ヘルスケア                           | 124,200   | 83.83<br>米ドル           | 1,122,119,459 | 2.00            |
| 2  | NESTLE SA                | -<br>-                       | スイス<br>株式<br>生活必需品                          | 96,950    | 100.56<br>スイス・フラン      | 1,076,071,427 | 1.92            |
| 3  | US TREASURY NOTE         | 2.5<br>2024/1/31             | 米国<br>債券<br>国債証券                            | 9,115,000 | 103.2397<br>米ドル        | 1,014,194,938 | 1.81            |
| 4  | BROADCOM INC             | -<br>-                       | 米国<br>株式<br>情報技術                            | 32,685    | 285.71<br>米ドル          | 1,006,449,439 | 1.80            |
| 5  | US TREASURY NOTE         | 2.375<br>2029/5/15           | 米国<br>債券<br>国債証券                            | 8,710,000 | 103.25<br>米ドル          | 969,228,658   | 1.73            |
| 6  | ASTRAZENECA PLC<br>(GBP) | -<br>-                       | 英国<br>株式<br>ヘルスケア                           | 106,700   | 64.09<br>英ポンド          | 933,974,481   | 1.67            |

|    |   |                    |                                |           |                          |             |      |
|----|---|--------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------|-------------|------|
| 7  | TAIWAN<br>SEMICONDUCTOR<br>MANUFACTURING CO   | -<br>-             | 台湾<br>株式<br>情報技術               | 1,117,000 | 240.50<br>台湾ドル           | 931,473,155 | 1.66 |
| 8  | BERKSHIRE<br>HATHAWAY INC CL A                | -<br>-             | 米国<br>株式<br>金融                 | 25        | 318,285.00<br>米ドル        | 857,579,147 | 1.53 |
| 9  | JPMORGAN CHASE &<br>CO                        | -<br>-             | 米国<br>株式<br>金融                 | 69,200    | 108.84<br>米ドル            | 811,731,985 | 1.45 |
| 10 | US TREASURY NOTE                              | 2.125<br>2021/5/31 | 米国<br>債券<br>国債証券               | 6,300,900 | 100.6682<br>米ドル          | 683,617,209 | 1.22 |
| 11 | SBERBANK OF<br>RUSSIA PJSC ADR<br>(PK SHEETS) | -<br>-             | ロシア<br>株式<br>金融                | 395,300   | 15.48<br>米ドル             | 659,501,522 | 1.18 |
| 12 | US TREASURY NOTE                              | 1.375<br>2023/8/31 | 米国<br>債券<br>国債証券               | 6,200,000 | 98.4961<br>米ドル           | 658,155,564 | 1.17 |
| 13 | AIA GROUP LTD                                 | -<br>-             | 香港<br>株式<br>金融                 | 542,400   | 84.20<br>香港ドル            | 629,806,196 | 1.12 |
| 14 | ORSTED AS                                     | -<br>-             | デンマー<br>ク<br>株式<br>公益事業        | 66,000    | 567.60<br>デンマーク・ク<br>ローネ | 614,959,437 | 1.10 |
| 15 | AIRBUS SE                                     | -<br>-             | フランス<br>株式<br>資本財・<br>サービス     | 38,600    | 123.88<br>ユーロ            | 585,907,149 | 1.05 |
| 16 | HOME DEPOT INC                                | -<br>-             | 米国<br>株式<br>一般消費<br>財・サー<br>ビス | 25,800    | 207.02<br>米ドル            | 575,638,777 | 1.03 |
| 17 | GENERAL MOTORS<br>COMPANY                     | -<br>-             | 米国<br>株式<br>一般消費<br>財・サー<br>ビス | 131,100   | 38.32<br>米ドル             | 541,434,872 | 0.97 |
| 18 | ASML HOLDING NV                               | -<br>-             | オランダ<br>株式<br>情報技術             | 24,435    | 179.70<br>ユーロ            | 538,022,845 | 0.96 |
| 19 | BRITISH AMERICAN<br>TOBACCO PLC               | -<br>-             | 英国<br>株式<br>生活必需<br>品          | 140,400   | 27.50<br>英ポンド            | 527,327,136 | 0.94 |
| 20 | UNITEDHEALTH<br>GROUP INC                     | -<br>-             | 米国<br>株式<br>ヘルスケ<br>ア          | 19,520    | 246.34<br>米ドル            | 518,242,209 | 0.92 |

|    |                               |                    |  |             |                 |             |      |
|----|-------------------------------|--------------------|--|-------------|-----------------|-------------|------|
| 21 | MICROSOFT CORP                | -<br>-             | 米国<br>株式<br>情報技術                       | 35,575      | 134.15<br>米ドル   | 514,343,928 | 0.92 |
| 22 | PAGSEGURO DIGITAL<br>LTD CL A | -<br>-             | ブラジル<br>株式<br>情報技術                     | 125,900     | 37.64<br>米ドル    | 510,732,361 | 0.91 |
| 23 | US TREASURY I/L               | 0.875<br>2029/1/15 | 米国<br>債券<br>国債証券                       | 4,280,000   | 106.4541<br>米ドル | 491,048,465 | 0.88 |
| 24 | ALPHABET INC CL C             | -<br>-             | 米国<br>株式<br>コミュニ<br>ケーショ<br>ン・サー<br>ビス | 3,960       | 1,076.01<br>米ドル | 459,229,232 | 0.82 |
| 25 | US TREASURY NOTE              | 2.375<br>2020/4/30 | 米国<br>債券<br>国債証券                       | 4,180,000   | 100.3047<br>米ドル | 451,872,127 | 0.81 |
| 26 | US TREASURY NOTE              | 1.875<br>2022/9/30 | 米国<br>債券<br>国債証券                       | 3,930,000   | 100.4545<br>米ドル | 425,480,917 | 0.76 |
| 27 | HUMANA INC                    | -<br>-             | 米国<br>株式<br>ヘルスケ<br>ア                  | 14,600      | 264.60<br>米ドル   | 416,352,069 | 0.74 |
| 28 | HANG SENG BANK<br>LTD         | -<br>-             | 香港<br>株式<br>金融                         | 150,300     | 197.20<br>香港ドル  | 408,734,266 | 0.73 |
| 29 | ALTRIA GROUP INC              | -<br>-             | 米国<br>株式<br>生活必需<br>品                  | 72,000      | 47.90<br>米ドル    | 371,694,420 | 0.66 |
| 30 | JAPAN GVT 346 JPY<br>BD       | 0.1<br>2027/3/20   | 日本<br>債券<br>国債証券                       | 351,350,000 | 102.6676<br>日本円 | 360,722,613 | 0.64 |

(注) 投資比率は、キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(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<br>(%) | 償還日        | 種類  | 額面<br>(千円) | 評価額       |             | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|---|-----------|------------|-----|------------|-----------|-------------|-----------------|
|    |   |           |            |     |            | 単価<br>(円) | 金額<br>(円)   |                 |
| 日本 | 第4回クレディ・ア<br>グリコル・エス・<br>エー円貨社債<br>(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・グローバル・アロケーション・ファンドF（限定為替ヘッジ）

該当事項はありません。

（参考）キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド（限定為替ヘッジ）

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・グローバル・アロケーション・ファンドF（限定為替ヘッジ）

該当事項はありません。

（参考）キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド（限定為替ヘッジ）

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・グローバル・アロケーション・ファンドF（限定為替ヘッジ）

| 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<br>(2016年11月21日) | 560,747,978   | 560,747,978   | 1.0177       | 1.0177 |
| 第2期<br>(2017年11月20日) | 4,746,506,988 | 4,746,506,988 | 1.1541       | 1.1541 |
| 第3期<br>(2018年11月20日) | 9,032,745,456 | 9,032,745,456 | 1.1290       | 1.1290 |
| 2018年 6月末日           | 8,955,041,369 |               | 1.1568       |        |
| 7月末日                 | 9,554,893,115 |               | 1.1850       |        |
| 8月末日                 | 9,580,857,116 |               | 1.1788       |        |
| 9月末日                 | 8,974,120,676 |               | 1.1826       |        |
| 10月末日                | 8,645,911,110 |               | 1.1243       |        |
| 11月末日                | 8,849,048,037 |               | 1.1397       |        |
| 12月末日                | 8,504,647,382 |               | 1.0916       |        |
| 2019年 1月末日           | 8,747,418,458 |               | 1.1372       |        |
| 2月末日                 | 8,955,028,141 |               | 1.1675       |        |
| 3月末日                 | 9,193,908,201 |               | 1.1859       |        |
| 4月末日                 | 9,192,638,198 |               | 1.1988       |        |
| 5月末日                 | 8,980,221,761 |               | 1.1674       |        |
| 6月末日                 | 8,549,492,618 |               | 1.2086       |        |

(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・グローバル・アロケーション・ファンドF（限定為替ヘッジ）

| 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・グローバル・アロケーション・ファンドF（限定為替ヘッジ）

| 期         | 計算期間                    | 収益率（％） |
|-----------|-------------------------|--------|
| 第1期       | 2015年12月30日～2016年11月21日 | 1.8    |
| 第2期       | 2016年11月22日～2017年11月20日 | 13.4   |
| 第3期       | 2017年11月21日～2018年11月20日 | 2.2    |
| 第4中間計算期間末 | 2018年11月21日～2019年 5月20日 | 4.7    |

(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・グローバル・アロケーション・ファンドF（限定為替ヘッジ）

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 | 560,822,140   | 9,845,544     | 550,976,596   |
| 第2期       | 2016年11月22日～2017年11月20日 | 3,656,794,782 | 94,894,212    | 4,112,877,166 |
| 第3期       | 2017年11月21日～2018年11月20日 | 5,520,907,826 | 1,633,188,998 | 8,000,595,994 |
| 第4中間計算期間末 | 2018年11月21日～2019年 5月20日 | 541,613,320   | 868,488,236   | 7,673,721,078 |

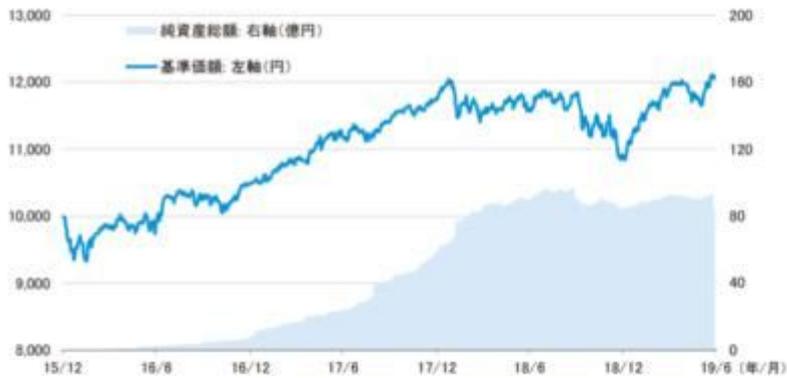
(注)第1期の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(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・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)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・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスC)-JPY) | 99.94   |
| 2  | 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)                         | 0.05    |

&lt;キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(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  | MERCK & CO INC                        | 米国     | 株式 | ヘルスケア   | 2.00    |
| 2  | NESTLE SA                             | スイス    | 株式 | 生活必需品   | 1.92    |
| 3  | US TREASURY NOTE 2.5% 01-31-24        | 米国     | 債券 | 国債証券    | 1.81    |
| 4  | BROADCOM INC                          | 米国     | 株式 | 情報技術    | 1.80    |
| 5  | US TREASURY NOTE 2.375% 05-15-29      | 米国     | 債券 | 国債証券    | 1.73    |
| 6  | ASTRAZENECA PLC (GBP)                 | 英国     | 株式 | ヘルスケア   | 1.67    |
| 7  | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO | 台湾     | 株式 | 情報技術    | 1.66    |
| 8  | BERKSHIRE HATHAWAY INC CL A           | 米国     | 株式 | 金融      | 1.53    |
| 9  | JPMORGAN CHASE & CO                   | 米国     | 株式 | 金融      | 1.45    |
| 10 | US TREASURY NOTE 2.125% 05-31-21      | 米国     | 債券 | 国債証券    | 1.22    |

