

【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】	2020年8月14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】	代表取締役会長 クワック・ソン・ギョン
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内二丁目1番1号 明治安田生命ビル
【事務連絡者氏名】	原田 伸健
【電話番号】	03(6366)1000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	キャピタル・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 信託受益証券の金額】	継続募集額(2020年2月14日から2021年2月18日まで) 3,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2020年2月13日付けをもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、「第二部ファンド情報」及び「第三部委託会社等の情報」における訂正事項を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書を以下の内容に訂正します。下線部_____は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(前略)

委託会社の概況(2019年12月30日現在)

(以下略)

<訂正後>

(前略)

委託会社の概況(2020年6月30日現在)

(以下略)

2【投資方針】

(2)【投資対象】

<訂正前>

(前略)

<参考情報2>投資対象ファンドの概要等

(中略)

上記は、2019年12月31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12月31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、2020年6月30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、2020年6月30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(2019年12月30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12月30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(2020年6月30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2020年6月30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2019年12月30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)

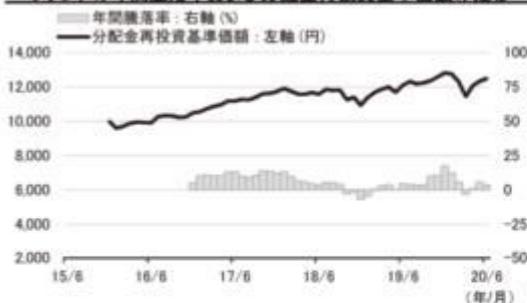
上記は2020年6月30日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

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

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



(注1) 年間騰落率は、2016年12月から2020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・ディバースィファイド(円ベース)

※ 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

「ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数について

「日本株」の資産クラスはTOPIX(配当込み)を表示しております。

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

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

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

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

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

「日本国債」の資産クラスはNOMURA-BPI国債を表示しております。

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

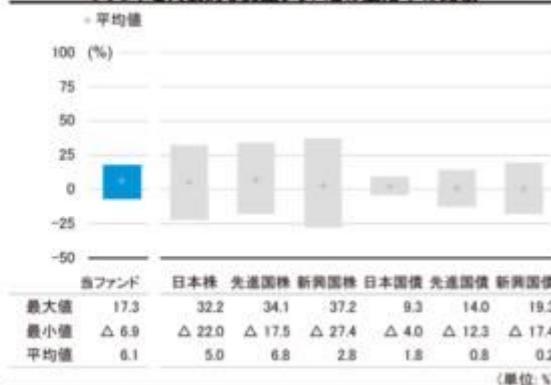
「先進国債」の資産クラスはFTSE世界国債インデックス(除く日本/円ベース)を表示しております。

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

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

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

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、2015年7月から2020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2020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】

(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、2019年12月31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留意ください。また、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が以下と異なる場合があります。

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、2020年6月30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留意ください。また、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が以下と異なる場合があります。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）

2020年6月30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	7,504,772,845	99.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,005,217	0.10
合計(純資産総額)		7,512,778,062	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）

2020年6月30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	4,813,338	0.06
投資証券	ルクセンブルク	7,494,567,981	99.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,500,000	0.07
合計(純資産総額)		7,504,881,319	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）

2020年6月30日現在

資産の種類	国/地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
	米国	21,069,280,505	23.92
	英国	4,815,027,308	5.47
	スイス	3,895,865,088	4.42
	日本	2,995,558,500	3.40
	オランダ	2,500,771,245	2.84

株式	台湾	1,797,681,181	2.04
	フランス	1,671,076,919	1.90
	ドイツ	1,280,684,248	1.45
	中国	1,195,232,944	1.36
	ブラジル	1,140,208,330	1.29
	イタリア	1,083,774,252	1.23
	香港	1,019,609,914	1.16
	デンマーク	641,329,159	0.73
	スウェーデン	410,237,988	0.47
	ロシア	400,916,831	0.46
	カナダ	388,332,986	0.44
	ニュージーランド	373,758,734	0.42
	メキシコ	260,066,385	0.30
	インドネシア	199,087,562	0.23
	ノルウェー	106,081,539	0.12
	フィンランド	83,664,322	0.09
	スペイン	30,505,091	0.03
債券	米国	16,872,545,675	19.16
	日本	4,288,188,831	4.87
	中国	1,252,355,522	1.42
	ドイツ	1,235,280,831	1.40
	英国	815,401,823	0.93
	メキシコ	757,042,806	0.86
	カナダ	644,463,144	0.73
	ルーマニア	506,639,384	0.58
	ギリシャ	500,403,816	0.57
	イタリア	466,758,746	0.53
	ベルギー	452,452,340	0.51
	マレーシア	390,609,121	0.44
	ロシア	387,994,360	0.44
	韓国	361,109,103	0.41
	デンマーク	352,241,408	0.40
	フランス	275,407,123	0.31
	イスラエル	261,807,412	0.30
	オランダ	234,170,201	0.27
	インドネシア	180,530,123	0.20
	ブラジル	156,427,575	0.18
	カタール	134,470,840	0.15
	アラブ首長国連邦	133,260,266	0.15
	パナマ	125,372,912	0.14
	モロッコ	112,057,601	0.13
	チリ	103,195,653	0.12
	シンガポール	98,343,594	0.11
	セルビア	87,267,167	0.10
	インド	85,003,129	0.10
	サウジアラビア	79,519,269	0.09
	南アフリカ	76,971,103	0.09
タイ	70,999,568	0.08	

ポルトガル	68,399,876	0.08
トルコ	43,142,854	0.05
ウクライナ	42,952,107	0.05
スリランカ	39,334,158	0.04
ノルウェー	31,481,904	0.04
ペルー	24,757,427	0.03
ハンガリー	24,329,425	0.03
国際機関	21,993,205	0.02
エストニア	19,383,538	0.02
ウルグアイ	14,471,791	0.02
スイス	13,505,872	0.02
スペイン	12,355,188	0.01
銀行預金、その他資産（負債控除後）	8,863,657,571	10.06
純資産総額	88,076,806,390	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

2020年1月22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	1,706,042,000	93.44
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		119,860,149	6.56
合計（純資産総額）		1,825,902,149	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（2020年1月22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

2020年6月30日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	キャピタル・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）	5,711,829,550	1.3093	7,478,498,430	1.3139	7,504,772,845	99.89

（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

2020年6月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.89
合計	99.89

（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

2020年6月30日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ルクセンブルク	投資証券	キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド（LUX）（クラスCh-JPY）	3,240,193.68	2,305.89	7,471,530,204	2,313	7,494,567,981	99.86
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	1.0545	4,829,367	1.051	4,813,338	0.06

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

b. 種類別投資比率

2020年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	0.06
投資証券	99.86
合計	99.92

（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

2020年6月30日現在

順位	銘柄	利率(%) (上段) 償還日 (下段)	国/地域 (上段) 資産(中 段) 業種/種類 (下段)	数量	評価単価(上 段) 通貨(下段)	評価金額(円)	投資 比率 (%)
1	US TREASURY BOND	1.5 2030/2/15	米国 債券 国債証券	28,877,000	108.2485 米ドル	3,363,928,295	3.82
2	US TREASURY BOND	0.5 2025/3/31	米国 債券 国債証券	17,509,000	101.0783 米ドル	1,904,548,510	2.16
3	MICROSOFT CORP	- -	米国 株式 情報技術	87,745	198.44 米ドル	1,873,805,057	2.13
4	US TREASURY NOTE	0.375 2022/3/31	米国 債券 国債証券	17,275,000	100.3701 米ドル	1,865,930,210	2.12

5	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO	- -	台湾 株式 情報技術	1,579,000	312.00 台湾ドル	1,797,681,181	2.04
6	ASTRAZENECA PLC (GBP)	- -	英国 株式 ヘルスケア	155,200	85.48 英ポンド	1,754,968,244	1.99
7	ASML HOLDING NV	- -	オランダ 株式 情報技術	40,610	322.20 ユーロ	1,582,203,698	1.80
8	NESTLE SA	- -	スイス 株式 生活必需品	132,850	104.92 スイス・フラン	1,576,463,275	1.79
9	US TREASURY BOND	2.375 2049/11/15	米国 債券 国債証券	11,025,000	124.0119 米ドル	1,471,345,438	1.67
10	BROADCOM INC	- -	米国 株式 情報技術	44,020	309.78 米ドル	1,467,493,626	1.67
11	US TREASURY NOTE	2.5 2024/1/31	米国 債券 国債証券	11,115,000	108.2158 米ドル	1,294,413,315	1.47
12	MERCK & CO INC	- -	米国 株式 ヘルスケア	152,500	76.12 米ドル	1,249,227,205	1.42
13	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	- -	米国 株式 生活必需品	153,900	70.51 米ドル	1,167,782,989	1.33
14	ZURICH INSURANCE GROUP AG	- -	スイス 株式 金融	28,959	332.20 スイス・フラン	1,088,045,874	1.24
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	- -	米国 株式 ヘルスケア	34,300	289.76 米ドル	1,069,560,518	1.21
16	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	- -	英国 株式 生活必需品	238,900	31.405 英ポンド	992,494,205	1.13
17	JAPAN GVT 358 JPY BD	0.1 2030/3/20	日本 債券 国債証券	932,050,000	100.8938 日本円	940,380,663	1.07
18	ALTRIA GROUP INC	- -	米国 株式 生活必需品	205,500	39.23 米ドル	867,566,840	0.99

19	JPMORGAN CHASE & CO	- -	米国 株式 金融	84,300	93.00 米ドル	843,690,839	0.96
20	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	- -	フランス 株式 一般消費 財・サー ビス	16,095	389.50 ユーロ	758,057,786	0.86
21	JAPAN GVT 356 JPY BD	0.1 2029/9/20	日本 債券 国債証券	738,300,000	101.0854 日本円	746,313,508	0.85
22	HOME DEPOT INC	- -	米国 株式 一般消費 財・サー ビス	27,650	246.12 米ドル	732,343,535	0.83
23	HUMANA INC	- -	米国 株式 ヘルスケ ア	17,600	379.36 米ドル	718,516,945	0.82
24	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL A	- -	米国 株式 金融	25	265,219.00 米ドル	713,538,567	0.81
25	CROWN CASTLE INTL CORP	- -	米国 株式 不動産	40,700	162.30 米ドル	710,862,720	0.81
26	PAGSEGURO DIGITAL LTD CL A	- -	ブラジル 株式 情報技術	177,000	35.16 米ドル	669,722,582	0.76
27	PFIZER INC	- -	米国 株式 ヘルスケ ア	183,950	32.64 米ドル	646,134,235	0.73
28	COLOPLAST B	- -	デンマー ク 株式 ヘルスケ ア	38,825	1,018.00 デンマーク・ク ローネ	641,329,159	0.73
29	ENEL SPA	- -	イタリア 株式 公益事業	660,100	7.724 ユーロ	616,532,347	0.70
30	US TREASURY I/L	0.875 2029/1/15	米国 債券 国債証券	4,910,000	116.0537 米ドル	613,215,761	0.70