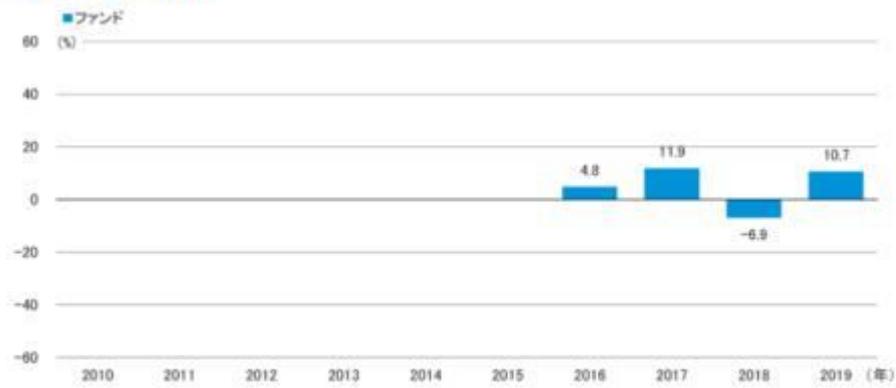
## 資産別構成比率

| 資産     | 証券種別  | 投資比率(%) |
|--------|-------|---------|
| 株式     |       | 55.84   |
| 債券     |       | 36.36   |
|        | 国債証券  | 29.60   |
|        | 社債券   | 4.31    |
|        | その他証券 | 2.45    |
| 現金・その他 |       | 7.80    |

## 国別構成比率

| 国名     | 投資比率(%) |       |       |
|--------|---------|-------|-------|
|        | 株式      | 債券    | 合計    |
| 米国     | 23.03   | 19.18 | 42.21 |
| 日本     | 2.12    | 4.53  | 6.65  |
| 英国     | 5.36    | 0.77  | 6.13  |
| スイス    | 3.59    | 0.10  | 3.70  |
| フランス   | 2.61    | 0.52  | 3.13  |
| その他国   | 19.14   | 11.24 | 30.38 |
| 現金・その他 |         |       | 7.80  |

## 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8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・グローバル・アロケーション・ファンドF（限定為替ヘッジ）】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第3期<br>2018年11月20日現在 | 第4期中間計算期間<br>2019年5月20日現在 |
|-----------------|----------------------|---------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                      |                           |
| 流動資産            |                      |                           |
| コール・ローン         | 316,185,150          | 39,709,090                |
| 親投資信託受益証券       | 9,020,079,962        | 9,064,589,638             |
| 流動資産合計          | 9,336,265,112        | 9,104,298,728             |
| 資産合計            | 9,336,265,112        | 9,104,298,728             |
| <b>負債の部</b>     |                      |                           |
| 流動負債            |                      |                           |
| 未払金             | 266,000,000          | -                         |
| 未払解約金           | 2,797,696            | 2,554,718                 |
| 未払受託者報酬         | 995,291              | 954,190                   |
| 未払委託者報酬         | 32,844,517           | 31,488,476                |
| 未払利息            | 866                  | 114                       |
| その他未払費用         | 881,286              | 898,484                   |
| 流動負債合計          | 303,519,656          | 35,895,982                |
| 負債合計            | 303,519,656          | 35,895,982                |
| <b>純資産の部</b>    |                      |                           |
| 元本等             |                      |                           |
| 元本              | 8,000,595,994        | 7,673,721,078             |
| 剰余金             |                      |                           |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 1,032,149,462        | 1,394,681,668             |
| 元本等合計           | 9,032,745,456        | 9,068,402,746             |
| 純資産合計           | 9,032,745,456        | 9,068,402,746             |
| 負債純資産合計         | 9,336,265,112        | 9,104,298,728             |

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

|   | 第3期中間計算期間<br>自 2017年11月21日<br>至 2018年5月20日 | 第4期中間計算期間<br>自 2018年11月21日<br>至 2019年5月20日 |
|---|--|--|
| <b>営業収益</b>                               |  |  |
| 有価証券売買等損益                                 | 115,133,569                                | 439,443,676                                |
| <b>営業収益合計</b>                             | <b>115,133,569</b>                         | <b>439,443,676</b>                         |
| <b>営業費用</b>                               |  |  |
| 支払利息                                      | 59,398                                     | 12,885                                     |
| 受託者報酬                                     | 774,511                                    | 954,190                                    |
| 委託者報酬                                     | 25,558,892                                 | 31,488,476                                 |
| その他費用                                     | 943,854                                    | 898,484                                    |
| <b>営業費用合計</b>                             | <b>27,336,655</b>                          | <b>33,354,035</b>                          |
| 営業利益又は営業損失( )                             | 87,796,914                                 | 406,089,641                                |
| 経常利益又は経常損失( )                             | 87,796,914                                 | 406,089,641                                |
| 中間純利益又は中間純損失( )                           | 87,796,914                                 | 406,089,641                                |
| 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( ) | 57,440                                     | 13,448,845                                 |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           | 633,629,822                                | 1,032,149,462                              |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 673,041,240                                | 82,068,823                                 |
| 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                   | 673,041,240                                | 82,068,823                                 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 102,086,554                                | 112,177,413                                |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 102,086,554                                | 112,177,413                                |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | -  | -  |
| 分配金                                       | -  | -  |
| 中間剰余金又は中間欠損金( )                           | 1,292,438,862                              | 1,394,681,668                              |

## (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<br>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<br>2018年11月20日現在  | 第4期中間計算期間<br>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<br>8,000,595,994口                                    | 1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数<br>7,673,721,078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<br>1口当たり純資産額 1.1290円<br>(1万口当たり純資産額) (11,290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<br>1口当たり純資産額 1.1817円<br>(1万口当たり純資産額) (11,817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<br>自 2017年11月21日<br>至 2018年11月20日  | 第4期中間計算期間<br>自 2018年11月21日<br>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<br>「(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。<br>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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<br>同左<br>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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<br>至 2018年11月20日 | 自 2018年11月21日<br>至 2019年5月20日 |
| 期首元本額     | 4,112,877,166円                 | 8,000,595,994円                |
| 期中追加設定元本額 | 5,520,907,826円                 | 541,613,320円                  |
| 期中一部解約元本額 | 1,633,188,998円                 | 868,488,236円                  |

（参考）

#### キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド（限定為替ヘッジ）

当ファンドは、「キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド（限定為替ヘッジ）」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         |               |
| 投資信託受益証券     | 4,826,161     |
| 投資証券         | 9,060,110,059 |
| 流動資産合計       | 9,064,936,220 |
| 資産合計         | 9,064,936,220 |
| <b>負債の部</b>  |               |
| 流動負債         |               |
| 流動負債合計       | -             |
| 負債合計         | -             |
| <b>純資産の部</b> |               |
| 元本等          |               |
| 元本           | 7,346,887,371 |
| 剰余金          |               |
| 剰余金又は欠損金（ ）  | 1,718,048,849 |
| 元本等合計        | 9,064,936,220 |
| 純資産合計        | 9,064,936,220 |
| 負債純資産合計      | 9,064,936,220 |

#### 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<br>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。<br>投資証券<br>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。 |
|-----------------|--|

## （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       |              | 7,346,887,371口 |
| 2. 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    | 1.2338円        |
|                        | (1万口当たり純資産額) | (12,338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<br>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ぬ。   |
| 2. 時価の算定方法             | (1)投資信託受益証券<br>「(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。<br>(2)投資証券<br>「(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。<br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。 |
| 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つた場合、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                        | 7,681,894,024円 |
| 同計算期間の追加設定元本額                      | 269,040,624円   |
| 同計算期間の一部解約元本額                      | 604,047,277円   |
| 計算日の元本額                            | 7,346,887,371円 |
| 元本額の内訳                             |                |
| キャピタル・グローバル・アロケーション・ファンドF(限定為替ヘッジ) | 7,346,887,371円 |

### キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)

「キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)」は、円建ての「キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)」(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(CIF)については、2018年12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・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)

##### 投資明細表

2018年12月31日現在

| 投資銘柄  | 通貨  | 数量/額面     | 評価額<br>(USD) | 投資比率<br>(%) |
|---|-----|-----------|--------------|-------------|
| 公的な市場に上場している譲渡可能な有価証券と短期金融商品                        |     |           |              |             |
| <b>債券</b>   |     |           |              |             |
| <i>Australia</i>                                    |     |           |              |             |
| Australia Government Bond, Reg. S 5.75% 15/07/2022  | AUD | 1,425,000 | 1,137,769    | 0.30        |
|   |     |           | 1,137,769    | 0.30        |
| <i>Belgium</i>                                      |     |           |              |             |
| Belgium Government Bond, Reg. S, 144A 1% 22/06/2026 | EUR | 510,000   | 606,967      | 0.16        |
|   |     |           | 606,967      | 0.16        |
| <i>Brazil</i>                                       |     |           |              |             |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/01/2022     | BRL | 180,000   | 368,095      | 0.10        |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/07/2022     | BRL | 2,000,000 | 390,299      | 0.11        |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2025     | BRL | 2,400,000 | 647,200      | 0.17        |
|   |     |           | 1,405,594    | 0.38        |
| <i>Canada</i>                                       |     |           |              |             |
| Canada Government Bond 2.25% 01/06/2025             | CAD | 1,800,000 | 1,345,174    | 0.36        |
| Cenovus Energy, Inc. 4.25% 15/04/2027               | USD | 110,000   | 100,415      | 0.03        |
| Cenovus Energy, Inc. 5.4% 15/06/2047                | USD | 170,000   | 147,416      | 0.04        |
| Province of Quebec Canada 2.375% 31/01/2022         | USD | 46,000    | 45,470       | 0.01        |
| Thomson Reuters Corp. 4.3% 23/11/2023               | USD | 30,000    | 30,597       | 0.01        |
|   |     |           | 1,669,072    | 0.45        |
| <i>Chile</i>  |     |           |              |             |
| Banco del Estado de Chile, 144A 2.668% 08/01/2021   | USD | 450,000   | 440,387      | 0.12        |