(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

2020年1月22日現在

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	
日本	第29回フランス相互 信用連合銀行(B F C M)円貨社債 (2019)	0.25	2024/10/10	社債券	100,000	99.829	99,829,000	5.47
日本	第2回マラヤン・バ ンキング・ベルハッ ド円貨社債(2015)	0.509	2020/4/30	社債券	100,000	100.08	100,080,000	5.48
日本	第1回バンコ・サン タンデール・エセ・ ア - 円貨社債 (2019)	0.463	2024/12/5	社債券	100,000	99.766	99,766,000	5.46
日本	第17回シティグルー プ・インク円貨社 債(2005)	2.04	2020/9/16	社債券	100,000	101.21	101,210,000	5.54
日本	第19回ルノー円貨社 債(2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	99.859	99,859,000	5.47
日本	第8回ケーティー円 貨社債(2018)	0.3	2020/11/13	社債券	100,000	99.957	99,957,000	5.47
日本	第1回明治安田生命 2019基金特定目的会 社特定社債(一般担 保付)	0.29	2024/8/2	社債券	100,000	99.857	99,857,000	5.47
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	99.941	99,941,000	5.47
日本	第28回三菱東京UF J銀行(劣後特約 付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	101.45	101,450,000	5.56
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	101.348	101,348,000	5.55
日本	第19回みずほ銀行 (劣後特約付)	1.67	2022/2/24	社債券	100,000	103.207	103,207,000	5.65
日本	第22回芙蓉総合リー ス(社債間限定同順 位特約付)	0.04	2022/10/28	社債券	100,000	99.648	99,648,000	5.46
日本	第5回イオンフィナ ンシャルサービス (社債間限定同順位 特約付)	0.23	2022/5/27	社債券	100,000	99.949	99,949,000	5.47
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	100.049	100,049,000	5.48
日本	第74回三菱UFJ リース(社債間限定 同順位特約付)	0.09	2023/1/23	社債券	100,000	99.931	99,931,000	5.47

日本	第2回野村ホールディングス（担保提供制限等財務上特約無）	0.29	2024/9/3	社債券	100,000	99.628	99,628,000	5.46
日本	第29回相鉄ホールディングス（相模鉄道株式会社保証付）	0.91	2020/6/25	社債券	100,000	100.333	100,333,000	5.49

（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（2020年1月22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 (2016年11月21日)	560,747,978	560,747,978	1.0177	1.0177
第2期 (2017年11月20日)	4,746,506,988	4,746,506,988	1.1541	1.1541
第3期 (2018年11月20日)	9,032,745,456	9,032,745,456	1.1290	1.1290
第4期 (2019年11月20日)	8,330,224,765	8,330,224,765	1.2506	1.2506
2019年 6月末日	8,549,492,618		1.2086	
7月末日	8,675,828,396		1.2316	
8月末日	8,552,045,842		1.2163	

9月末日	8,629,757,899		1.2231
10月末日	8,255,574,992		1.2360
11月末日	8,381,924,176		1.2575
12月末日	8,386,685,425		1.2805
2020年 1月末日	8,485,689,423		1.2753
2月末日	8,175,526,575		1.2297
3月末日	7,484,336,368		1.1445
4月末日	7,845,937,819		1.2072
5月末日	7,916,441,484		1.2322
6月末日	7,512,778,062		1.2481

(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
第4期	2018年11月21日～2019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期	2018年11月21日～2019年11月20日	10.8
第5中間計算期間末	2019年11月21日～2020年 5月20日	3.7

(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期	2018年11月21日～2019年11月20日	1,334,725,869	2,674,557,743	6,660,764,120
第5中間計算期間末	2019年11月21日～2020年5月20日	479,397,342	690,069,970	6,450,091,492

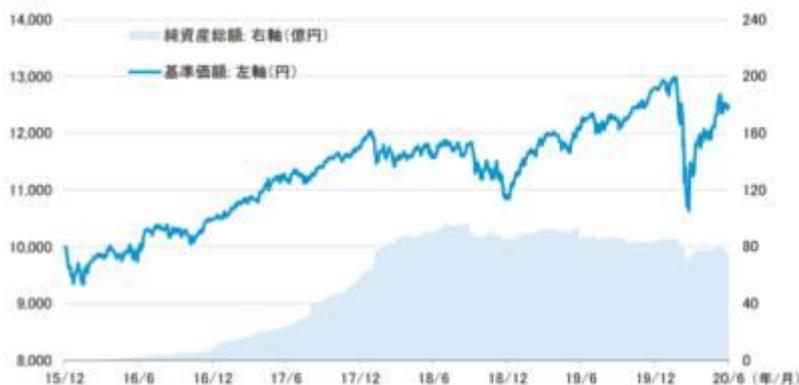
(注)第1期の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(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

2020年6月30日現在

基準価額・純資産の推移(設定～2020年6月30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
第4期	2019年11月	0円
設定未累計		0円

分配金は1万円当たり、税引前

主要な資産の状況(2020年6月30日現在)

<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>

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Ch-JPY)	99.86
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.06

<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>

(2020年6月30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	US TREASURY BOND 1.5% 02-15-30	米国	債券	国債証券	3.82
2	US TREASURY BOND 0.5% 03-31-25	米国	債券	国債証券	2.16
3	MICROSOFT CORP	米国	株式	情報技術	2.13
4	US TREASURY NOTE 0.375% 03-31-22	米国	債券	国債証券	2.12
5	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO	台湾	株式	情報技術	2.04
6	ASTRAZENECA PLC (GBP)	英国	株式	ヘルスケア	1.99
7	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	1.80
8	NESTLE SA	スイス	株式	生活必需品	1.79
9	US TREASURY BOND 2.375% 11-15-49	米国	債券	国債証券	1.67
10	BROADCOM INC	米国	株式	情報技術	1.67

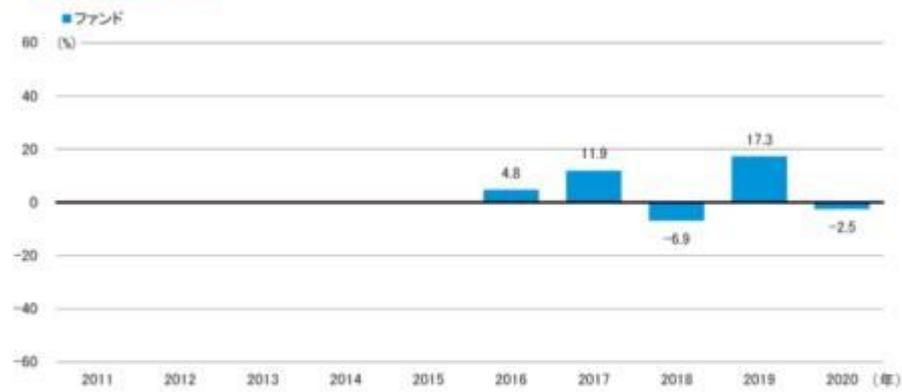
資産別構成比率

資産	証券種別	投資比率(%)
株式		53.77
債券		36.17
	国債証券	29.47
	社債券	4.99
	その他証券	1.70
現金・その他		10.06

国別構成比率

国名	株式	債券	合計
米国	23.92	19.16	43.08
日本	3.40	4.87	8.27
英国	5.47	0.93	6.39
スイス	4.42	0.02	4.44
オランダ	2.84	0.27	3.11
その他国	13.72	10.93	24.65
現金・その他			10.06

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として算出しています。

2020年は6月末までの収益率を表示しています。

- ・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5期中間計算期間（2019年11月21日から2020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4期 2019年11月20日現在	第5期中間計算期間 2020年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	59,496,890	47,011,292
親投資信託受益証券	8,321,212,106	7,755,590,758
未収入金	-	13,900,000
流動資産合計	8,380,708,996	7,816,502,050
資産合計	8,380,708,996	7,816,502,050
負債の部		
流動負債		
未払解約金	17,444,274	17,085,281
未払受託者報酬	946,341	884,341
未払委託者報酬	31,229,215	29,183,273
未払利息	163	128
その他未払費用	864,238	877,786
流動負債合計	50,484,231	48,030,809
負債合計	50,484,231	48,030,809
純資産の部		
元本等		
元本	6,660,764,120	6,450,091,492
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,669,460,645	1,318,379,749
元本等合計	8,330,224,765	7,768,471,241
純資産合計	8,330,224,765	7,768,471,241
負債純資産合計	8,380,708,996	7,816,502,050

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	第4期中間計算期間 自 2018年11月21日 至 2019年5月20日	第5期中間計算期間 自 2019年11月21日 至 2020年5月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	439,443,676	280,539,348
営業収益合計	439,443,676	280,539,348
営業費用		
支払利息	12,885	14,049
受託者報酬	954,190	884,341
委託者報酬	31,488,476	29,183,273
その他費用	898,484	877,952
営業費用合計	33,354,035	30,959,615
営業利益又は営業損失()	406,089,641	311,498,963
経常利益又は経常損失()	406,089,641	311,498,963
中間純利益又は中間純損失()	406,089,641	311,498,963
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()	13,448,845	17,265,776
期首剰余金又は期首欠損金()	1,032,149,462	1,669,460,645
剰余金増加額又は欠損金減少額	82,068,823	116,358,799
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	82,068,823	116,358,799
剰余金減少額又は欠損金増加額	112,177,413	173,206,508
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	112,177,413	173,206,508
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()	1,394,681,668	1,318,379,749

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第4期 2019年11月20日現在	第5期中間計算期間 2020年5月20日現在
1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 6,660,764,120口	1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数 6,450,091,492口
2. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2506円 (1万口当たり純資産額) (12,506円)	2. 当該中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2044円 (1万口当たり純資産額) (12,044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4期 自 2018年11月21日 至 2019年11月20日	第5期中間計算期間 自 2019年11月21日 至 2020年5月20日
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

当ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第4期	第5期中間計算期間
	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日	自 2019年11月21日 至 2020年5月20日
期首元本額	8,000,595,994円	6,660,764,120円
期中追加設定元本額	1,334,725,869円	479,397,342円
期中一部解約元本額	2,674,557,743円	690,069,970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）

2020年5月20日現在	
資産の部	
流動資産	
投資信託受益証券	4,810,132
投資証券	7,742,367,430
未収入金	22,300,000
流動資産合計	7,769,477,562
資産合計	7,769,477,562
負債の部	
流動負債	
未払解約金	13,900,000
流動負債合計	13,900,000
負債合計	13,900,000
純資産の部	
元本等	
元本	6,122,190,368
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,633,387,194
元本等合計	7,755,577,562
純資産合計	7,755,577,562
負債純資産合計	7,769,477,562