|  |     |               |           |      |
|--|-----|---------------|-----------|------|
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4.5%<br>01/03/2021            | CLP | 15,000,000    | 22,067    |      |
| Enel Americas SA 4% 25/10/2026   | USD | 5,000         | 4,683     |      |
|  |     |               | 467,137   | 0.12 |
| <i>China</i>   |     |               |           |      |
| China Development Bank 4.73% 02/04/2025                                      | CNY | 3,000,000     | 458,010   | 0.12 |
| State Grid Overseas Investment 2016 Ltd., 144A 3.5%<br>04/05/2027            | USD | 350,000       | 337,700   | 0.09 |
|  |     |               | 795,710   | 0.21 |
| <i>Colombia</i>  |     |               |           |      |
| Colombia Government Bond 4.375% 12/07/2021                                   | USD | 325,000       | 330,444   | 0.09 |
| Colombian TES 6% 28/04/2028  | COP | 100,000,000   | 29,260    | 0.01 |
|  |     |               | 359,704   | 0.10 |
| <i>Denmark</i>   |     |               |           |      |
| Nykredit Realkredit A/S 1.5% 01/10/2037                                      | DKK | 1,800,000     | 278,363   | 0.07 |
| Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 1.5% 01/10/2040                              | DKK | 11,482,461    | 1,752,809 | 0.47 |
| Nykredit Realkredit A/S 2% 01/10/2037  | DKK | 2,026,920     | 323,952   | 0.09 |
|  |     |               | 2,355,124 | 0.63 |
| <i>France</i>  |     |               |           |      |
| AXA SA, Reg. S, FRN 5.453% Perpetual   | GBP | 150,000       | 194,337   | 0.05 |
| BPCE SA, Reg. S 0.875% 31/01/2024  | EUR | 200,000       | 224,960   | 0.06 |
| France Government Bond OAT, Reg. S 0.75% 25/11/2028                          | EUR | 500,000       | 575,412   | 0.16 |
| France Government Bond OAT, Reg. S, 144A 2%<br>25/05/2048                    | EUR | 425,000       | 529,485   | 0.14 |
| France Government Bond OAT, Reg. S 0.5% 25/05/2026                           | EUR | 200,000       | 231,659   | 0.06 |
| Orange SA, STEP 9% 01/03/2031  | USD | 30,000        | 41,661    | 0.01 |
| Total Capital International SA 2.875% 17/02/2022                             | USD | 60,000        | 59,310    | 0.02 |
|  |     |               | 1,856,824 | 0.50 |
| <i>Germany</i>   |     |               |           |      |
| Allianz SE, Reg. S, FRN 4.75% Perpetual                                      | EUR | 100,000       | 126,120   | 0.03 |
| BMW Finance NV, Reg. S 1% 29/08/2025   | EUR | 280,000       | 315,419   | 0.09 |
| Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.5% 15/08/2027                           | EUR | 550,000       | 651,437   | 0.18 |
| Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 2.5% 15/08/2046                           | EUR | 385,000       | 621,561   | 0.17 |
| Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 1.25% 15/08/2048                          | EUR | 475,000       | 598,003   | 0.16 |
| Daimler International Finance BV, Reg. S 0.875%<br>09/04/2024                | EUR | 275,000       | 311,330   | 0.08 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.125% 07/03/2022                            | USD | 458,000       | 451,148   | 0.12 |
|  |     |               | 3,075,018 | 0.83 |
| <i>Greece</i>  |     |               |           |      |
| Greece Government Bond, Reg. S, 144A 3.375%<br>15/02/2025                    | EUR | 200,000       | 221,723   | 0.06 |
|  |     |               | 221,723   | 0.06 |
| <i>India</i>   |     |               |           |      |
| Housing Development Finance Corp. Ltd., Reg. S<br>6.875% 30/04/2020          | INR | 20,000,000    | 279,607   | 0.08 |
| India Government Bond 7.59% 11/01/2026                                       | INR | 70,000,000    | 1,014,130 | 0.27 |
| Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Reg.<br>S 7.125% 10/10/2022 | INR | 20,000,000    | 269,212   | 0.07 |
| National Highways Authority of India, Reg. S 7.3%<br>18/05/2022              | INR | 30,000,000    | 407,934   | 0.11 |
| NTPC Ltd., Reg. S 7.25% 03/05/2022   | INR | 10,000,000    | 136,089   | 0.04 |
|  |     |               | 2,106,972 | 0.57 |
| <i>Indonesia</i>   |     |               |           |      |
| Indonesia Government Bond, 144A 3.85% 18/07/2027                             | USD | 625,000       | 594,879   | 0.16 |
| Indonesia Government Bond, Reg. S 3.85% 18/07/2027                           | USD | 250,000       | 237,952   | 0.06 |
| Indonesia Treasury 6.125% 15/05/2028   | IDR | 2,000,000,000 | 122,740   | 0.03 |

|   |     |               |            |      |
|---|-----|---------------|------------|------|
| Indonesia Treasury 8.25% 15/05/2029                                 | IDR | 6,000,000,000 | 427,910    | 0.12 |
|   |     |               | 1,383,481  | 0.37 |
| <i>Ireland</i>  |     |               |            |      |
| Ireland Government Bond, Reg. S 0.9% 15/05/2028                     | EUR | 1,050,000     | 1,203,791  | 0.32 |
| Ireland Government Bond, Reg. S 1% 15/05/2026                       | EUR | 425,000       | 501,703    | 0.14 |
|   |     |               | 1,705,494  | 0.46 |
| <i>Israel</i>   |     |               |            |      |
| Israel Government Bond 3.15% 30/06/2023                             | USD | 200,000       | 199,700    | 0.05 |
| Israel Government Bond 2% 31/03/2027                                | ILS | 1,675,000     | 444,943    | 0.12 |
| Israel Government Bond 5.5% 31/01/2042                              | ILS | 1,020,000     | 376,054    | 0.10 |
|   |     |               | 1,020,697  | 0.27 |
| <i>Italy</i>  |     |               |            |      |
| Intesa Sanpaolo SpA, Reg. S 6.625% 13/09/2023                       | EUR | 200,000       | 260,278    | 0.07 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.05% 01/08/2027                  | EUR | 550,000       | 607,228    | 0.17 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S, 144A 4.75%<br>01/08/2023 | EUR | 200,000       | 260,270    | 0.07 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 0.9%<br>01/08/2022        | EUR | 300,000       | 338,258    | 0.09 |
| UniCredit SpA, Reg. S 1% 18/01/2023                                 | EUR | 250,000       | 268,338    | 0.07 |
|   |     |               | 1,734,372  | 0.47 |
| <i>Japan</i>  |     |               |            |      |
| Japan Government Ten Year Bond 0.8% 20/09/2022                      | JPY | 65,000,000    | 613,836    | 0.16 |
| Japan Government Ten Year Bond 0.3% 20/12/2024                      | JPY | 145,000,000   | 1,357,928  | 0.36 |
| Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/03/2027                      | JPY | 500,000,000   | 4,638,406  | 1.25 |
| Japan Government Thirty Year Bond 2% 20/03/2042                     | JPY | 10,000,000    | 118,906    | 0.03 |
| Japan Government Thirty Year Bond 1.7% 20/03/2044                   | JPY | 22,000,000    | 250,501    | 0.07 |
| Japan Government Twenty Year Bond 2.2% 20/03/2030                   | JPY | 5,000,000     | 56,369     | 0.01 |
| Japan Government Twenty Year Bond 1.7% 20/06/2033                   | JPY | 42,650,000    | 469,119    | 0.13 |
| Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/06/2037                   | JPY | 273,300,000   | 2,558,295  | 0.69 |
| Japan Government Two Year Bond 0.1% 01/12/2020                      | JPY | 316,150,000   | 2,897,414  | 0.78 |
| Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., Reg. S 2.25% 21/11/2026             | EUR | 250,000       | 292,953    | 0.08 |
| Toyota Motor Credit Corp. 3.05% 11/01/2028                          | USD | 147,000       | 142,096    | 0.04 |
|   |     |               | 13,395,823 | 3.60 |
| <i>Mexico</i>   |     |               |            |      |
| Mexican Bonos 8% 07/12/2023   | MXN | 5,500,000     | 273,366    | 0.07 |
| Mexican Bonos 6.5% 10/06/2021                                       | MXN | 5,500,000     | 267,411    | 0.07 |
| Mexican Bonos 10% 05/12/2024  | MXN | 8,800,000     | 476,058    | 0.13 |
| Mexican Bonos 5.75% 05/03/2026                                      | MXN | 34,000,000    | 1,463,185  | 0.39 |
| Mexican Bonos 10% 20/11/2036  | MXN | 800,000       | 44,843     | 0.01 |
| Mexican Udibonos 4% 13/06/2019                                      | MXN | 200,000       | 62,763     | 0.02 |
| Mexican Udibonos 4% 15/11/2040                                      | MXN | 200,000       | 62,463     | 0.02 |
| Mexico Government Bond 4.15% 28/03/2027                             | USD | 450,000       | 435,784    | 0.12 |
| Petroleos Mexicanos 6.5% 13/03/2027                                 | USD | 450,000       | 424,125    | 0.11 |
| Petroleos Mexicanos 6.35% 12/02/2048                                | USD | 250,000       | 200,380    | 0.05 |
| Petroleos Mexicanos 7.47% 12/11/2026                                | MXN | 5,700,000     | 213,985    | 0.06 |
|   |     |               | 3,924,363  | 1.05 |
| <i>Morocco</i>  |     |               |            |      |
| Morocco Government Bond, Reg. S 4.25% 11/12/2022                    | USD | 400,000       | 401,976    | 0.11 |
|   |     |               | 401,976    | 0.11 |
| <i>Netherlands</i>  |     |               |            |      |
| Cooperatieve Rabobank UA, Reg. S 3.875% 25/07/2023                  | EUR | 100,000       | 128,312    | 0.03 |
| Enel Finance International NV, Reg. S 1% 16/09/2024                 | EUR | 150,000       | 169,962    | 0.05 |

|  |     |             |           |      |
|--|-----|-------------|-----------|------|
| Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 4%<br>15/07/2019           | EUR | 20,000      | 23,494    | 0.01 |
| Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 2.25%<br>15/07/2022        | EUR | 50,000      | 62,803    | 0.02 |
| Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 2%<br>15/07/2024           | EUR | 40,000      | 51,217    | 0.01 |
|  |     |             | 435,788   | 0.12 |
| <i>Norway</i>  |     |             |           |      |
| Equinor ASA 3.7% 01/03/2024  | USD | 60,000      | 61,157    | 0.02 |
| Norway Government Bond, Reg. S, 144A 3.75%<br>25/05/2021             | NOK | 2,515,000   | 308,818   | 0.08 |
|  |     |             | 369,975   | 0.10 |
| <i>Peru</i>  |     |             |           |      |
| Peru Government Bond, Reg. S, 144A 6.15% 12/08/2032                  | PEN | 3,400,000   | 1,028,697 | 0.28 |
|  |     |             | 1,028,697 | 0.28 |
| <i>Philippines</i>   |     |             |           |      |
| Philippine Government Bond 4.95% 15/01/2021                          | PHP | 5,000,000   | 93,982    | 0.02 |
|  |     |             | 93,982    | 0.02 |
| <i>Poland</i>  |     |             |           |      |
| Poland Government Bond 5.25% 25/10/2020                              | PLN | 3,620,000   | 1,035,076 | 0.28 |
| Poland Government Bond 5.75% 23/09/2022                              | PLN | 1,550,000   | 470,970   | 0.12 |
| Poland Government Bond 4% 25/10/2023                                 | PLN | 5,910,000   | 1,713,219 | 0.46 |
| Poland Government Bond 3.25% 25/07/2025                              | PLN | 1,975,000   | 552,468   | 0.15 |
|  |     |             | 3,771,733 | 1.01 |
| <i>Portugal</i>  |     |             |           |      |
| Portugal Government Bond, Reg. S 5.125% 15/10/2024                   | USD | 125,000     | 131,160   | 0.03 |
| Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, Reg. S, 144A 2.875%<br>15/10/2025 | EUR | 515,000     | 657,292   | 0.18 |
|  |     |             | 788,452   | 0.21 |
| <i>Qatar</i>   |     |             |           |      |
| Qatar Government Bond, 144A 4.5% 23/04/2028                          | USD | 775,000     | 810,808   | 0.22 |
|  |     |             | 810,808   | 0.22 |
| <i>Romania</i>   |     |             |           |      |
| Romania Government Bond 2.3% 26/10/2020                              | RON | 1,100,000   | 263,804   | 0.07 |
| Romania Government Bond, Reg. S 2.875%<br>11/03/2029                 | EUR | 250,000     | 278,219   | 0.08 |
| Romania Government Bond, Reg. S 5.125%<br>15/06/2048                 | USD | 350,000     | 338,191   | 0.09 |
|  |     |             | 880,214   | 0.24 |
| <i>Saudi Arabia</i>  |     |             |           |      |
| KSA Sukuk Ltd., 144A 2.894% 20/04/2022                               | USD | 200,000     | 195,110   | 0.05 |
| Saudi Government Bond, Reg. S 3.625% 04/03/2028                      | USD | 250,000     | 237,044   | 0.07 |
| Saudi Government Bond, Reg. S 4.5% 17/04/2030                        | USD | 300,000     | 298,929   | 0.08 |
|  |     |             | 731,083   | 0.20 |
| <i>South Africa</i>  |     |             |           |      |
| South Africa Government Bond 7.75% 28/02/2023                        | ZAR | 1,110,000   | 76,245    | 0.02 |
| South Africa Government Bond 6.5% 28/02/2041                         | ZAR | 9,400,000   | 456,197   | 0.12 |
|  |     |             | 532,442   | 0.14 |
| <i>South Korea</i>   |     |             |           |      |
| Korea Housing Finance Corp., Reg. S 2% 11/10/2021                    | USD | 475,000     | 458,046   | 0.12 |
| Korea Treasury 2% 10/09/2022   | KRW | 844,000,000 | 759,514   | 0.21 |
| Korea Treasury 4.25% 10/06/2021                                      | KRW | 75,000,000  | 71,043    | 0.02 |
|  |     |             | 1,288,603 | 0.35 |
| <i>Spain</i>   |     |             |           |      |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Reg. S, FRN 3.5%<br>11/04/2024   | EUR | 200,000     | 230,591   | 0.06 |

|  |     |            |           |      |
|--|-----|------------|-----------|------|
| Spain Government Bond, Reg. S, 144A 1.4% 30/04/2028              | EUR | 330,000    | 379,913   | 0.10 |
| Spain Government Bond, Reg. S, 144A 2.7% 31/10/2048              | EUR | 525,000    | 613,338   | 0.17 |
| Spain Government Bond, Reg. S, 144A 1.3% 31/10/2026              | EUR | 150,000    | 174,724   | 0.05 |
|  |     |            | 1,398,566 | 0.38 |
| <i>Supra National</i>  |     |            |           |      |
| European Financial Stability Facility, Reg. S 0.4%<br>17/02/2025 | EUR | 900,000    | 1,038,028 | 0.28 |
| European Investment Bank 2.25% 15/03/2022                        | USD | 153,000    | 151,244   | 0.04 |
| International Finance Corp. 6.3% 25/11/2024                      | INR | 15,000,000 | 205,905   | 0.05 |
|  |     |            | 1,395,177 | 0.37 |
| <i>Switzerland</i>   |     |            |           |      |
| Credit Suisse Group AG, Reg. S, FRN 2.125% 12/09/2025            | GBP | 100,000    | 121,159   | 0.03 |
|  |     |            | 121,159   | 0.03 |
| <i>Thailand</i>  |     |            |           |      |
| Bank of Thailand 1.49% 28/08/2019                                | THB | 16,100,000 | 493,778   | 0.13 |
| Thailand Government Bond 3.65% 20/06/2031                        | THB | 27,500,000 | 923,828   | 0.25 |
| Thailand Government Bond 1.875% 17/06/2022                       | THB | 8,700,000  | 266,105   | 0.07 |
| Thailand Government Bond 2.125% 17/12/2026                       | THB | 2,300,000  | 69,144    | 0.02 |
|  |     |            | 1,752,855 | 0.47 |
| <i>United Arab Emirates</i>                                      |     |            |           |      |
| Abu Dhabi Government Bond, 144A 2.5% 11/10/2022                  | USD | 350,000    | 340,399   | 0.09 |
|  |     |            | 340,399   | 0.09 |
| <i>United Kingdom</i>  |     |            |           |      |
| AstraZeneca plc 3.375% 16/11/2025                                | USD | 350,000    | 338,765   | 0.09 |
| Aviva plc, FRN 6.875% 20/05/2058                                 | GBP | 50,000     | 71,115    | 0.02 |
| Barclays Bank plc, Reg. S 10% 21/05/2021                         | GBP | 50,000     | 73,433    | 0.02 |
| HSBC Holdings plc, FRN 4.292% 12/09/2026                         | USD | 250,000    | 247,097   | 0.07 |
| HSBC Holdings plc 4% 30/03/2022                                  | USD | 110,000    | 111,478   | 0.03 |
| HSBC Holdings plc, FRN 3.033% 22/11/2023                         | USD | 275,000    | 266,306   | 0.07 |
| Shell International Finance BV 3.5% 13/11/2023                   | USD | 223,000    | 225,621   | 0.06 |
| Shell International Finance BV 2.5% 12/09/2026                   | USD | 110,000    | 102,266   | 0.03 |
| Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4%<br>23/09/2021    | USD | 333,000    | 322,201   | 0.09 |
| Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875%<br>23/09/2023  | USD | 51,000     | 48,261    | 0.01 |
| Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.2%<br>23/09/2026    | USD | 10,000     | 9,069     |      |
| UK Treasury, Reg. S 1.5% 22/07/2047                              | GBP | 235,000    | 277,261   | 0.08 |
| UK Treasury, Reg. S 3.75% 07/09/2020                             | GBP | 10,000     | 13,378    |      |
| UK Treasury, Reg. S 1.75% 07/09/2022                             | GBP | 205,000    | 269,959   | 0.07 |
| UK Treasury, Reg. S 4.25% 07/12/2027                             | GBP | 300,000    | 482,232   | 0.13 |
| UK Treasury, Reg. S 4.5% 07/09/2034                              | GBP | 50,000     | 88,994    | 0.02 |
| UK Treasury, Reg. S 3.25% 22/01/2044                             | GBP | 50,000     | 81,516    | 0.02 |
| UK Treasury, Reg. S 4.25% 07/12/2046                             | GBP | 360,000    | 699,310   | 0.19 |
|  |     |            | 3,728,262 | 1.00 |
| <i>United States of America</i>                                  |     |            |           |      |
| Abbott Laboratories 3.75% 30/11/2026                             | USD | 57,000     | 56,418    | 0.02 |
| AbbVie, Inc. 2.5% 14/05/2020                                     | USD | 20,000     | 19,814    | 0.01 |
| AbbVie, Inc. 3.6% 14/05/2025                                     | USD | 20,000     | 19,219    | 0.01 |
| AbbVie, Inc. 3.2% 14/05/2026                                     | USD | 300,000    | 278,624   | 0.07 |
| Allergan Funding SCS 3% 12/03/2020                               | USD | 260,000    | 259,040   | 0.07 |
| Allergan Funding SCS 3.45% 15/03/2022                            | USD | 5,000      | 4,927     |      |
| Allergan Funding SCS 4.75% 15/03/2045                            | USD | 24,000     | 22,896    | 0.01 |

|  |     |           |           |      |
|--|-----|-----------|-----------|------|
| Altria Group, Inc. 4.25% 09/08/2042                        | USD | 40,000    | 32,412    | 0.01 |
| Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 3.5% 12/01/2024       | USD | 350,000   | 342,337   | 0.09 |
| AT&T, Inc. 3.4% 15/05/2025                                 | USD | 50,000    | 47,067    | 0.01 |
| AT&T, Inc. 4.25% 01/03/2027                                | USD | 100,000   | 98,113    | 0.03 |
| Becton Dickinson and Co. 3.734% 15/12/2024                 | USD | 180,000   | 174,094   | 0.05 |
| Berkshire Hathaway Energy Co. 3.75% 15/11/2023             | USD | 60,000    | 60,887    | 0.02 |
| Chubb INA Holdings, Inc. 2.875% 03/11/2022                 | USD | 10,000    | 9,920     |      |
| Chubb INA Holdings, Inc. 3.35% 03/05/2026                  | USD | 20,000    | 19,593    | 0.01 |
| Citigroup, Inc. 2.75% 25/04/2022                           | USD | 100,000   | 97,031    | 0.03 |
| Citigroup, Inc. 3.875% 25/10/2023                          | USD | 60,000    | 60,236    | 0.02 |
| CMS Energy Corp. 3.45% 15/08/2027                          | USD | 175,000   | 168,794   | 0.05 |
| CMS Energy Corp. 3.6% 15/11/2025                           | USD | 25,000    | 24,626    | 0.01 |
| Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 4%<br>01/12/2028 | USD | 200,000   | 205,339   | 0.05 |
| CVS Health Corp. 4.3% 25/03/2028                           | USD | 136,000   | 133,420   | 0.04 |
| CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048                          | USD | 156,000   | 152,500   | 0.04 |
| Duke Energy Corp. 3.75% 15/04/2024                         | USD | 650,000   | 651,725   | 0.17 |
| Enbridge Energy Partners LP 7.375% 15/10/2045              | USD | 50,000    | 62,202    | 0.02 |
| Energy Transfer Operating LP 6% 15/06/2048                 | USD | 300,000   | 293,488   | 0.08 |
| Essex Portfolio LP, REIT 3.5% 01/04/2025                   | USD | 30,000    | 29,210    | 0.01 |
| Exelon Corp. 3.497% 01/06/2022                             | USD | 90,000    | 88,013    | 0.02 |
| Exelon Corp. 3.4% 15/04/2026                               | USD | 20,000    | 19,054    |      |
| FirstEnergy Corp. 3.9% 15/07/2027                          | USD | 225,000   | 218,433   | 0.06 |
| FirstEnergy Corp. 4.85% 15/07/2047                         | USD | 30,000    | 30,173    | 0.01 |
| Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.2% 23/02/2023            | USD | 495,000   | 480,565   | 0.13 |
| Goldman Sachs Group, Inc. (The) 4.75% 21/10/2045           | USD | 30,000    | 28,705    | 0.01 |
| Halliburton Co. 3.8% 15/11/2025                            | USD | 10,000    | 9,713     |      |
| Home Depot, Inc. (The) 4.5% 06/12/2048                     | USD | 75,000    | 77,829    | 0.02 |
| JPMorgan Chase & Co. 2.55% 01/03/2021                      | USD | 50,000    | 49,308    | 0.01 |
| Kimco Realty Corp., REIT 3.4% 01/11/2022                   | USD | 5,000     | 4,926     |      |
| Kraft Heinz Foods Co. 3.5% 06/06/2022                      | USD | 40,000    | 39,699    | 0.01 |
| Kroger Co. (The) 3.5% 01/02/2026                           | USD | 50,000    | 47,490    | 0.01 |
| McDonald's Corp. 3.7% 30/01/2026                           | USD | 10,000    | 9,823     |      |
| Medtronic, Inc. 3.5% 15/03/2025                            | USD | 80,000    | 79,785    | 0.02 |
| Pacific Gas & Electric Co. 3.3% 01/12/2027                 | USD | 250,000   | 205,381   | 0.06 |
| Pacific Gas & Electric Co. 3.85% 15/11/2023                | USD | 20,000    | 17,998    |      |
| Pfizer, Inc. 3.2% 15/09/2023                               | USD | 550,000   | 552,488   | 0.15 |
| Philip Morris International, Inc. 2% 21/02/2020            | USD | 60,000    | 59,254    | 0.02 |
| Philip Morris International, Inc. 2.9% 15/11/2021          | USD | 40,000    | 39,414    | 0.01 |
| Prologis LP, REIT 3.75% 01/11/2025                         | USD | 25,000    | 25,173    | 0.01 |
| Public Service Enterprise Group, Inc. 2% 15/11/2021        | USD | 80,000    | 76,874    | 0.02 |
| Reynolds American, Inc. 4.45% 12/06/2025                   | USD | 195,000   | 188,366   | 0.05 |
| Reynolds American, Inc. 5.85% 15/08/2045                   | USD | 20,000    | 18,662    |      |
| South Carolina Electric & Gas Co. 4.25% 15/08/2028         | USD | 300,000   | 311,460   | 0.08 |
| United Technologies Corp. 4.125% 16/11/2028                | USD | 265,000   | 263,665   | 0.07 |
| US Bank NA 3.45% 16/11/2021                                | USD | 400,000   | 403,146   | 0.11 |
| US Treasury 2.5% 31/05/2020                                | USD | 752,000   | 751,566   | 0.20 |
| US Treasury 2.5% 30/06/2020                                | USD | 225,000   | 224,856   | 0.06 |
| US Treasury 2.375% 31/01/2023                              | USD | 5,425,000 | 5,401,054 | 1.45 |
| US Treasury 2.75% 31/05/2023                               | USD | 752,000   | 760,401   | 0.20 |
| US Treasury 2.625% 30/06/2023                              | USD | 1,425,000 | 1,432,793 | 0.38 |
| US Treasury 2.75% 31/07/2023                               | USD | 1,420,000 | 1,435,420 | 0.39 |
| US Treasury 2.875% 15/05/2028                              | USD | 1,477,000 | 1,500,896 | 0.40 |