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資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	2020年5月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数		6,122,190,368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	1.2668円
	(1万口当たり純資産額)	(12,668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 2019年11月21日 至 2020年5月20日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) 投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2020年5月20日現在
同計算期間の期首元本額	6,349,646,781円
同計算期間の追加設定元本額	281,406,277円
同計算期間の一部解約元本額	508,862,690円
計算日の元本額	6,122,190,368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）	6,122,190,368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C（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、2019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ラス・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

Capital Group Global Allocation Fund (LUX)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing				
Bonds				
<i>Austria</i>				
Austria Government Bond, Reg. S, 144A 0% 15/07/2024	EUR	255,000	291,010	0.04
			<u>291,010</u>	<u>0.04</u>
<i>Brazil</i>				
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/01/2022	BRL	180,000	404,017	0.06
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/07/2022	BRL	1,920,000	417,057	0.06
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2025	BRL	2,830,000	808,959	0.11
			<u>1,630,033</u>	<u>0.23</u>
<i>Canada</i>				
Canada Government Bond 1% 01/06/2027	CAD	1,870,000	1,368,338	0.19
Canada Government Bond 2.25% 01/06/2025	CAD	1,130,000	895,446	0.12
Cenovus Energy, Inc. 4.25% 15/04/2027	USD	110,000	116,511	0.02
Province of Quebec Canada 2.375% 31/01/2022	USD	46,000	46,553	0.01
			<u>2,426,848</u>	<u>0.34</u>
<i>Chile</i>				
Banco del Estado de Chile, 144A 2.668% 08/01/2021	USD	450,000	451,512	0.07
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4.5% 01/03/2026	CLP	10,000,000	14,673	-
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4.5% 01/03/2021	CLP	15,000,000	20,541	-
Enel Americas SA 4% 25/10/2026	USD	5,000	5,189	-
			<u>491,915</u>	<u>0.07</u>
<i>China</i>				
China Development Bank 4.04% 06/07/2028	CNY	6,000,000	882,316	0.13
China Development Bank 3.48% 08/01/2029	CNY	18,500,000	2,615,690	0.37
China Government Bond 3.29% 23/05/2029	CNY	9,000,000	1,306,361	0.18
China Government Bond 3.86% 22/07/2049	CNY	5,300,000	781,415	0.11
China Government Bond, Reg. S 0.125% 12/11/2026	EUR	200,000	223,580	0.03
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd., 144A 3.5% 04/05/2027	USD	350,000	366,555	0.05
			<u>6,175,917</u>	<u>0.87</u>
<i>Colombia</i>				
Colombia Government Bond 4.375% 12/07/2021	USD	325,000	335,728	0.05
Colombian TES 6.25% 26/11/2025	COP	2,000,000	627	-
Colombian TES 10% 24/07/2024	COP	370,500,000	133,703	0.02
Colombian TES 6% 28/04/2028	COP	490,000,000	148,543	0.02
			<u>618,601</u>	<u>0.09</u>
<i>Denmark</i>				
Nykredit Realkredit A/S 1.5% 01/10/2037	DKK	2,784,026	432,303	0.06

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 1.5% 01/10/2040	DKK	3,327,787	516,313	0.07
			948,616	0.13
<i>France</i>				
BPCE SA, Reg. S 0.875% 31/01/2024	EUR	200,000	229,575	0.03
France Government Bond OAT, Reg. S 0.75% 25/11/2028	EUR	580,000	692,251	0.10
France Government Bond OAT, Reg. S 0% 25/11/2029	EUR	490,000	543,451	0.08
France Government Bond OAT, Reg. S, 144A 2% 25/05/2048	EUR	365,000	526,785	0.07
Orange SA, STEP 9% 01/03/2031	USD	30,000	46,433	0.01
Total Capital International SA 2.875% 17/02/2022	USD	60,000	61,301	0.01
			2,099,796	0.30
<i>Germany</i>				
Allianz SE, Reg. S, FRN 4.75% Perpetual	EUR	100,000	129,800	0.02
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.5% 15/08/2027	EUR	770,000	919,704	0.13
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.25% 15/02/2029	EUR	1,000,000	1,171,115	0.17
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 1.25% 15/08/2048	EUR	630,000	887,731	0.13
Daimler International Finance BV, Reg. S 0.875% 09/04/2024	EUR	275,000	316,074	0.04
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Reg. S 0.5% 15/04/2030	EUR	365,000	515,337	0.07
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Reg. S 0.1% 15/04/2026	EUR	440,000	568,343	0.08
			4,508,104	0.64
<i>Greece</i>				
Greece Government Bond, Reg. S, 144A 3.875% 12/03/2029	EUR	1,710,000	2,316,613	0.33
Greece Government Bond, Reg. S 3.75% 30/01/2028	EUR	1,575,000	2,091,923	0.29
Greece Government Bond, Reg. S 3.9% 30/01/2033	EUR	225,000	310,197	0.04
Greece Government Bond, Reg. S 4.2% 30/01/2042	EUR	225,000	334,039	0.05
			5,052,772	0.71
<i>India</i>				
Housing Development Finance Corp. Ltd., Reg. S 6.875% 30/04/2020	INR	20,000,000	282,338	0.04
India Government Bond 7.72% 25/05/2025	INR	24,300,000	356,679	0.05
India Government Bond 7.59% 11/01/2026	INR	35,050,000	511,548	0.07
India Government Bond 7.17% 08/01/2028	INR	78,500,000	1,122,597	0.16
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Reg. S 7.125% 10/10/2022	INR	20,000,000	274,630	0.04
National Highways Authority of India, Reg. S 7.3% 18/05/2022	INR	30,000,000	420,067	0.06
NTPC Ltd., Reg. S 7.25% 03/05/2022	INR	10,000,000	140,045	0.02
			3,107,904	0.44

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Indonesia</i>				
Indonesia Government Bond, 144A 3.85% 18/07/2027	USD	625,000	666,738	0.09
Indonesia Government Bond, Reg. S 3.85% 18/07/2027	USD	250,000	266,695	0.04
Indonesia Treasury 6.125% 15/05/2028	IDR	2,000,000,000	136,071	0.02
Indonesia Treasury 8.25% 15/05/2029	IDR	6,886,000,000	535,826	0.08
Indonesia Treasury 8.375% 15/03/2034	IDR	2,000,000,000	154,511	0.02
			<u>1,759,841</u>	<u>0.25</u>
<i>Ireland</i>				
Ireland Government Bond, Reg. S 0.9% 15/05/2028	EUR	540,000	649,858	0.09
Ireland Government Bond, Reg. S 1.1% 15/05/2029	EUR	400,000	490,232	0.07
Ireland Government Bond, Reg. S 1% 15/05/2026	EUR	280,000	336,547	0.05
			<u>1,476,637</u>	<u>0.21</u>
<i>Israel</i>				
Israel Government Bond 3.75% 31/03/2047	ILS	450,000	182,486	0.03
Israel Government Bond 4.125% 17/01/2048	USD	435,000	504,852	0.07
Israel Government Bond, Reg. S 1.5% 16/01/2029	EUR	110,000	134,993	0.02
Israel Government Bond 3.15% 30/06/2023	USD	200,000	208,314	0.03
Israel Government Bond 2% 31/03/2027	ILS	2,275,000	718,428	0.10
Israel Government Bond 5.5% 31/01/2042	ILS	1,295,000	643,702	0.09
			<u>2,392,775</u>	<u>0.34</u>
<i>Italy</i>				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S, 144A 3.85% 01/09/2049	EUR	360,000	523,237	0.08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S, 144A 1.3% 15/05/2028	EUR	170,000	214,502	0.03
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 1.75% 01/07/2024	EUR	130,000	153,602	0.02
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 2.8% 01/12/2028	EUR	375,000	476,364	0.07
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 3% 01/08/2029	EUR	1,090,000	1,409,373	0.20
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 0.1% 15/05/2023	EUR	1,995,000	2,341,924	0.33
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.35% 15/04/2022	EUR	250,000	288,574	0.04
UniCredit SpA, Reg. S, FRN 5.75% 28/10/2025	EUR	200,000	233,790	0.03
			<u>5,641,366</u>	<u>0.80</u>
<i>Japan</i>				
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/03/2024	JPY	391,000,000	3,634,178	0.51
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/06/2024	JPY	247,300,000	2,299,396	0.32
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/09/2029	JPY	684,200,000	6,371,038	0.90
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/03/2027	JPY	269,350,000	2,515,547	0.36
Japan Government Thirty Year Bond 0.5% 20/03/2049	JPY	66,550,000	627,950	0.09
Japan Government Thirty Year Bond 2% 20/03/2042	JPY	10,000,000	125,289	0.02

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Japan Government Thirty Year Bond 1.7% 20/03/2044	JPY	32,400,000	392,513	0.06
Japan Government Twenty Year Bond 0.4% 20/03/2039	JPY	83,000,000	782,231	0.11
Japan Government Twenty Year Bond 2.2% 20/03/2030	JPY	5,000,000	56,401	0.01
Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/06/2037	JPY	217,700,000	2,133,911	0.30
Japan Government Two Year Bond 0.1% 01/12/2020	JPY	206,150,000	1,901,340	0.27
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., Reg. S 2.25% 21/11/2026	EUR	250,000	313,471	0.04
Toyota Motor Credit Corp. 3.05% 11/01/2028	USD	147,000	154,970	0.02
			<u>21,308,235</u>	<u>3.01</u>
<i>Mexico</i>				
Mexican Bonos 8% 07/12/2023	MXN	20,500,000	1,130,403	0.16
Mexican Bonos 8.5% 31/05/2029	MXN	15,000,000	883,633	0.12
Mexican Bonos 5.75% 05/03/2026	MXN	2,500,000	125,400	0.02
Mexican Bonos 7.5% 03/06/2027	MXN	10,000,000	549,798	0.08
Mexico City Airport Trust, Reg. S 5.5% 31/07/2047	USD	200,000	206,939	0.03
Petroleos Mexicanos 7.47% 12/11/2026	MXN	4,140,000	192,601	0.03
			<u>3,088,774</u>	<u>0.44</u>
<i>Morocco</i>				
Morocco Government Bond, 144A 1.5% 27/11/2031	EUR	210,000	236,637	0.03
Morocco Government Bond, Reg. S 3.5% 19/06/2024	EUR	120,000	153,309	0.02
Morocco Government Bond, Reg. S 4.25% 11/12/2022	USD	400,000	422,381	0.06
			<u>812,327</u>	<u>0.11</u>
<i>Netherlands</i>				
Cooperatieve Rabobank UA, Reg. S 3.875% 25/07/2023	EUR	100,000	126,517	0.02
Enel Finance International NV, Reg. S 1% 16/09/2024	EUR	150,000	174,536	0.02
Netherlands Government Bond 5.5% 15/01/2028	EUR	80,000	130,891	0.02
Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 2.25% 15/07/2022	EUR	50,000	60,187	0.01
Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 2% 15/07/2024	EUR	40,000	49,864	0.01
			<u>541,995</u>	<u>0.08</u>
<i>Norway</i>				
Equinor ASA 3.7% 01/03/2024	USD	60,000	63,952	0.01
Norway Government Bond, Reg. S, 144A 2% 24/05/2023	NOK	8,086,000	939,497	0.13
Norway Government Bond, Reg. S, 144A 3.75% 25/05/2021	NOK	10,754,000	1,266,207	0.18
			<u>2,269,656</u>	<u>0.32</u>