|  |     |           |             |       |
|--|-----|-----------|-------------|-------|
| US Treasury 2.875% 15/08/2028                        | USD | 3,500,000 | 3,557,680   | 0.96  |
| US Treasury 3.125% 15/05/2048                        | USD | 275,000   | 280,614     | 0.08  |
| US Treasury 3% 15/08/2048                            | USD | 300,000   | 299,043     | 0.08  |
| US Treasury 1.375% 31/08/2020                        | USD | 1,200,000 | 1,177,811   | 0.32  |
| US Treasury 1.75% 30/06/2022                         | USD | 1,650,000 | 1,611,016   | 0.43  |
| US Treasury 1.875% 30/09/2022                        | USD | 3,050,000 | 2,985,414   | 0.80  |
| US Treasury 1.375% 31/08/2023                        | USD | 7,760,000 | 7,378,366   | 1.98  |
| US Treasury 2% 30/04/2024                            | USD | 950,000   | 925,174     | 0.25  |
| US Treasury 2% 30/06/2024                            | USD | 950,000   | 924,023     | 0.25  |
| US Treasury 2.125% 31/07/2024                        | USD | 1,850,000 | 1,810,182   | 0.49  |
| US Treasury 2.375% 15/05/2027                        | USD | 2,750,000 | 2,694,150   | 0.72  |
| US Treasury 3% 15/05/2047                            | USD | 375,000   | 373,939     | 0.10  |
| US Treasury Inflation Indexed 0.375% 15/07/2027      | USD | 725,000   | 712,336     | 0.19  |
| US Treasury Inflation Indexed 0.5% 15/01/2028        | USD | 2,150,000 | 2,104,589   | 0.56  |
| US Treasury Inflation Indexed 0.125% 15/04/2021      | USD | 460,000   | 477,404     | 0.13  |
| US Treasury Inflation Indexed 0.375% 15/07/2023      | USD | 1,855,000 | 1,971,807   | 0.53  |
| US Treasury Inflation Indexed 0.125% 15/07/2024      | USD | 380,000   | 388,349     | 0.10  |
| US Treasury Inflation Indexed 0.25% 15/01/2025       | USD | 45,000    | 46,008      | 0.01  |
| US Treasury Inflation Indexed 0.375% 15/01/2027      | USD | 680,000   | 676,324     | 0.18  |
| US Treasury Inflation Indexed 1.375% 15/02/2044      | USD | 65,000    | 73,022      | 0.02  |
| US Treasury Inflation Indexed 1% 15/02/2046          | USD | 305,000   | 309,149     | 0.08  |
| US Treasury Inflation Indexed, FRN 0.125% 15/04/2022 | USD | 850,000   | 855,342     | 0.23  |
| Virginia Electric & Power Co. 4.6% 01/12/2048        | USD | 250,000   | 262,198     | 0.07  |
| Warner Media LLC 4.75% 29/03/2021                    | USD | 50,000    | 51,287      | 0.01  |
|  |     |           | 50,121,542  | 13.46 |
| <i>Uruguay</i>                                       |     |           |             |       |
| Uruguay Government Bond, Reg. S 9.875%<br>20/06/2022 | UYU | 6,700,000 | 205,041     | 0.05  |
|  |     |           | 205,041     | 0.05  |
| <b>債券合計</b>  |     |           | 109,418,598 | 29.38 |
| <b>株式</b>  |     |           |             |       |
| <i>Australia</i>                                     |     |           |             |       |
| Boral Ltd.   | AUD | 226,300   | 787,408     | 0.21  |
|  |     |           | 787,408     | 0.21  |
| <i>Belgium</i>                                       |     |           |             |       |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV                           | EUR | 22,000    | 1,454,415   | 0.39  |
|  |     |           | 1,454,415   | 0.39  |
| <i>Brazil</i>  |     |           |             |       |
| B3 SA - Brasil Bolsa Balcao                          | BRL | 270,000   | 1,867,690   | 0.50  |
| Pagseguro Digital Ltd. 'A'                           | USD | 114,719   | 2,148,687   | 0.58  |
| Vale SA  | BRL | 60,000    | 789,525     | 0.21  |
|  |     |           | 4,805,902   | 1.29  |
| <i>Canada</i>  |     |           |             |       |
| Canadian Natural Resources Ltd.                      | CAD | 23,800    | 574,254     | 0.15  |
| Enbridge, Inc.                                       | USD | 2,244     | 69,744      | 0.02  |
| Enbridge, Inc.                                       | CAD | 85,790    | 2,665,070   | 0.72  |
| First Quantum Minerals Ltd.                          | CAD | 61,500    | 497,334     | 0.13  |
| Franco-Nevada Corp.                                  | CAD | 14,000    | 981,702     | 0.26  |
|  |     |           | 4,788,104   | 1.28  |
| <i>China</i>   |     |           |             |       |
| Alibaba Group Holding Ltd., ADR                      | USD | 9,275     | 1,271,324   | 0.34  |
| CNOOC Ltd.   | HKD | 1,056,000 | 1,631,773   | 0.44  |
| ENN Energy Holdings Ltd.                             | HKD | 90,000    | 798,225     | 0.21  |

|  |     |         |            |      |
|--|-----|---------|------------|------|
| TravelSky Technology Ltd. 'H'            | HKD | 575,000 | 1,472,288  | 0.40 |
|  |     |         | 5,173,610  | 1.39 |
| <i>Denmark</i>                           |     |         |            |      |
| Coloplast A/S 'B'                        | DKK | 16,000  | 1,485,460  | 0.40 |
| Orsted A/S, Reg. S                       | DKK | 29,380  | 1,964,378  | 0.53 |
|  |     |         | 3,449,838  | 0.93 |
| <i>Finland</i>                           |     |         |            |      |
| Nokian Renkaat OYJ                       | EUR | 13,090  | 402,243    | 0.11 |
|  |     |         | 402,243    | 0.11 |
| <i>France</i>                            |     |         |            |      |
| Airbus SE                                | EUR | 37,100  | 3,568,915  | 0.96 |
| BNP Paribas SA                           | EUR | 4,000   | 180,914    | 0.05 |
| Edenred                                  | EUR | 11,400  | 419,406    | 0.11 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE      | EUR | 4,800   | 1,419,997  | 0.38 |
| Publicis Groupe SA                       | EUR | 30,300  | 1,738,588  | 0.47 |
| Societe Generale SA                      | EUR | 10,735  | 342,176    | 0.09 |
| TOTAL SA                                 | EUR | 46,200  | 2,444,476  | 0.66 |
|  |     |         | 10,114,472 | 2.72 |
| <i>Germany</i>                           |     |         |            |      |
| Carl Zeiss Meditec AG                    | EUR | 15,700  | 1,228,599  | 0.33 |
| MTU Aero Engines AG                      | EUR | 10,000  | 1,814,868  | 0.49 |
| Rational AG                              | EUR | 2,500   | 1,420,730  | 0.38 |
|  |     |         | 4,464,197  | 1.20 |
| <i>Hong Kong</i>                         |     |         |            |      |
| AIA Group Ltd.                           | HKD | 215,000 | 1,784,688  | 0.48 |
| Link REIT                                | HKD | 53,000  | 536,734    | 0.14 |
| Sands China Ltd.                         | HKD | 236,000 | 1,033,753  | 0.28 |
|  |     |         | 3,355,175  | 0.90 |
| <i>India</i>                             |     |         |            |      |
| HDFC Bank Ltd., ADR                      | USD | 8,900   | 921,951    | 0.25 |
| Infosys Ltd.                             | INR | 92,500  | 873,063    | 0.23 |
| Kotak Mahindra Bank Ltd.                 | INR | 30,400  | 547,126    | 0.15 |
|  |     |         | 2,342,140  | 0.63 |
| <i>Indonesia</i>                         |     |         |            |      |
| Bank Central Asia Tbk. PT                | IDR | 544,000 | 983,588    | 0.26 |
|  |     |         | 983,588    | 0.26 |
| <i>Israel</i>                            |     |         |            |      |
| Teva Pharmaceutical Industries Ltd., ADR | USD | 55,000  | 848,100    | 0.23 |
|  |     |         | 848,100    | 0.23 |
| <i>Italy</i>                             |     |         |            |      |
| Ferrari NV                               | EUR | 9,700   | 964,453    | 0.26 |
| FinecoBank Banca Fineco SpA              | EUR | 169,460 | 1,704,326  | 0.46 |
|  |     |         | 2,668,779  | 0.72 |
| <i>Japan</i>                             |     |         |            |      |
| Keyence Corp.                            | JPY | 1,600   | 812,810    | 0.22 |
| Murata Manufacturing Co. Ltd.            | JPY | 12,000  | 1,637,334  | 0.44 |
| Nidec Corp.                              | JPY | 10,300  | 1,172,323  | 0.31 |
| Nintendo Co. Ltd.                        | JPY | 11,000  | 2,939,054  | 0.79 |
| Nippon Prologis REIT, Inc.               | JPY | 638     | 1,349,867  | 0.36 |
|  |     |         | 7,911,388  | 2.12 |
| <i>Mexico</i>                            |     |         |            |      |
| Coca-Cola Femsa SAB de CV                | MXN | 130,000 | 788,200    | 0.21 |

|  |     |         |           |      |
|--|-----|---------|-----------|------|
|  |     |         | 788,200   | 0.21 |
| <i>Netherlands</i>                               |     |         |           |      |
| Akzo Nobel NV                                    | EUR | 20,000  | 1,613,216 | 0.43 |
| ASML Holding NV                                  | EUR | 24,435  | 3,839,986 | 1.03 |
| Coca-Cola European Partners plc                  | USD | 40,000  | 1,834,000 | 0.49 |
| Koninklijke DSM NV                               | EUR | 17,000  | 1,391,491 | 0.38 |
| Randstad Holding NV                              | EUR | 8,375   | 384,690   | 0.10 |
|  |     |         | 9,063,383 | 2.43 |
| <i>New Zealand</i>                               |     |         |           |      |
| Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd.            | NZD | 137,100 | 1,196,279 | 0.32 |
| Spark New Zealand Ltd.                           | NZD | 535,000 | 1,490,232 | 0.40 |
|  |     |         | 2,686,511 | 0.72 |
| <i>Peru</i>                                      |     |         |           |      |
| Credicorp Ltd.                                   | USD | 9,665   | 2,142,441 | 0.57 |
|  |     |         | 2,142,441 | 0.57 |
| <i>Russian Federation</i>                        |     |         |           |      |
| LUKOIL PJSC, ADR                                 | USD | 24,200  | 1,729,816 | 0.47 |
| Sberbank of Russia PJSC, ADR                     | USD | 85,700  | 939,272   | 0.25 |
|  |     |         | 2,669,088 | 0.72 |
| <i>South Korea</i>                               |     |         |           |      |
| Samsung Electronics Co. Ltd.                     | KRW | 23,500  | 815,065   | 0.22 |
| SK Telecom Co. Ltd.                              | KRW | 7,280   | 1,758,344 | 0.47 |
|  |     |         | 2,573,409 | 0.69 |
| <i>Spain</i>                                     |     |         |           |      |
| Amadeus IT Group SA 'A'                          | EUR | 41,600  | 2,899,829 | 0.78 |
| Bankia SA  | EUR | 108,400 | 317,950   | 0.08 |
| Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA | EUR | 13,250  | 331,861   | 0.09 |
| International Consolidated Airlines Group SA     | GBP | 100,000 | 787,703   | 0.21 |
|  |     |         | 4,337,343 | 1.16 |
| <i>Sweden</i>                                    |     |         |           |      |
| Assa Abloy AB 'B'                                | SEK | 12,180  | 217,339   | 0.06 |
| Nibe Industrier AB 'B'                           | SEK | 105,900 | 1,086,368 | 0.29 |
| Volvo AB 'B'                                     | SEK | 20,250  | 264,922   | 0.07 |
|  |     |         | 1,568,629 | 0.42 |
| <i>Switzerland</i>                               |     |         |           |      |
| Geberit AG                                       | CHF | 2,260   | 879,029   | 0.24 |
| Nestle SA  | CHF | 58,125  | 4,719,071 | 1.27 |
| Temenos AG                                       | CHF | 16,000  | 1,919,219 | 0.51 |
|  |     |         | 7,517,319 | 2.02 |
| <i>Taiwan</i>                                    |     |         |           |      |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.      | TWD | 917,000 | 6,727,511 | 1.81 |
|  |     |         | 6,727,511 | 1.81 |
| <i>United Kingdom</i>                            |     |         |           |      |
| AstraZeneca plc                                  | GBP | 121,100 | 9,065,214 | 2.43 |
| BAE Systems plc                                  | GBP | 259,300 | 1,517,673 | 0.41 |
| British American Tobacco plc, ADR                | USD | 2,280   | 72,641    | 0.02 |
| British American Tobacco plc                     | GBP | 75,600  | 2,408,994 | 0.65 |
| Croda International plc                          | GBP | 7,900   | 471,748   | 0.13 |
| GlaxoSmithKline plc                              | GBP | 132,000 | 2,508,902 | 0.67 |
| HSBC Holdings plc                                | GBP | 304,200 | 2,508,247 | 0.67 |
| Ocado Group plc                                  | GBP | 259,500 | 2,612,994 | 0.70 |
| Rio Tinto plc                                    | GBP | 49,000  | 2,329,586 | 0.63 |

|  |     |         |                    |              |
|--|-----|---------|--------------------|--------------|
| Royal Dutch Shell plc 'A'                | GBP | 33      | 971                |              |
| Royal Dutch Shell plc 'B'                | GBP | 86,200  | 2,570,970          | 0.69         |
| Spirax-Sarco Engineering plc             | GBP | 19,100  | 1,519,119          | 0.41         |
|  |     |         | 27,587,059         | 7.41         |
| <i>United States of America</i>          |     |         |                    |              |
| Alphabet, Inc. 'A'                       | USD | 620     | 647,875            | 0.17         |
| Alphabet, Inc. 'C'                       | USD | 3,380   | 3,500,362          | 0.94         |
| Amazon.com, Inc.                         | USD | 400     | 600,788            | 0.16         |
| Amphenol Corp. 'A'                       | USD | 14,750  | 1,195,045          | 0.32         |
| Berkshire Hathaway, Inc. 'A'             | USD | 27      | 8,262,000          | 2.22         |
| BlackRock, Inc.                          | USD | 1,278   | 502,024            | 0.13         |
| Broadcom, Inc.                           | USD | 33,530  | 8,526,008          | 2.29         |
| Caterpillar, Inc.                        | USD | 8,400   | 1,067,388          | 0.29         |
| Chemours Co. (The)                       | USD | 420     | 11,852             |              |
| Cigna Corp.                              | USD | 9,250   | 1,756,760          | 0.47         |
| Coca-Cola Co. (The)                      | USD | 35,000  | 1,657,250          | 0.44         |
| ConocoPhillips                           | USD | 28,540  | 1,779,469          | 0.48         |
| Constellation Brands, Inc. 'A'           | USD | 3,600   | 578,952            | 0.16         |
| Crown Castle International Corp., REIT   | USD | 27,000  | 2,933,010          | 0.79         |
| DowDuPont, Inc.                          | USD | 80,876  | 4,325,249          | 1.16         |
| Equinix, Inc., REIT                      | USD | 2,066   | 728,389            | 0.20         |
| General Motors Co.                       | USD | 109,300 | 3,656,085          | 0.98         |
| Gilead Sciences, Inc.                    | USD | 20,000  | 1,251,000          | 0.34         |
| Home Depot, Inc. (The)                   | USD | 10,000  | 1,718,200          | 0.46         |
| Humana, Inc.                             | USD | 960     | 275,021            | 0.07         |
| Intel Corp.                              | USD | 40,000  | 1,877,200          | 0.50         |
| JPMorgan Chase & Co.                     | USD | 53,900  | 5,261,718          | 1.41         |
| Keurig Dr Pepper, Inc.                   | USD | 71,000  | 1,820,440          | 0.49         |
| Las Vegas Sands Corp.                    | USD | 17,925  | 932,996            | 0.25         |
| Linde plc                                | EUR | 5,813   | 922,777            | 0.25         |
| LyondellBasell Industries NV 'A'         | USD | 10,000  | 831,600            | 0.22         |
| Mastercard, Inc. 'A'                     | USD | 8,865   | 1,672,382          | 0.45         |
| Medtronic plc                            | USD | 16,000  | 1,455,360          | 0.39         |
| Merck & Co., Inc.                        | USD | 144,100 | 11,010,681         | 2.96         |
| Mettler-Toledo International, Inc.       | USD | 2,840   | 1,606,247          | 0.43         |
| Microsoft Corp.                          | USD | 31,050  | 3,153,749          | 0.85         |
| NIKE, Inc. 'B'                           | USD | 22,500  | 1,668,150          | 0.45         |
| Occidental Petroleum Corp.               | USD | 16,500  | 1,012,770          | 0.27         |
| Pfizer, Inc.                             | USD | 51,100  | 2,230,515          | 0.60         |
| Philip Morris International, Inc.        | USD | 35,700  | 2,383,332          | 0.64         |
| PNC Financial Services Group, Inc. (The) | USD | 2,500   | 292,275            | 0.08         |
| Procter & Gamble Co. (The)               | USD | 9,000   | 827,280            | 0.22         |
| Schlumberger Ltd.                        | USD | 21,300  | 768,504            | 0.21         |
| Union Pacific Corp.                      | USD | 7,285   | 1,007,006          | 0.27         |
| United Parcel Service, Inc. 'B'          | USD | 6,500   | 633,945            | 0.17         |
| UnitedHealth Group, Inc.                 | USD | 24,720  | 6,158,246          | 1.65         |
| Visa, Inc. 'A'                           | USD | 5,000   | 659,700            | 0.18         |
| Walgreens Boots Alliance, Inc.           | USD | 31,000  | 2,118,230          | 0.57         |
| Watsco, Inc.                             | USD | 12,200  | 1,697,508          | 0.46         |
| Wells Fargo & Co.                        | USD | 26,750  | 1,232,640          | 0.33         |
| Zoetis, Inc.                             | USD | 9,250   | 791,245            | 0.21         |
|  |     |         | 98,999,223         | 26.58        |
| <b>株式合計</b>                              |     |         | <b>220,209,475</b> | <b>59.12</b> |

| 公的な市場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                                      |     |            | 329,628,073 | 88.50 |
|--|-----|------------|-------------|-------|
| 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                                  |     |            |             |       |
| <b>債券</b>  |     |            |             |       |
| <i>Canada</i>  |     |            |             |       |
| Canada Government Bond 1% 01/09/2022                                 | CAD | 275,000    | 195,125     | 0.05  |
| Enbridge, Inc. 3.7% 15/07/2027                                       | USD | 28,000     | 26,583      | 0.01  |
|  |     |            | 221,708     | 0.06  |
| <i>France</i>  |     |            |             |       |
| BPCE SA, 144A 5.15% 21/07/2024                                       | USD | 211,000    | 212,113     | 0.06  |
|  |     |            | 212,113     | 0.06  |
| <i>Germany</i>   |     |            |             |       |
| Daimler Finance North America LLC, 144A 2%<br>06/07/2021             | USD | 200,000    | 192,493     | 0.05  |
| Deutsche Telekom International Finance BV, 144A<br>2.485% 19/09/2023 | USD | 175,000    | 165,418     | 0.05  |
| EMD Finance LLC, Reg. S 3.25% 19/03/2025                             | USD | 50,000     | 48,042      | 0.01  |
|  |     |            | 405,953     | 0.11  |
| <i>Italy</i>   |     |            |             |       |
| UniCredit SpA, 144A 4.625% 12/04/2027                                | USD | 200,000    | 183,409     | 0.05  |
|  |     |            | 183,409     | 0.05  |
| <i>Japan</i>   |     |            |             |       |
| American Honda Finance Corp. 3.5% 15/02/2028                         | USD | 275,000    | 270,940     | 0.07  |
| Japan Government CPI Linked Bond 0.1%<br>10/03/2028                  | JPY | 80,500,000 | 764,514     | 0.20  |
| Japan Government CPI Linked Bond 0.1%<br>10/09/2024                  | JPY | 27,000,000 | 256,282     | 0.07  |
| Japan Government CPI Linked Bond 0.1%<br>10/03/2027                  | JPY | 15,000,000 | 144,159     | 0.04  |
| Nissan Motor Acceptance Corp., 144A 2.6% 28/09/2022                  | USD | 190,000    | 181,034     | 0.05  |
|  |     |            | 1,616,929   | 0.43  |
| <i>Malaysia</i>  |     |            |             |       |
| Malaysia Government Bond 3.659% 15/10/2020                           | MYR | 27,000     | 6,548       |       |
| Malaysia Government Bond 3.62% 30/11/2021                            | MYR | 325,000    | 78,599      | 0.02  |
| Malaysia Government Bond 3.8% 17/08/2023                             | MYR | 2,160,000  | 521,305     | 0.14  |
| Malaysia Government Bond 3.955% 15/09/2025                           | MYR | 1,600,000  | 385,470     | 0.10  |
| Malaysia Government Bond 3.9% 30/11/2026                             | MYR | 300,000    | 71,494      | 0.02  |
| Malaysia Government Bond 4.498% 15/04/2030                           | MYR | 850,000    | 207,763     | 0.06  |
|  |     |            | 1,271,179   | 0.34  |
| <i>Netherlands</i>   |     |            |             |       |
| Enel Finance International NV, 144A 2.75% 06/04/2023                 | USD | 200,000    | 184,685     | 0.05  |
| Enel Finance International NV, 144A 3.5% 06/04/2028                  | USD | 550,000    | 472,691     | 0.13  |
|  |     |            | 657,376     | 0.18  |
| <i>South Korea</i>   |     |            |             |       |
| Hyundai Capital America, Reg. S 2.55% 03/04/2020                     | USD | 40,000     | 39,501      | 0.01  |
|  |     |            | 39,501      | 0.01  |
| <i>Switzerland</i>   |     |            |             |       |
| Roche Holdings, Inc., 144A 3.35% 30/09/2024                          | USD | 400,000    | 401,543     | 0.11  |
|  |     |            | 401,543     | 0.11  |
| <i>United Kingdom</i>  |     |            |             |       |
| Anglo American Capital plc, 144A 4% 11/09/2027                       | USD | 200,000    | 180,912     | 0.05  |
| Niagara Mohawk Power Corp., Reg. S 3.508% 01/10/2024                 | USD | 5,000      | 5,029       |       |
|  |     |            | 185,941     | 0.05  |
| <i>United States of America</i>                                      |     |            |             |       |
| Apple, Inc. 2.5% 09/02/2022  | USD | 35,000     | 34,462      | 0.01  |