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Panama</i>				
Panama Government Bond 3.16% 23/01/2030	USD	500,000	515,750	0.07
			515,750	0.07
<i>Poland</i>				
Poland Government Bond 5.75% 23/09/2022	PLN	3,100,000	906,623	0.13
Poland Government Bond 4% 25/10/2023	PLN	2,910,000	831,389	0.11
			1,738,012	0.24
<i>Portugal</i>				
Portugal Government Bond, Reg. S 5.125% 15/10/2024	USD	125,000	140,670	0.02
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, Reg. S, 144A 2.875% 15/10/2025	EUR	850,000	1,107,364	0.16
			1,248,034	0.18
<i>Qatar</i>				
Qatar Government Bond, 144A 4.5% 23/04/2028	USD	655,000	751,675	0.11
			751,675	0.11
<i>Romania</i>				
Romania Government Bond, 144A 3.5% 03/04/2034	EUR	80,000	101,243	0.02
Romania Government Bond, 144A 3.375% 08/02/2038	EUR	175,000	214,087	0.03
Romania Government Bond, 144A 4.625% 03/04/2049	EUR	1,228,000	1,704,575	0.24
Romania Government Bond, Reg. S 2.875% 11/03/2029	EUR	157,000	199,253	0.03
Romania Government Bond, Reg. S 3.875% 29/10/2035	EUR	175,000	228,529	0.03
Romania Government Bond, Reg. S 4.125% 11/03/2039	EUR	125,000	163,073	0.02
Romania Government Bond, Reg. S 4.625% 03/04/2049	EUR	250,000	347,023	0.05
			2,957,783	0.42
<i>Russian Federation</i>				
Russian Federal Bond - OFZ 6.9% 23/05/2029	RUB	20,100,000	341,500	0.05
Russian Federal Bond - OFZ 7.25% 10/05/2034	RUB	7,920,000	137,623	0.02
Russian Federal Bond - OFZ 7% 16/08/2023	RUB	14,000,000	234,765	0.03
Russian Federal Bond - OFZ 8.5% 17/09/2031	RUB	5,390,000	102,722	0.02
Russian Federal Bond - OFZ 7.7% 23/03/2033	RUB	1,490,000	26,797	-
Russian Foreign Bond - Eurobond, Reg. S 2.875% 04/12/2025	EUR	300,000	383,459	0.05
			1,226,866	0.17
<i>Saudi Arabia</i>				
KSA Sukuk Ltd., 144A 3.628% 20/04/2027	USD	225,000	239,025	0.03
KSA Sukuk Ltd., 144A 2.894% 20/04/2022	USD	200,000	203,475	0.03
Saudi Government Bond, Reg. S 3.625% 04/03/2028	USD	460,000	486,553	0.07
			929,053	0.13

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Serbia</i>				
Serbia Government Bond, 144A 1.5% 26/06/2029	EUR	110,000	125,801	0.02
			125,801	0.02
<i>South Africa</i>				
South Africa Government Bond 5.5% 09/03/2020	USD	200,000	201,324	0.03
South Africa Government Bond 6.5% 28/02/2041	ZAR	11,400,000	567,296	0.08
South Africa Government Bond 8.75% 31/01/2044	ZAR	5,950,000	373,822	0.05
South Africa Government Bond 8.75% 28/02/2048	ZAR	18,825,000	1,187,217	0.17
			2,329,659	0.33
<i>South Korea</i>				
Korea Housing Finance Corp., Reg. S 2% 11/10/2021	USD	475,000	473,831	0.07
Korea Treasury 2.25% 10/06/2021	KRW	349,080,000	305,750	0.04
Korea Treasury 2% 10/09/2022	KRW	844,000,000	740,943	0.10
Korea Treasury 1.875% 10/03/2024	KRW	289,000,000	253,687	0.04
Korea Treasury 2.375% 10/12/2028	KRW	1,100,000,000	1,004,697	0.14
Korea Treasury 2.375% 10/09/2038	KRW	1,040,000,000	997,467	0.14
Korea Treasury 4.25% 10/06/2021	KRW	75,000,000	67,530	0.01
			3,843,905	0.54
<i>Spain</i>				
CaixaBank SA, Reg. S, FRN 3.5% 15/02/2027	EUR	100,000	118,569	0.02
Spain Government Bond, Reg. S, 144A 1.4% 30/04/2028	EUR	330,000	402,720	0.06
Spain Government Bond, Reg. S, 144A 1.45% 30/04/2029	EUR	670,000	821,710	0.11
Spain Government Bond, Reg. S, 144A 1.45% 31/10/2027	EUR	435,000	532,654	0.07
			1,875,653	0.26
<i>Sri Lanka</i>				
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.25% 27/07/2021	USD	430,000	437,740	0.06
			437,740	0.06
<i>Supra National</i>				
International Finance Corp. 6.3% 25/11/2024	INR	15,000,000	212,518	0.03
			212,518	0.03
<i>Switzerland</i>				
Credit Suisse Group AG, Reg. S, FRN 2.125% 12/09/2025	GBP	100,000	134,719	0.02
			134,719	0.02
<i>Thailand</i>				
Thailand Government Bond 3.65% 20/06/2031	THB	16,725,000	678,454	0.10
			678,454	0.10
<i>Ukraine</i>				
Ukraine Government Bond, Reg. S 6.75% 20/06/2026	EUR	350,000	441,819	0.06
			441,819	0.06

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>United Arab Emirates</i>				
Abu Dhabi Government Bond, 144A 2.5% 11/10/2022	USD	775,000	785,567	0.11
			<u>785,567</u>	<u>0.11</u>
<i>United Kingdom</i>				
AstraZeneca plc 3.375% 16/11/2025	USD	350,000	371,905	0.05
Barclays Bank plc, Reg. S 10% 21/05/2021	GBP	50,000	73,794	0.01
BAT Capital Corp. 3.215% 06/09/2026	USD	349,000	351,802	0.05
BAT Capital Corp. 4.758% 06/09/2049	USD	140,000	144,896	0.02
HSBC Holdings plc, FRN 4.292% 12/09/2026	USD	250,000	270,279	0.04
HSBC Holdings plc 4% 30/03/2022	USD	110,000	114,627	0.02
HSBC Holdings plc, FRN 3.033% 22/11/2023	USD	275,000	281,396	0.04
Shell International Finance BV 3.5% 13/11/2023	USD	223,000	234,842	0.03
Shell International Finance BV 2.5% 12/09/2026	USD	110,000	111,536	0.02
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/09/2021	USD	333,000	334,892	0.05
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23/09/2023	USD	51,000	51,965	0.01
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.2% 23/09/2026	USD	10,000	10,303	-
UK Treasury, Reg. S 1% 22/04/2024	GBP	340,000	457,881	0.07
UK Treasury, Reg. S 1.5% 22/07/2047	GBP	310,000	425,651	0.06
UK Treasury, Reg. S 3.75% 07/09/2020	GBP	10,000	13,525	-
UK Treasury, Reg. S 1.75% 07/09/2022	GBP	470,000	642,673	0.09
UK Treasury, Reg. S 4.5% 07/09/2034	GBP	50,000	96,776	0.01
UK Treasury, Reg. S 3.25% 22/01/2044	GBP	50,000	92,142	0.01
			<u>4,080,885</u>	<u>0.58</u>
<i>United States of America</i>				
Abbott Laboratories 3.75% 30/11/2026	USD	57,000	62,288	0.01
AbbVie, Inc. 2.5% 14/05/2020	USD	20,000	20,031	-
AbbVie, Inc. 3.6% 14/05/2025	USD	20,000	21,109	-
AbbVie, Inc. 3.2% 14/05/2026	USD	300,000	310,557	0.04
Allergan Funding SCS 3% 12/03/2020	USD	260,000	260,199	0.04
Allergan Funding SCS 4.75% 15/03/2045	USD	24,000	26,108	-
Altria Group, Inc. 1% 15/02/2023	EUR	125,000	142,614	0.02
Altria Group, Inc. 4.4% 14/02/2026	USD	55,000	59,751	0.01
Altria Group, Inc. 2.2% 15/06/2027	EUR	375,000	445,676	0.06
Altria Group, Inc. 4.25% 09/08/2042	USD	40,000	40,005	0.01
Anheuser-Busch Cos. LLC 4.9% 01/02/2046	USD	260,000	307,962	0.04
AT&T, Inc. 3.4% 15/05/2025	USD	50,000	52,411	0.01
AT&T, Inc. 4.25% 01/03/2027	USD	100,000	109,806	0.02
Avangrid, Inc. 3.8% 01/06/2029	USD	300,000	318,190	0.04
Becton Dickinson and Co. 3.734% 15/12/2024	USD	180,000	190,776	0.03
Berkshire Hathaway Energy Co. 3.75% 15/11/2023	USD	60,000	63,570	0.01
Boeing Co. (The) 3.2% 01/03/2029	USD	193,000	201,177	0.03

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Boeing Co. (The) 2.95% 01/02/2030	USD	30,000	30,701	-
BP Capital Markets America, Inc. 4.234% 06/11/2028	USD	225,000	254,360	0.04
Cigna Corp. 3.4% 17/09/2021	USD	115,000	117,738	0.02
Cigna Corp. 4.125% 15/11/2025	USD	80,000	86,838	0.01
Cigna Corp. 4.375% 15/10/2028	USD	160,000	177,354	0.03
CMS Energy Corp. 3.45% 15/08/2027	USD	175,000	183,083	0.03
CMS Energy Corp. 3.6% 15/11/2025	USD	25,000	26,395	-
Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 4% 01/12/2028	USD	200,000	222,120	0.03
Duke Energy Corp. 3.75% 15/04/2024	USD	675,000	715,301	0.10
Duke Energy Florida LLC 2.5% 01/12/2029	USD	425,000	424,944	0.06
Enbridge Energy Partners LP 7.375% 15/10/2045	USD	43,000	64,145	0.01
Essex Portfolio LP, REIT 3.5% 01/04/2025	USD	30,000	31,490	-
FirstEnergy Corp. 3.9% 15/07/2027	USD	225,000	240,603	0.03
FirstEnergy Corp. 4.85% 15/07/2047	USD	30,000	35,633	-
General Motors Financial Co., Inc. 3.55% 08/07/2022	USD	140,000	144,126	0.02
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.2% 23/02/2023	USD	495,000	509,006	0.07
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 4.75% 21/10/2045	USD	30,000	36,568	0.01
Halliburton Co. 3.8% 15/11/2025	USD	10,000	10,673	-
Home Depot, Inc. (The) 4.5% 06/12/2048	USD	75,000	92,477	0.01
JPMorgan Chase & Co. 2.55% 01/03/2021	USD	50,000	50,388	0.01
Keurig Dr Pepper, Inc. 4.597% 25/05/2028	USD	400,000	449,399	0.06
Kroger Co. (The) 3.5% 01/02/2026	USD	50,000	52,707	0.01
Lowe's Cos., Inc. 4.55% 05/04/2049	USD	100,000	117,881	0.02
Medtronic, Inc. 3.5% 15/03/2025	USD	36,000	38,577	0.01
Morgan Stanley, FRN 0.637% 26/07/2024	EUR	250,000	284,858	0.04
Pacific Gas & Electric Co. 3.3% 01/12/2027§	USD	250,000	250,631	0.04
Pacific Gas & Electric Co. 3.85% 15/11/2023§	USD	20,000	20,258	-
Pfizer, Inc. 3.2% 15/09/2023	USD	550,000	573,659	0.08
Philip Morris International, Inc. 2.9% 15/11/2021	USD	40,000	40,712	0.01
Prologis LP, REIT 3.75% 01/11/2025	USD	25,000	27,063	-
Public Service Enterprise Group, Inc. 2% 15/11/2021	USD	80,000	79,953	0.01
Reynolds American, Inc. 4.45% 12/06/2025	USD	195,000	209,941	0.03
Reynolds American, Inc. 5.85% 15/08/2045	USD	20,000	22,929	-
Spectra Energy Partners LP 3.375% 15/10/2026	USD	28,000	28,986	-
Stryker Corp. 0.75% 01/03/2029	EUR	190,000	213,551	0.03
Union Pacific Corp. 3.7% 01/03/2029	USD	125,000	136,577	0.02
United Technologies Corp. 4.125% 16/11/2028	USD	265,000	298,515	0.04
US Bank NA 3.45% 16/11/2021	USD	400,000	411,903	0.06
US Treasury 2.375% 30/04/2020	USD	2,880,000	2,887,537	0.41
US Treasury 2.5% 31/05/2020	USD	752,000	754,702	0.11
US Treasury 2.5% 30/06/2020	USD	225,000	226,002	0.03
US Treasury 2.25% 30/04/2021	USD	850,000	857,282	0.12

† Security is currently in default.

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
US Treasury 2.125% 31/05/2021	USD	6,300,900	6,347,068	0.90
US Treasury 1.625% 30/06/2021	USD	751,000	751,319	0.11
US Treasury 1.5% 30/09/2021	USD	20,000	19,969	-
US Treasury 1.5% 30/11/2021	USD	1,050,000	1,048,550	0.15
US Treasury 2.375% 31/01/2023	USD	3,055,000	3,123,558	0.44
US Treasury 2.75% 31/05/2023	USD	752,000	779,571	0.11
US Treasury 2.625% 30/06/2023	USD	1,425,000	1,472,674	0.21
US Treasury 2.75% 31/07/2023	USD	1,420,000	1,474,914	0.21
US Treasury 2.625% 31/12/2023	USD	1,725,000	1,789,688	0.25
US Treasury 2.5% 31/01/2024	USD	11,115,000	11,483,618	1.62
US Treasury 2.25% 30/04/2024	USD	4,396,500	4,502,978	0.64
US Treasury 1.75% 30/06/2024	USD	320,000	321,050	0.05
US Treasury 1.75% 31/07/2024	USD	250,000	250,830	0.04
US Treasury 1.5% 30/09/2024	USD	1,100,000	1,090,934	0.15
US Treasury 1.5% 31/10/2024	USD	600,000	595,055	0.08
US Treasury 1.5% 30/11/2024	USD	800,000	793,594	0.11
US Treasury 1.625% 30/09/2026	USD	550,000	543,533	0.08
US Treasury 1.625% 31/10/2026	USD	430,000	424,709	0.06
US Treasury 2.875% 15/05/2028	USD	1,277,000	1,374,015	0.19
US Treasury 3.125% 15/11/2028	USD	2,100,000	2,311,066	0.33
US Treasury 2.625% 15/02/2029	USD	1,205,000	1,278,053	0.18
US Treasury 2.375% 15/05/2029	USD	8,710,000	9,053,010	1.28
US Treasury 1.625% 15/08/2029	USD	2,955,000	2,878,492	0.41
US Treasury 3% 15/08/2048	USD	780,000	878,669	0.12
US Treasury 2.875% 15/05/2049	USD	64,000	70,555	0.01
US Treasury 2.25% 15/08/2049	USD	7,000	6,792	-
US Treasury 1.75% 30/06/2022	USD	1,650,000	1,656,336	0.23
US Treasury 1.875% 30/09/2022	USD	5,100,000	5,137,117	0.73
US Treasury 1.375% 31/08/2023	USD	6,200,000	6,143,812	0.87
US Treasury 2.125% 31/03/2024	USD	2,125,000	2,164,844	0.31
US Treasury 2% 30/04/2024	USD	950,000	963,211	0.14
US Treasury 2% 30/06/2024	USD	950,000	963,322	0.14
US Treasury 2.125% 31/07/2024	USD	1,850,000	1,886,422	0.27
US Treasury 2.375% 15/05/2027	USD	2,750,000	2,853,125	0.40
US Treasury 3% 15/05/2047	USD	220,000	247,400	0.03
US Treasury Inflation Indexed 0.25% 15/07/2029	USD	1,200,000	1,220,559	0.17
US Treasury Inflation Indexed 0.5% 15/01/2028	USD	1,675,000	1,793,236	0.25
US Treasury Inflation Indexed 0.875% 15/01/2029	USD	4,910,000	5,316,625	0.75
US Treasury Inflation Indexed 1% 15/02/2049	USD	3,900,000	4,439,005	0.63
US Treasury Inflation Indexed 1.375% 15/02/2044	USD	65,000	84,811	0.01
US Treasury Inflation Indexed 1% 15/02/2046	USD	305,000	365,103	0.05
Virginia Electric & Power Co. 4.6% 01/12/2048	USD	250,000	305,976	0.04
Walmart, Inc. 2.85% 08/07/2024	USD	235,000	243,759	0.03
			104,518,723	14.76

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Uruguay</i>				
Uruguay Government Bond, Reg. S 9.875% 20/06/2022	UYU	6,700,000	174,802	0.02
			174,802	0.02
Total Bonds			195,650,540	27.63
Equities				
<i>Belgium</i>				
Anheuser-Busch InBev SA/NV	EUR	67,600	5,513,375	0.78
			5,513,375	0.78
<i>Brazil</i>				
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	BRL	270,000	2,884,108	0.41
Pagseguro Digital Ltd. 'A'	USD	140,000	4,782,400	0.68
Vale SA	BRL	99,000	1,311,731	0.18
			8,978,239	1.27
<i>Canada</i>				
Barrick Gold Corp.	CAD	53,000	984,452	0.14
Barrick Gold Corp.	GBP	61,280	1,140,784	0.16
Canadian Natural Resources Ltd.	CAD	129,200	4,178,815	0.59
Franco-Nevada Corp.	CAD	14,000	1,445,658	0.20
			7,749,709	1.09
<i>China</i>				
Alibaba Group Holding Ltd., ADR	USD	9,275	1,967,228	0.28
TravelSky Technology Ltd. 'H'	HKD	1,061,000	2,589,764	0.36
			4,556,992	0.64
<i>Denmark</i>				
Coloplast A/S 'B'	DKK	36,500	4,527,811	0.64
Orsted A/S, Reg. S	DKK	34,250	3,542,297	0.50
			8,070,108	1.14
<i>Finland</i>				
Nokian Renkaat OYJ	EUR	34,100	980,347	0.14
			980,347	0.14
<i>France</i>				
Airbus SE	EUR	44,100	6,454,450	0.91
Edenred	EUR	79,128	4,091,738	0.58
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	7,955	3,695,958	0.52
Peugeot SA	EUR	63,000	1,505,209	0.21
TOTAL SA	EUR	40,400	2,229,581	0.32
			17,976,936	2.54
<i>Germany</i>				
Carl Zeiss Meditec AG	EUR	15,700	2,002,335	0.28
MTU Aero Engines AG	EUR	14,000	3,998,188	0.57

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Rational AG	EUR	3,910	3,144,652	0.44
			9,145,175	1.29
<i>Hong Kong</i>				
AIA Group Ltd.	HKD	563,400	5,914,315	0.83
Budweiser Brewing Co. APAC Ltd., Reg. S	HKD	448,000	1,512,057	0.21
Wynn Macau Ltd.	HKD	534,000	1,315,761	0.19
			8,742,133	1.23
<i>India</i>				
HDFC Bank Ltd., ADR	USD	33,400	2,116,558	0.30
			2,116,558	0.30
<i>Indonesia</i>				
Bank Central Asia Tbk. PT	IDR	821,400	1,977,691	0.28
			1,977,691	0.28
<i>Italy</i>				
Ferrari NV	EUR	9,700	1,609,225	0.23
FinecoBank Banca Fineco SpA	EUR	169,460	2,031,990	0.28
			3,641,215	0.51
<i>Japan</i>				
Keyence Corp.	JPY	8,200	2,904,772	0.41
Murata Manufacturing Co. Ltd.	JPY	39,500	2,452,414	0.35
Nidec Corp.	JPY	15,100	2,085,274	0.29
Nintendo Co. Ltd.	JPY	8,700	3,520,675	0.50
SMC Corp.	JPY	8,500	3,934,149	0.56
Tokyo Electron Ltd.	JPY	18,100	3,985,482	0.56
			18,882,766	2.67
<i>Mexico</i>				
Coca-Cola Femsa SAB de CV	MXN	175,000	1,063,282	0.15
			1,063,282	0.15
<i>Netherlands</i>				
Akzo Nobel NV	EUR	29,000	2,948,456	0.41
ASML Holding NV	EUR	38,735	11,457,514	1.62
Coca-Cola European Partners plc	USD	45,000	2,289,600	0.32
Koninklijke DSM NV	EUR	18,500	2,409,243	0.34
Koninklijke Philips NV	EUR	30,000	1,464,492	0.21
			20,569,305	2.90
<i>New Zealand</i>				
Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd.	NZD	161,500	2,413,624	0.34
			2,413,624	0.34
<i>Norway</i>				
Atea ASA	NOK	100,000	1,464,809	0.21
			1,464,809	0.21