|  |     |         |                  |             |
|--|-----|---------|------------------|-------------|
| Apple, Inc. 3.35% 09/02/2027                                       | USD | 25,000  | 24,484           | 0.01        |
| Apple, Inc. 2.9% 12/09/2027  | USD | 170,000 | 160,336          | 0.04        |
| Bank of America Corp., FRN 3.55% 05/03/2024                        | USD | 180,000 | 177,915          | 0.05        |
| Bank of America Corp., FRN 3.419% 20/12/2028                       | USD | 298,000 | 278,859          | 0.07        |
| Baxalta, Inc. 4% 23/06/2025  | USD | 2,000   | 1,959            |             |
| Charter Communications Operating LLC 4.908%<br>23/07/2025          | USD | 275,000 | 273,703          | 0.07        |
| Comcast Corp. 3.95% 15/10/2025                                     | USD | 115,000 | 116,515          | 0.03        |
| Comcast Corp. 4.15% 15/10/2028                                     | USD | 310,000 | 315,347          | 0.08        |
| FHLMC Q52216 3.5% 01/11/2047                                       | USD | 57,072  | 57,094           | 0.02        |
| General Mills, Inc. 3.2% 16/04/2021                                | USD | 35,000  | 34,835           | 0.01        |
| Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN 2.905%<br>24/07/2023          | USD | 130,000 | 123,914          | 0.03        |
| JPMorgan Chase & Co., FRN 4.005% 23/04/2029                        | USD | 575,000 | 566,163          | 0.15        |
| JPMorgan Chase & Co., FRN 3.54% 01/05/2028                         | USD | 100,000 | 95,506           | 0.03        |
| McDonald's Corp. 3.35% 01/04/2023                                  | USD | 350,000 | 348,551          | 0.09        |
| Microsoft Corp. 2.4% 08/08/2026                                    | USD | 30,000  | 28,103           | 0.01        |
| Microsoft Corp. 3.3% 06/02/2027                                    | USD | 85,000  | 84,328           | 0.02        |
| Microsoft Corp. 3.7% 08/08/2046                                    | USD | 20,000  | 19,303           | 0.01        |
| President & Fellows of Harvard College 3.15% 15/07/2046            | USD | 40,000  | 35,836           | 0.01        |
| US Bank NA 3.4% 24/07/2023   | USD | 300,000 | 300,293          | 0.08        |
| US Treasury Inflation Indexed 0.375% 15/07/2025                    | USD | 50,000  | 51,429           | 0.01        |
| US Treasury Inflation Indexed 0.625% 15/01/2026                    | USD | 270,000 | 279,990          | 0.08        |
| Wells Fargo & Co., FRN 3.584% 22/05/2028                           | USD | 100,000 | 96,164           | 0.03        |
|  |     |         | 3,505,089        | 0.94        |
| <b>債券合計</b>  |     |         | <b>8,700,741</b> | <b>2.34</b> |
| 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                             |     |         | <b>8,700,741</b> | <b>2.34</b> |
| <b>新規発行証券</b>  |     |         |                  |             |
| <b>債券</b>  |     |         |                  |             |
| <i>Germany</i>   |     |         |                  |             |
| Daimler Finance North America LLC, 144A 3%<br>22/02/2021           | USD | 250,000 | 247,341          | 0.07        |
| Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A<br>4.25% 13/11/2023  | USD | 375,000 | 372,307          | 0.10        |
| Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A<br>4.625% 13/11/2025 | USD | 375,000 | 371,414          | 0.10        |
|  |     |         | 991,062          | 0.27        |
| <i>Japan</i>   |     |         |                  |             |
| Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 144A 5% 26/11/2028                 | USD | 200,000 | 204,783          | 0.05        |
|  |     |         | 204,783          | 0.05        |
| <i>United States of America</i>                                    |     |         |                  |             |
| Anheuser-Busch Cos. LLC, Reg. S 3.65% 01/02/2026                   | USD | 20,000  | 18,922           | 0.01        |
| Anheuser-Busch Cos. LLC, Reg. S 4.9% 01/02/2046                    | USD | 260,000 | 241,951          | 0.06        |
| Cigna Corp., 144A 3.4% 17/09/2021                                  | USD | 115,000 | 114,807          | 0.03        |
| Cigna Corp., 144A 4.125% 15/11/2025                                | USD | 80,000  | 80,043           | 0.02        |
| Keurig Dr Pepper, Inc., 144A 4.597% 25/05/2028                     | USD | 400,000 | 397,968          | 0.11        |
|  |     |         | 853,691          | 0.23        |
| <b>債券合計</b>  |     |         | <b>2,049,536</b> | <b>0.55</b> |
| <b>新規発行証券合計</b>  |     |         | <b>2,049,536</b> | <b>0.55</b> |
| <b>その他譲渡可能な有価証券と短期金融商品</b>   |     |         |                  |             |
| <b>株式</b>  |     |         |                  |             |
| <i>United Kingdom</i>  |     |         |                  |             |
| Randgold Resources Ltd. <sup>1</sup>                               | GBP | 10,000  | 827,272          | 0.22        |

|   |     |  |            |  |                    |               |
|---|-----|--|------------|--|--------------------|---------------|
|   |     |  |            |  | 827,272            | 0.22          |
| 株式合計  |     |  |            |  | <b>827,272</b>     | <b>0.22</b>   |
| その他譲渡可能な有価証券と短期金融商品の合計  |     |  |            |  | <b>827,272</b>     | <b>0.22</b>   |
| 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- UCITS   |     |  |            |  |                    |               |
| Luxembourg  |     |  |            |  |                    |               |
| JPMorgan US Dollar Treasury Liquidity Fund - JPM US Dollar Treasury Liquidity Institutional (dist.) | USD |  | 17,743,607 |  | 17,743,607         | 4.76          |
|   |     |  |            |  | 17,743,607         | 4.76          |
| 集団投資スキーム合計- UCITS   |     |  |            |  | <b>17,743,607</b>  | <b>4.76</b>   |
| 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  |     |  |            |  | <b>17,743,607</b>  | <b>4.76</b>   |
| 投資総額  |     |  |            |  | <b>358,949,229</b> | <b>96.37</b>  |
| 銀行預金  |     |  |            |  | <b>9,439,325</b>   | <b>2.53</b>   |
| その他の純資産 / (負債)  |     |  |            |  | <b>4,069,004</b>   | <b>1.10</b>   |
| 純資産総額   |     |  |            |  | <b>372,457,558</b> | <b>100.00</b> |

<sup>1</sup> .証券は取締役会により公正な価値で評価されている。

| TBA                      |                            |     |           |                  |                          |             |
|--------------------------|----------------------------|-----|-----------|------------------|--------------------------|-------------|
| 国                        | 投資銘柄                       | 通貨  | 額面        | 評価額<br>(USD)     | 未実現利益<br>/ (損失)<br>(USD) | 投資比率<br>(%) |
| United States of America | FNMA, 4.50%,<br>25/01/2048 | USD | 1,050,662 | 1,088,641        | 16,969                   | 0.29        |
| United States of America | FNMA, 3.50%,<br>25/01/2049 | USD | 300,000   | 300,065          | 3,956                    | 0.08        |
| United States of America | FNMA, 4.00%,<br>25/01/2049 | USD | 2,401,834 | 2,449,357        | 44,777                   | 0.66        |
| TBA ロングポジションの合計          |                            |     |           | <b>3,838,063</b> | <b>65,702</b>            | <b>1.03</b> |
| TBA 総額                   |                            |     |           | <b>3,838,063</b> | <b>65,702</b>            | <b>1.03</b> |

| 金融先物取引                     |      |     |                             |                          |             |  |
|----------------------------|------|-----|-----------------------------|--------------------------|-------------|--|
| 銘柄                         | 契約口数 | 通貨  | グローバル・エクス<br>ポージャー<br>(USD) | 未実現利益<br>/ (損失)<br>(USD) | 投資比率<br>(%) |  |
| US 2 Year Note, 29/03/2019 | 9    | USD | 1,910,813                   | 6,328                    |             |  |
| US 5 Year Note, 29/03/2019 | 42   | USD | 4,816,875                   | 25,430                   | 0.01        |  |
| 金融先物取引の未実現益合計              |      |     |                             | <b>31,758</b>            | <b>0.01</b> |  |
| 金融先物取引の未実現損益総額             |      |     |                             | <b>31,758</b>            | <b>0.01</b> |  |

| 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<br>・パーティ  | 未実現利益<br>/ (損失)<br>(USD) | 投資比率<br>(%) |
| EUR    | 428,764     | DKK | 3,200,000 | 07/01/2019 | Bank of America | 182                      |             |
| USD    | 806,782     | ILS | 3,000,000 | 09/01/2019 | Citibank        | 4,107                    |             |
| JPY    | 217,625,680 | USD | 1,925,184 | 11/01/2019 | Citibank        | 61,799                   | 0.02        |
| BRL    | 2,100,000   | USD | 532,333   | 14/01/2019 | J.P. Morgan     | 9,034                    |             |