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Russian Federation</i>				
Sberbank of Russia PJSC, ADR	USD	446,550	7,341,282	1.04
			7,341,282	1.04
<i>Spain</i>				
International Consolidated Airlines Group SA	GBP	100,000	827,875	0.12
			827,875	0.12
<i>Switzerland</i>				
Givaudan SA	CHF	1,308	4,096,454	0.58
Nestle SA	CHF	110,800	11,995,892	1.69
Novartis AG	CHF	39,000	3,703,348	0.52
Temenos AG	CHF	16,000	2,532,754	0.36
Zurich Insurance Group AG	CHF	20,540	8,427,809	1.19
			30,756,257	4.34
<i>Taiwan</i>				
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	1,253,000	13,835,374	1.95
			13,835,374	1.95
<i>United Kingdom</i>				
AstraZeneca plc	GBP	136,000	13,703,676	1.93
BAE Systems plc	GBP	385,000	2,880,316	0.41
British American Tobacco plc, ADR	USD	2,280	96,809	0.01
British American Tobacco plc	GBP	145,400	6,223,767	0.88
Bunzl plc	GBP	48,000	1,312,943	0.19
Croda International plc	GBP	48,800	3,309,593	0.47
GlaxoSmithKline plc	GBP	194,300	4,578,608	0.65
Ocado Group plc	GBP	113,200	1,917,793	0.27
Rio Tinto plc	GBP	29,000	1,729,755	0.24
Royal Dutch Shell plc 'A'	GBP	33	977	-
Royal Dutch Shell plc 'B'	GBP	65,000	1,928,187	0.27
Spirax-Sarco Engineering plc	GBP	24,400	2,873,269	0.41
			40,555,693	5.73
<i>United States of America</i>				
Alphabet, Inc. 'C'	USD	4,900	6,551,398	0.93
Altria Group, Inc.	USD	119,000	5,939,290	0.84
Amazon.com, Inc.	USD	1,500	2,771,760	0.39
American Tower Corp., REIT	USD	14,465	3,324,346	0.47
Amphenol Corp. 'A'	USD	18,750	2,029,313	0.29
Berkshire Hathaway, Inc. 'A'	USD	22	7,470,980	1.06
BlackRock, Inc.	USD	7,840	3,941,168	0.56
Boeing Co. (The)	USD	15,750	5,130,720	0.72
Broadcom, Inc.	USD	39,150	12,372,183	1.75
Carnival Corp.	USD	30,000	1,524,900	0.22
Cigna Corp.	USD	9,250	1,891,533	0.27
Coca-Cola Co. (The)	USD	35,000	1,937,250	0.27

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
ConocoPhillips	USD	31,000	2,015,930	0.28
Crown Castle International Corp., REIT	USD	36,200	5,145,830	0.73
CSX Corp.	USD	28,500	2,062,260	0.29
Dow, Inc.	USD	22,333	1,222,285	0.17
DuPont de Nemours, Inc.	USD	18,000	1,155,600	0.16
Equinix, Inc., REIT	USD	5,565	3,248,291	0.46
Gaming and Leisure Properties, Inc., REIT	USD	55,000	2,367,750	0.33
General Motors Co.	USD	141,100	5,164,260	0.73
Gilead Sciences, Inc.	USD	25,000	1,624,500	0.23
Home Depot, Inc. (The)	USD	26,650	5,819,827	0.82
Humana, Inc.	USD	16,600	6,084,232	0.86
Intel Corp.	USD	45,000	2,693,250	0.38
JPMorgan Chase & Co.	USD	77,100	10,747,740	1.52
Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	86,000	2,489,700	0.35
Las Vegas Sands Corp.	USD	17,925	1,237,542	0.18
Linde plc	EUR	10,000	2,140,204	0.30
LyondellBasell Industries NV 'A'	USD	16,000	1,511,680	0.21
Mastercard, Inc. 'A'	USD	10,950	3,269,560	0.46
Merck & Co., Inc.	USD	139,700	12,705,715	1.79
Mettler-Toledo International, Inc.	USD	2,840	2,252,915	0.32
Microsoft Corp.	USD	96,075	15,151,027	2.14
Pfizer, Inc.	USD	60,050	2,352,759	0.33
Philip Morris International, Inc.	USD	58,300	4,960,747	0.70
Procter & Gamble Co. (The)	USD	12,000	1,498,800	0.21
S&P Global, Inc.	USD	11,775	3,215,164	0.45
Union Pacific Corp.	USD	5,800	1,048,582	0.15
United Parcel Service, Inc. 'B'	USD	13,000	1,521,780	0.22
UnitedHealth Group, Inc.	USD	26,820	7,884,544	1.11
Visa, Inc. 'A'	USD	11,300	2,123,270	0.30
Walgreens Boots Alliance, Inc.	USD	31,000	1,827,760	0.26
Watsco, Inc.	USD	13,215	2,380,682	0.34
Zoetis, Inc.	USD	9,250	1,224,237	0.17
			175,033,264	24.72
Total Equities			392,192,009	55.38
Total Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing			587,842,549	83.01
Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market				
Bonds				
<i>Canada</i>				
Canada Treasury Bill 0% 17/09/2020	CAD	1,400,000	1,065,177	0.15
Canada Treasury Bill 0% 15/10/2020	CAD	1,400,000	1,063,905	0.15

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Enbridge, Inc. 3.7% 15/07/2027	USD	28,000	29,649	-
			2,158,731	0.30
<i>Egypt</i>				
Egypt Treasury Bill 0% 07/04/2020	EGP	3,850,000	231,457	0.03
			231,457	0.03
<i>France</i>				
BPCE SA, 144A 5.15% 21/07/2024	USD	211,000	231,555	0.03
			231,555	0.03
<i>Germany</i>				
Daimler Finance North America LLC, 144A 3% 22/02/2021	USD	250,000	252,480	0.03
Daimler Finance North America LLC, 144A 2% 06/07/2021	USD	200,000	199,620	0.03
Deutsche Telekom International Finance BV, 144A 2.485% 19/09/2023	USD	175,000	176,239	0.02
EMD Finance LLC, Reg. S 3.25% 19/03/2025	USD	50,000	51,482	0.01
Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A 4.25% 13/11/2023	USD	375,000	399,585	0.06
			1,079,406	0.15
<i>Japan</i>				
American Honda Finance Corp. 3.5% 15/02/2028	USD	187,000	201,429	0.03
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2028	JPY	309,200,000	2,964,891	0.42
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2029	JPY	404,000,000	3,847,176	0.54
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/09/2024	JPY	27,000,000	257,266	0.04
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2027	JPY	15,000,000	144,778	0.02
Mizuho Financial Group, Inc., FRN 2.721% 16/07/2023	USD	347,000	351,134	0.05
Nissan Motor Acceptance Corp., 144A 2.6% 28/09/2022	USD	190,000	190,230	0.03
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 5% 26/11/2028	USD	200,000	232,896	0.03
			8,189,800	1.16
<i>Malaysia</i>				
Malaysia Government Bond 3.478% 14/06/2024	MYR	4,300,000	1,063,667	0.15
Malaysia Government Bond 3.906% 15/07/2026	MYR	3,775,000	955,498	0.14
Malaysia Government Bond 4.893% 08/06/2038	MYR	4,400,000	1,225,979	0.17
Malaysia Government Bond 3.659% 15/10/2020	MYR	27,000	6,640	-
Malaysia Government Bond 3.62% 30/11/2021	MYR	325,000	80,363	0.01
Malaysia Government Bond 3.9% 30/11/2026	MYR	2,300,000	581,731	0.08
			3,913,878	0.55
<i>Mexico</i>				
Mexico Government Bond 0.62% 05/07/2022	JPY	100,000,000	921,826	0.13
			921,826	0.13

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Netherlands</i>				
Enel Finance International NV, 144A 2.75% 06/04/2023	USD	200,000	201,439	0.03
Enel Finance International NV, 144A 3.5% 06/04/2028	USD	550,000	562,857	0.08
			<u>764,296</u>	<u>0.11</u>
<i>Nigeria</i>				
Nigeria Government Bond 0% 27/02/2020	NGN	72,000,000	195,505	0.03
			<u>195,505</u>	<u>0.03</u>
<i>South Korea</i>				
Hyundai Capital America, Reg. S 2.55% 03/04/2020	USD	40,000	40,018	0.01
KT Corp. 0.3% 13/11/2020	JPY	100,000,000	920,625	0.13
			<u>960,643</u>	<u>0.14</u>
<i>United Kingdom</i>				
Anglo American Capital plc, 144A 4% 11/09/2027	USD	200,000	209,523	0.03
Niagara Mohawk Power Corp., Reg. S 3.508% 01/10/2024	USD	5,000	5,258	-
UK Treasury Bill 0% 14/04/2020	GBP	630,000	832,721	0.12
			<u>1,047,502</u>	<u>0.15</u>
<i>United States of America</i>				
Bank of America Corp., FRN 3.55% 05/03/2024	USD	180,000	186,899	0.03
Bank of America Corp., FRN 3.458% 15/03/2025	USD	225,000	234,998	0.03
Bank of America Corp., FRN 3.419% 20/12/2028	USD	298,000	312,761	0.04
Charter Communications Operating LLC 4.908% 23/07/2025	USD	275,000	302,929	0.04
Comcast Corp. 3.95% 15/10/2025	USD	115,000	125,508	0.02
Exelon Corp. 3.497% 01/06/2022	USD	90,000	92,419	0.01
Exelon Corp. 3.4% 15/04/2026	USD	20,000	20,893	-
FHLMC Q52216 3.5% 01/11/2047	USD	51,707	53,784	0.01
FHLMC V84637 4% 01/09/2048	USD	544,695	568,254	0.08
General Mills, Inc. 3.2% 16/04/2021	USD	35,000	35,632	0.01
GNMA MA5764 4.5% 20/02/2049	USD	29,237	30,551	0.01
GNMA MA5877 4.5% 20/04/2049	USD	21,209	22,160	-
GNMA MA5987 4.5% 20/06/2049	USD	839,605	880,496	0.13
GNMA MA6041 4.5% 20/07/2049	USD	417,030	438,260	0.06
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN 2.905% 24/07/2023	USD	170,000	173,083	0.03
JPMorgan Chase & Co., FRN 4.005% 23/04/2029	USD	375,000	411,686	0.06
JPMorgan Chase & Co., FRN 3.54% 01/05/2028	USD	100,000	106,211	0.02
Microsoft Corp. 3.3% 06/02/2027	USD	310,000	331,353	0.05
Microsoft Corp. 2.4% 08/08/2026	USD	30,000	30,388	-
Microsoft Corp. 3.7% 08/08/2046	USD	20,000	22,584	-
President & Fellows of Harvard College 3.15% 15/07/2046	USD	40,000	40,946	0.01
UMBS BN1042 4.5% 01/09/2048	USD	146,536	154,323	0.02
UMBS BO2188 4% 01/09/2049	USD	89,851	93,685	0.01

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
UMBS CA4574 4% 01/08/2049	USD	309,512	322,717	0.05
UMBS FM1389 4.5% 01/06/2049	USD	187,688	197,250	0.03
UMBS FM1437 4% 01/09/2048	USD	284,115	296,219	0.04
UMBS MA3467 4% 01/09/2048	USD	486,655	507,026	0.07
UMBS MA3521 4% 01/11/2048	USD	76,977	80,091	0.01
UMBS MA3564 4.5% 01/01/2049	USD	51,879	54,574	0.01
UMBS MA3593 4.5% 01/02/2049	USD	159,788	168,118	0.02
UMBS MA3616 4.5% 01/03/2049	USD	162,262	170,746	0.02
UMBS MA3639 4.5% 01/04/2049	USD	88,931	93,535	0.01
UMBS MA3692 3.5% 01/07/2049	USD	702,499	721,940	0.10
UMBS MA3693 4% 01/07/2049	USD	1,249,046	1,298,861	0.18
UMBS MA3775 3.5% 01/09/2049	USD	1,253,849	1,289,446	0.18
UMBS MA3776 4% 01/09/2049	USD	677,125	706,741	0.10
UMBS MA3804 4% 01/10/2049	USD	93,120	97,248	0.01
UMBS SI2002 4% 01/03/2048	USD	466,792	489,593	0.07
UMBS ZT1545 4% 01/12/2048	USD	1,742,103	1,814,116	0.26
UMBS ZT1546 4.5% 01/12/2048	USD	182,868	192,435	0.03
US Treasury 1.75% 15/11/2029	USD	220,000	216,648	0.03
US Treasury Bill 0% 02/01/2020	USD	990,000	990,000	0.14
US Treasury Bill 0% 16/07/2020	USD	260,000	257,832	0.04
US Treasury Inflation Indexed 0.125% 15/10/2024	USD	2,740,000	2,765,801	0.39
			17,400,740	2.46
Total Bonds			37,095,339	5.24
Total Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market			37,095,339	5.24
Recently issued securities				
Bonds				
<i>Brazil</i>				
Braskem Netherlands Finance BV, 144A 4.5% 31/01/2030	USD	215,000	214,248	0.03
			214,248	0.03
<i>France</i>				
Vinci SA, 144A 3.75% 10/04/2029	USD	225,000	245,453	0.04
			245,453	0.04
<i>United States of America</i>				
BMW US Capital LLC, 144A 2.95% 14/04/2022	USD	225,000	229,295	0.03
BMW US Capital LLC, 144A 3.15% 18/04/2024	USD	105,000	108,598	0.02
Bristol-Myers Squibb Co., 144A 2.9% 26/07/2024	USD	225,000	232,284	0.03
			570,177	0.08
Total Bonds			1,029,878	0.15
Total Recently issued securities			1,029,878	0.15

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings				
Collective Investment Schemes - UCITS				
<i>Luxembourg</i>				
JPMorgan USD Treasury CNAV Fund - JPM USD				
Treasury CNAV Institutional (dist.)	USD	48,675,209	48,675,209	6.87
			48,675,209	6.87
Total Collective Investment Schemes - UCITS			48,675,209	6.87
Total Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings			48,675,209	6.87
Total Investments			674,642,975	95.27
Cash			26,390,964	3.73
Other assets/(liabilities)			7,112,422	1.00
Total net assets			708,146,361	100.00

To Be Announced Contracts

Country	Security Description	Currency	Nominal Value	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
United States of America	GNMA, 4.50%, 15/01/2050	USD	22,987	24,037	(47)	-
Total To Be Announced Contracts Long Positions				24,037	(47)	-
Net To Be Announced Contracts				24,037	(47)	-

Financial Futures Contracts

Security Description	Number of Contracts	Currency	Global Exposure USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
US 2 Year Note, 31/03/2020	77	USD	16,593,500	(8,464)	-
US 5 Year Note, 31/03/2020	3	USD	355,828	(1,587)	-
US Ultra Bond, 20/03/2020	2	USD	363,313	(10,378)	-
Total Unrealised Loss on Financial Futures Contracts				(20,429)	-
Net Unrealised Loss on Financial Futures Contracts				(20,429)	-

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Interest Rate Swap Contracts

Nominal Amount	Currency	Counterparty	Security Description	Maturity Date	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
246,000,000	HUF	Citigroup	Pay fixed 1.39% Receive floating BUBOR 6 month	11/11/2029	11,321	11,321	-
Total Unrealised Gain on Interest Rate Swap Contracts					11,321	11,321	-
5,900,000	EUR	Citigroup	Pay floating EURIBOR 6 month Receive fixed (0.122)%	25/07/2024	(17,984)	(17,984)	-
3,200,000	PLN	Citigroup	Pay fixed 1.9% Receive floating WIBOR 6 month	12/11/2029	(3,308)	(3,308)	-
3,325,000	PLN	Citigroup	Pay fixed 1.88% Receive floating WIBOR 6 month	20/11/2029	(1,823)	(1,823)	-
Total Unrealised Loss on Interest Rate Swap Contracts					(23,115)	(23,115)	-
Net Unrealised Loss on Interest Rate Swap Contracts					(11,794)	(11,794)	-

Forward Currency Exchange Contracts

Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
CZK	18,095,000	EUR	707,535	06/01/2020	HSBC	4,406	-
EUR	510,000	USD	567,394	06/01/2020	Bank of America	4,780	-
EUR	1,340,000	USD	1,488,999	06/01/2020	Standard Chartered	14,361	-
USD	1,807,718	JPY	196,000,000	07/01/2020	UBS	3,415	-
JPY	22,000,000	USD	201,441	08/01/2020	J.P. Morgan	1,095	-
GBP	510,000	USD	670,880	09/01/2020	Bank of America	4,784	-
RUB	16,000,000	USD	248,389	10/01/2020	Citibank	9,182	-
EUR	300,000	USD	334,695	13/01/2020	BNY Mellon	2,027	-
EUR	4,105,000	USD	4,556,373	13/01/2020	J.P. Morgan	51,111	0.01
ZAR	2,430,000	USD	165,288	13/01/2020	Citibank	7,982	-
KRW	332,900,000	USD	286,316	15/01/2020	Standard Chartered	1,632	-
CAD	370,000	USD	281,072	16/01/2020	J.P. Morgan	3,883	-
CZK	3,780,000	USD	165,220	16/01/2020	Citibank	1,523	-
EUR	1,985,000	USD	2,212,999	16/01/2020	Bank of America	15,413	-
GBP	2,398,000	USD	3,157,039	16/01/2020	UBS	20,569	0.01
ILS	4,600,000	USD	1,317,734	16/01/2020	Bank of America	15,144	-
PLN	640,000	USD	166,485	16/01/2020	Citibank	2,212	-
EUR	500,000	USD	555,060	17/01/2020	Bank of America	6,289	-
EUR	1,180,000	USD	1,316,834	17/01/2020	UBS	7,950	-
NOK	1,420,000	USD	157,411	17/01/2020	Standard Chartered	4,344	-
AUD	2,400,000	USD	1,655,040	21/01/2020	HSBC	29,942	0.01
MXN	3,000,000	USD	158,004	23/01/2020	BNY Mellon	174	-
USD	412,403	INR	29,300,000	23/01/2020	HSBC	2,755	-

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Forward Currency Exchange Contracts							
Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
NOK	1,750,000	USD	194,118	27/01/2020	Morgan Stanley	5,238	-
USD	463,025	INR	33,000,000	28/01/2020	Standard Chartered	1,899	-
Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts						222,110	0.03
EUR Hedged Share Class							
CHF	11,312	EUR	10,401	17/01/2020	J.P. Morgan	23	-
EUR	18,479,388	GBP	15,445,157	17/01/2020	J.P. Morgan	279,674	0.04
EUR	4,493,066	HKD	39,132,916	17/01/2020	J.P. Morgan	23,298	-
EUR	319,791	JPY	38,866,751	17/01/2020	J.P. Morgan	1,033	-
EUR	152,472,344	USD	170,333,475	17/01/2020	J.P. Morgan	846,959	0.12
GBP	14,055	EUR	16,476	17/01/2020	J.P. Morgan	128	-
HKD	10	EUR	1	17/01/2020	J.P. Morgan	-	-
JPY	256,490	EUR	2,097	17/01/2020	J.P. Morgan	8	-
JPY Hedged Share Class							
CHF	14,013	JPY	1,564,410	17/01/2020	J.P. Morgan	84	-
EUR	29,603	JPY	3,591,523	17/01/2020	J.P. Morgan	154	-
GBP	17,138	JPY	2,444,684	17/01/2020	J.P. Morgan	193	-
JPY	282,831	CHF	2,518	17/01/2020	J.P. Morgan	1	-
JPY	1,144,429,612	EUR	9,370,619	17/01/2020	J.P. Morgan	20,799	0.01
JPY	579,889,942	GBP	3,969,356	17/01/2020	J.P. Morgan	81,303	0.01
JPY	136,974,476	HKD	9,770,486	17/01/2020	J.P. Morgan	8,022	-
JPY	4,648,232,074	USD	42,535,819	17/01/2020	J.P. Morgan	278,377	0.04
Unrealised Gain on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts						1,540,056	0.22
Total Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts						1,762,166	0.25
USD	1,170,841	MXN	23,000,000	06/01/2020	J.P. Morgan	(45,120)	(0.01)
USD	125,112	ZAR	1,850,000	06/01/2020	Citibank	(6,924)	-
JPY	71,200,000	USD	656,365	07/01/2020	J.P. Morgan	(924)	-
JPY	176,340,000	USD	1,629,299	07/01/2020	Standard Chartered	(5,979)	-
JPY	69,092,000	USD	636,844	08/01/2020	Citibank	(771)	-
USD	397,425	CNH	2,800,000	08/01/2020	BNY Mellon	(4,778)	-
USD	997,676	CNH	7,040,000	08/01/2020	HSBC	(13,577)	-
USD	1,551,633	BRL	6,550,000	09/01/2020	J.P. Morgan	(76,211)	(0.01)
INR	11,600,000	USD	162,864	10/01/2020	J.P. Morgan	(452)	-
USD	379,188	INR	27,300,000	10/01/2020	J.P. Morgan	(3,041)	-
USD	399,518	THB	12,110,000	13/01/2020	Standard Chartered	(4,876)	-
USD	301,934	ZAR	4,425,000	13/01/2020	Morgan Stanley	(13,589)	-
GBP	1,165,000	EUR	1,378,853	15/01/2020	Bank of America	(4,132)	-
EUR	2,253,755	NOK	22,840,000	16/01/2020	UBS	(71,624)	(0.01)
GBP	616,710	USD	824,957	16/01/2020	Bank of America	(7,750)	-
USD	280,904	CAD	370,000	16/01/2020	J.P. Morgan	(4,051)	-
USD	1,324,468	ILS	4,600,000	16/01/2020	UBS	(8,411)	-
USD	165,624	THB	5,000,000	16/01/2020	HSBC	(1,355)	-

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Forward Currency Exchange Contracts							
Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
USD	557,111	CNH	3,900,000	17/01/2020	Standard Chartered	(2,997)	-
USD	336,509	EUR	300,000	17/01/2020	Standard Chartered	(301)	-
USD	663,633	MXN	12,600,000	21/01/2020	UBS	(934)	-
USD	479,197	MXN	9,100,000	23/01/2020	UBS	(609)	-
Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts						(278,406)	(0.03)
EUR Hedged Share Class							
EUR	12,009,769	CHF	13,147,526	17/01/2020	J.P. Morgan	(115,409)	(0.02)
EUR	556,997	GBP	475,858	17/01/2020	J.P. Morgan	(5,242)	-
EUR	19,522,658	JPY	2,384,299,069	17/01/2020	J.P. Morgan	(43,381)	(0.01)
GBP	10	EUR	12	17/01/2020	J.P. Morgan	-	-
HKD	33,691	EUR	3,888	17/01/2020	J.P. Morgan	(42)	-
JPY	1,830,757	EUR	15,090	17/01/2020	J.P. Morgan	(79)	-
USD	146,729	EUR	132,089	17/01/2020	J.P. Morgan	(1,566)	-
JPY Hedged Share Class							
EUR	10,635	JPY	1,298,472	17/01/2020	J.P. Morgan	(20)	-
GBP	240	JPY	35,024	17/01/2020	J.P. Morgan	(5)	-
HKD	41,769	JPY	585,273	17/01/2020	J.P. Morgan	(32)	-
JPY	365,843,842	CHF	3,281,776	17/01/2020	J.P. Morgan	(24,673)	(0.01)
JPY	448,308	GBP	3,134	17/01/2020	J.P. Morgan	(24)	-
USD	181,766	JPY	19,861,281	17/01/2020	J.P. Morgan	(1,173)	-
Unrealised Loss on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts						(191,646)	(0.04)
Total Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts						(470,052)	(0.07)
Net Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts						1,292,114	0.18

The accompanying notes form an integral part of these financial statements.