|                               |               |     |             |            |                 |                  |               |
|-------------------------------|---------------|-----|-------------|------------|-----------------|------------------|---------------|
| USD                           | 546,576       | BRL | 2,100,000   | 14/01/2019 | J.P. Morgan     | 5,210            |               |
| BRL                           | 1,300,000     | USD | 329,448     | 15/01/2019 | Citibank        | 5,667            |               |
| USD                           | 338,489       | BRL | 1,300,000   | 15/01/2019 | Citibank        | 3,374            |               |
| KRW                           | 198,000,000   | USD | 176,219     | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | 1,317            |               |
| USD                           | 491,839       | CAD | 650,000     | 18/01/2019 | Bank of America | 15,520           | 0.01          |
| KRW                           | 980,000,000   | USD | 872,305     | 22/01/2019 | J.P. Morgan     | 6,527            |               |
| GBP                           | 1,000,000     | USD | 1,268,505   | 24/01/2019 | Bank of America | 7,492            |               |
| JPY                           | 309,700,000   | USD | 2,745,833   | 24/01/2019 | HSBC            | 84,722           | 0.02          |
| USD                           | 622,843       | CAD | 830,000     | 24/01/2019 | Bank of America | 14,519           | 0.01          |
| USD                           | 43,850        | ZAR | 620,000     | 24/01/2019 | Citibank        | 870              |               |
| USD                           | 717,733       | AUD | 1,000,000   | 25/01/2019 | Bank of America | 13,050           | 0.01          |
| USD                           | 431,223       | AUD | 600,000     | 25/01/2019 | HSBC            | 8,413            |               |
| EUR                           | 1,150,000     | USD | 1,319,050   | 28/01/2019 | HSBC            | 1,476            |               |
| GBP                           | 425,000       | USD | 534,659     | 28/01/2019 | BNY Mellon      | 7,757            |               |
| USD                           | 416,122       | BRL | 1,400,000   | 15/03/2019 | J.P. Morgan     | 56,821           | 0.02          |
| 先物為替予約の未実現益合計                 |               |     |             |            |                 | <b>307,857</b>   | <b>0.09</b>   |
| <b>EUR Hedged Share Class</b> |               |     |             |            |                 |                  |               |
| CHF                           | 63,871        | EUR | 56,479      | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | 281              |               |
| EUR                           | 1,745,262     | CHF | 1,960,152   | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | 5,109            |               |
| EUR                           | 176,075       | GBP | 158,232     | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | 162              |               |
| EUR                           | 63,523,569    | USD | 72,430,962  | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | 445,802          | 0.12          |
| GBP                           | 219,276       | EUR | 242,378     | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | 1,640            |               |
| JPY                           | 23,552,812    | EUR | 184,585     | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | 3,400            |               |
| USD                           | 1,689,070     | EUR | 1,470,163   | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | 2,440            |               |
| <b>JPY Hedged Share Class</b> |               |     |             |            |                 |                  |               |
| JPY                           | 162,673,524   | CHF | 1,420,407   | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | 38,878           | 0.01          |
| JPY                           | 911,820,785   | EUR | 7,092,132   | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | 193,411          | 0.05          |
| JPY                           | 704,320,333   | GBP | 4,956,479   | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | 111,793          | 0.03          |
| JPY                           | 5,252,759,900 | USD | 46,557,543  | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | 1,428,174        | 0.38          |
| ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現益        |               |     |             |            |                 | <b>2,231,090</b> | <b>0.59</b>   |
| 先物為替予約の未実現益合計                 |               |     |             |            |                 | <b>2,538,947</b> | <b>0.68</b>   |
| GBP                           | 300,000       | USD | 384,216     | 07/01/2019 | Bank of America | (1,761)          |               |
| USD                           | 432,194       | CNH | 3,000,000   | 07/01/2019 | J.P. Morgan     | (4,606)          |               |
| USD                           | 454,656       | THB | 15,000,000  | 08/01/2019 | HSBC            | (6,022)          |               |
| ILS                           | 3,000,000     | USD | 807,675     | 11/01/2019 | J.P. Morgan     | (4,868)          |               |
| USD                           | 620,028       | JPY | 70,000,000  | 11/01/2019 | J.P. Morgan     | (19,091)         | (0.01)        |
| USD                           | 132,757       | PLN | 500,000     | 11/01/2019 | J.P. Morgan     | (861)            |               |
| USD                           | 896,614       | MYR | 3,750,000   | 14/01/2019 | J.P. Morgan     | (10,657)         |               |
| USD                           | 1,389,183     | INR | 98,375,000  | 15/01/2019 | J.P. Morgan     | (17,937)         | (0.01)        |
| USD                           | 682,487       | EUR | 600,000     | 17/01/2019 | J.P. Morgan     | (5,794)          |               |
| USD                           | 422,628       | PLN | 1,600,000   | 17/01/2019 | Citibank        | (5,007)          |               |
| USD                           | 176,471       | KRW | 198,000,000 | 18/01/2019 | Bank of America | (1,065)          |               |
| USD                           | 556,785       | INR | 40,000,000  | 22/01/2019 | HSBC            | (14,875)         | (0.01)        |
| USD                           | 868,163       | KRW | 980,000,000 | 22/01/2019 | J.P. Morgan     | (10,669)         | (0.01)        |
| NOK                           | 4,082,500     | USD | 477,630     | 24/01/2019 | BNY Mellon      | (4,991)          |               |
| USD                           | 399,518       | EUR | 350,000     | 24/01/2019 | J.P. Morgan     | (2,235)          |               |
| USD                           | 1,836,080     | JPY | 204,250,000 | 24/01/2019 | J.P. Morgan     | (30,697)         | (0.01)        |
| USD                           | 2,658         | PLN | 10,000      | 29/01/2019 | J.P. Morgan     | (16)             |               |
| USD                           | 726,485       | BRL | 2,850,000   | 18/03/2019 | J.P. Morgan     | (4,796)          |               |
| 先物為替予約の未実現損                   |               |     |             |            |                 | <b>(145,948)</b> | <b>(0.05)</b> |
| <b>EUR Hedged Share Class</b> |               |     |             |            |                 |                  |               |
| CHF                           | 97            | EUR | 87          | 18/01/2019 | J.P. Morgan     |                  |               |
| EUR                           | 234,883       | CHF | 265,167     | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | (702)            |               |
| EUR                           | 8,397,270     | GBP | 7,599,256   | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | (59,812)         | (0.01)        |
| EUR                           | 6,461,571     | JPY | 829,747,335 | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | (167,048)        | (0.04)        |
| EUR                           | 415,690       | USD | 477,622     | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | (726)            |               |
| GBP                           | 2,276         | EUR | 2,533       | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | (3)              |               |
| USD                           | 407,481       | EUR | 356,364     | 18/01/2019 | J.P. Morgan     | (1,354)          |               |

| JPY Hedged Share Class |           |     |             |            |            |                  |               |
|------------------------|-----------|-----|-------------|------------|------------|------------------|---------------|
| CHF                    | 36,766    | JPY | 4,151,048   | 18/01/2019 | JP. Morgan | (462)            |               |
| EUR                    | 182,386   | JPY | 23,267,532  | 18/01/2019 | JP. Morgan | (3,317)          |               |
| GBP                    | 127,456   | JPY | 17,972,606  | 18/01/2019 | JP. Morgan | (1,606)          |               |
| USD                    | 1,206,570 | JPY | 134,038,133 | 18/01/2019 | JP. Morgan | (17,913) (0.01)  |               |
| ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現損 |           |     |             |            |            | <b>(252,943)</b> | <b>(0.06)</b> |
| 先物為替予約の未実現損合計          |           |     |             |            |            | <b>(398,891)</b> | <b>(0.11)</b> |
| 先物為替予約の未実現損益総額         |           |     |             |            |            | <b>2,140,056</b> | <b>0.57</b>   |

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)

損益および純資産変動計算書

2018年12月31日現在

(USD)

|                            |             |
|----------------------------|-------------|
| 収益                         |             |
| 受取配当金(源泉徴収税額控除後)           | 4,644,642   |
| 債券および転換社債に係る利息(源泉徴収税額控除後)  | 3,000,985   |
| 銀行預金利息                     | 112,122     |
| スワップ取引                     |             |
| 収益小計                       | 7,757,749   |
| 費用                         |             |
| 運用報酬                       | 1,672,087   |
| 管理手数料                      | 294,886     |
| 専門家サービス                    | 129,713     |
| 年次税                        | 79,434      |
| 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 | 65,355      |
| 印刷費用                       | 21,762      |
| その他費用                      | 18,563      |
| 当座貸越利息*                    |             |
| スワップ取引                     |             |
| 費用小計                       | 2,281,800   |
| 費用の払戻し                     | 190,403     |
| 投資純利益/(損失)(a)              | 5,666,352   |
| 実現純利益/(損失)                 |             |
| 投資有価証券の売却取引                | -6,940,916  |
| スワップ取引                     |             |
| 金融先物取引                     |             |
| 為替取引                       | -2,536,993  |
| 当期実現純利益/(損失)(b)            | -9,477,909  |
| 未実現評価利益/(損失)の増減            |             |
| 投資有価証券                     | -24,089,863 |
| スワップ取引                     |             |
| 為替取引                       | 2,039,136   |
| 金融先物取引                     | 31,758      |

|                         |             |
|-------------------------|-------------|
| 当期末実現評価利益 / (損失)の増減 (c) | -22,018,969 |
| 当期損益 (a+b+c)            | -25,830,526 |
| 配当金の分配                  | -126,804    |
| 当期投資証券の差引増減額            | 226,799,849 |
| 期首純資産総額                 | 171,615,039 |
| 期末純資産総額                 | 372,457,558 |

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

\*主に中央銀行が実施するマイナス金利政策によるものです。

#### 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

「キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)」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<br>(%) | 償還日        | 種類  | 額面<br>(千円) | 評価額       |             |
|----|--|-----------|------------|-----|------------|-----------|-------------|
|    |  |           |            |     |            | 単価<br>(円) | 評価金額(円)     |
| 日本 | 第4回クレディ・アグリ<br>コル・エス・エー円貨社<br>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<br>(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・<br>バンキング・コーポレー<br>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<br>ラル非上位円貨社債<br>(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<br>ルディングス(社債間限<br>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<br>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<br>ト・パナソニックファイ<br>ナンス(社債間限定同順<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>リース(社債間限定同順<br>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<br>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<br>(社債間限定同順位特約<br>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<br>(社債間限定同順位特約<br>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・グローバル・アロケーション・ファンドF(限定為替ヘッジ)

2019年6月28日現在

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 8,588,343,836円 |
| 負債総額           | 38,851,218円    |
| 純資産総額( - )     | 8,549,492,618円 |
| 発行済口数          | 7,074,166,448口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.2086円        |

(参考) キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)

2019年6月28日現在

|      |                |
|------|----------------|
| 資産総額 | 8,571,022,709円 |
|------|----------------|

|                |                |
|----------------|----------------|
| 負債総額           | 17,856,000円    |
| 純資産総額( - )     | 8,553,166,709円 |
| 発行済口数          | 6,773,136,770口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.2628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<br>番号 | 内訳<br>(千円) | 金額<br>(千円) |
|-----------------|----------|------------|------------|
| (資産の部)<br>・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<br>番号 | 内訳<br>(千円) | 金額<br>(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<br>営業外費用計 |  |  | 45      |
|                     |  |  | 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<br>合計 | 評価・換算差額等                         |                            | 純資産<br>合計 |
|---|---------|-----------|-------------|-----------------------------|-------------|------------|----------------------------------|----------------------------|-----------|
|   | 資本金     | 資本剰余金     |             | 利益剰余金                       |             |            | その他<br>有価<br>証券<br>評価<br>差額<br>金 | 評価・<br>換算<br>差額<br>等合<br>計 |           |
|   |         | 資本<br>準備金 | 資本剰余金<br>合計 | その他利益<br>剰余金<br>繰越利益<br>剰余金 | 利益剰余金<br>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<br>変動額                               |         |           |             |                             |             |            |                                  |                            |           |
| 中間純<br>利益                                 |         |           |             | 249,225                     | 249,225     | 249,225    |                                  |                            | 249,225   |
| 株主資本<br>以外の項<br>目の当中<br>間期変動<br>額(純<br>額) |         |           |             |                             |             |            | 32                               | 32                         | 32        |
| 当中間期<br>変動額合<br>計                         | -       | -         | -           | 249,225                     | 249,225     | 249,225    | 32                               | 32                         | 249,192   |
| 当中間期<br>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<br>(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。   |          |
| <p>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。</p> <p>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。</p> |          |
| *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<br>(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<br>(株) | 増加<br>(株) | 減少<br>(株) | 当中間会計期間末<br>(株) |
| 普通株式                                 | 56,400         | -         | -         | 56,400          |

## [リース取引関係]

| 当中間会計期間<br>(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<br>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<br>計上額(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|---------------------|--------------------|--------------|------------|
| その他有価証券<br>(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・グローバル・アロケーション・ファンドF（限定為替ヘッジ）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・グローバル・アロケーション・ファンドF（限定為替ヘッジ）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。