キャピタル・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

2019年12月31日現在

(USD)

債券および転換社債に係る利息（源泉徴収税額控除後）	5,014,715
受取配当金（源泉徴収税額控除後）	6,634,767
銀行預金利息	300,793
スワップ取引	78
収益小計	11,950,353
費用	
運用報酬	4,326,298
管理手数料	440,733
専門家サービス	211,581
年次税	169,866
デポジタリ・カストディ費用およびファンド管理手数料	103,854
印刷費用	47,625
その他費用	30,765
当座貸越利息*	
スワップ取引	1,549
費用小計	5,332,271
費用の払戻し	280,857
投資純利益 / (損失) (a)	6,898,939
実現純利益 / (損失)	
投資有価証券の売却取引	(1,184,402)
金融先物取引	379,984
スワップ取引	46,850
為替取引	(7,534,687)
当期実現純利益 / (損失) (b)	(8,292,255)
未実現評価利益 / (損失)の増減	
投資有価証券	79,253,317
スワップ取引	(11,794)
金融先物取引	(52,187)
為替取引	(848,086)
当期末実現評価利益 / (損失)の増減 (c)	78,341,250
当期損益 (a+b+c)	76,947,934
配当金の分配	(232,611)
当期投資証券の差引増減額	258,973,480
期首純資産総額	372,457,558
期末純資産総額	708,146,361

*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。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

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。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2019年7月23日から2020年1月22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)

(2020年1月22日現在)

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額	
						単価 (円)	評価金額(円)
日本	第29回フランス相互信用 連合銀行(BFCM)円 貨社債(2019)	0.25	2024/10/10	社債券	100,000	99.829	99,829,000
日本	第2回マラヤン・バンキ ング・ベルハッド円貨社 債(2015)	0.509	2020/4/30	社債券	100,000	100.08	100,080,000
日本	第1回バンコ・サンタン デール・エセ・アー 円 貨社債(2019)	0.463	2024/12/5	社債券	100,000	99.766	99,766,000
日本	第17回シティグループ・ インク 円貨社債 (2005)	2.04	2020/9/16	社債券	100,000	101.21	101,210,000
日本	第19回ルノー円貨社債 (2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	99.859	99,859,000
日本	第8回ケーティー円貨社 債(2018)	0.3	2020/11/13	社債券	100,000	99.957	99,957,000
日本	第1回明治安田生命2019 基金特定目的会社特定社 債(一般担保付)	0.29	2024/8/2	社債券	100,000	99.857	99,857,000
日本	第22回あおぞら銀行(社 債間限定同順位特約付)	0.1	2021/12/10	社債券	100,000	99.941	99,941,000
日本	第28回三菱東京UFJ銀 行(劣後特約付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	101.45	101,450,000
日本	第23回三井住友銀行(劣 後特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	101.348	101,348,000
日本	第19回みずほ銀行(劣後 特約付)	1.67	2022/2/24	社債券	100,000	103.207	103,207,000
日本	第22回芙蓉総合リース (社債間限定同順位特約 付)	0.04	2022/10/28	社債券	100,000	99.648	99,648,000
日本	第5回イオンファイナン シャルサービス(社債間 限定同順位特約付)	0.23	2022/5/27	社債券	100,000	99.949	99,949,000
日本	第75回アコム(特定社債 間限定同順位特約付)	0.309	2023/2/28	社債券	100,000	100.049	100,049,000
日本	第74回三菱UFJリース (社債間限定同順位特約 付)	0.09	2023/1/23	社債券	100,000	99.931	99,931,000

日本	第2回野村ホールディングス（担保提供制限等財務上特約無）	0.29	2024/9/3	社債券	100,000	99.628	99,628,000
日本	第29回相鉄ホールディングス（相模鉄道株式会社保証付）	0.91	2020/6/25	社債券	100,000	100.333	100,333,000
合 計					1,700,000		1,706,042,000

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）

2020年6月30日現在

資産総額	7,551,226,347円
負債総額	38,448,285円
純資産総額（ - ）	7,512,778,062円
発行済口数	6,019,584,159口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2481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）

2020年6月30日現在

資産総額	7,513,281,319円
負債総額	8,400,000円
純資産総額（ - ）	7,504,881,319円
発行済口数	5,711,829,550口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3139円

（参考）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

2020年1月22日現在

資産総額	158,005,759円
負債総額	114,917円
純資産総額（ - ）	157,890,842円
発行済口数	149,752,007口

1口当たり純資産額（ / ）	1.0543円
----------------	---------

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

- (1) 資本金の額（2019年12月30日現在）
 (2) 会社の機構（2019年12月30日現在）
- （中略）
 （以下略）

<訂正後>

- (1) 資本金の額（2020年6月30日現在）
 (2) 会社の機構（2020年6月30日現在）
- （中略）
 （以下略）

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業および第二種金融商品取引業の登録を受けています。

委託会社の運用する証券投資信託は2019年12月30日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	29	370,565
合計	29	370,565

<訂正後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業および第二種金融商品取引業の登録を受けています。

委託会社の運用する証券投資信託は2020年6月30日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	29	339,825
合計	29	339,825

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、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。

なお、当事業年度（自2018年7月1日 至2019年6月30日）の財務諸表に含まれる比較情報のうち、改正府令による改正後の財務諸表等規則第8条の12第2項第2号及び同条第3項に係るものについては、改正府令附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

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2018年7月1日 至2019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2018年7月1日 至2019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2019年7月1日 至2019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

(2019年12月31日現在)

科目	注記 番号	内訳 (千円)	金額 (千円)
(資産の部)			

.流動資産			
1.現金・預金			3,468,910
2.前払費用			44,353
3.未収入金			534,682
4.未収委託者報酬			1,080,582
5.未収運用受託報酬			571,016
6.立替金			3,448
流動資産計			5,702,994
.固定資産			
1.有形固定資産			106,585
建物	*1	4,674	
器具備品	*1	101,911	
2.無形固定資産			902
ソフトウェア		902	
3.投資その他の資産			519,920
(1)投資有価証券		100	
(2)保険積立金		12,187	
(3)長期差入保証金		274,500	
(4)繰延税金資産		233,133	
固定資産計			627,409
資産合計			6,330,403
(負債の部)			
.流動負債			
1.預り金			17,551
2.未払金			1,057,456
(1)未払手数料		647,989	
(2)その他未払金		409,467	
3.未払費用			101,553
4.未払法人税等			74,115
5.未払消費税等	*2		27,708
6.賞与引当金			308,878
7.役員賞与引当金			10,304
流動負債計			1,597,568
.固定負債			
1.退職給付引当金			1,427,737
2.資産除去債務			252,461
固定負債計			1,680,199
負債合計			3,277,767
(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			2,019,899
その他利益剰余金		2,019,899	
繰越利益剰余金		2,019,899	
株主資本計			3,052,636
純資産合計			3,052,636
負債・純資産合計			6,330,403

(2) 中間損益計算書

当中間会計期間

(自 2019年 7月 1日 至 2019年 12月31日)

科 目	注記 番号	内訳 (千円)	金額 (千円)
. 営業収益			
1. 委託者報酬			1,832,430
2. 運用受託報酬			678,412
3. その他営業収益	*2		2,549,673
営業収益計			5,060,516
. 営業費用			
1. 支払手数料	*2		3,194,260
2. 広告宣伝費			55,090
3. 調査費			133,731
4. 営業雑経費			22,923
(1) 通信費		8,731	
(2) 印刷費		6,283	
(3) 協会費		7,908	
営業費用計			3,406,005
. 一般管理費			
1. 給料			853,706
(1) 役員報酬		67,568	
(2) 給料・手当		493,522	
(3) 賞与		99,036	
(4) 賞与引当金繰入額		183,274	
(5) 役員賞与引当金繰入額		10,304	
2. 交際費			11,849
3. 寄付金			1,795
4. 旅費交通費			64,691
5. 租税公課			19,191
6. 不動産賃借料			178,414
7. 退職給付費用			83,412
8. 固定資産減価償却費	*1		11,691
9. 器具備品賃借料			2,051
10. 消耗品費			9,779
11. 事務委託費			22,871
12. 採用費			20,390
13. 福利厚生費			104,817
14. 共通発生経費負担額	*3		53,174
15. 諸経費			3,654
一般管理費計			1,441,494
営業利益			213,016
. 営業外収益			
1. 受取利息及び配当金			4,399
営業外収益計			4,399
. 営業外費用			
1. 為替差損			1,387
2. 固定資産除却損			433
営業外費用計			1,821
経常利益			215,594

税引前中間純利益			215,594
法人税、住民税及び事業税			56,924
法人税等調整額			30,454
中間純利益			189,124

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自2019年7月1日 至2019年12月31日)

(単位:千円)

	株主資本					株主資本 合計	純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	450,000	582,736	582,736	1,830,775	1,830,775	2,863,511	2,863,511
当中間期変動額							
中間純利益				189,124	189,124	189,124	189,124
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計	-	-	-	189,124	189,124	189,124	189,124
当中間期末残高	450,000	582,736	582,736	2,019,899	2,019,899	3,052,636	3,052,636

[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、建物15年、器具備品3~15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。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間 (2019年12月31日現在)	
*1.有形固定資産の減価償却累計額	60,860千円
*2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。

(中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自2019年7月1日 至2019年12月31日)

*1. 減価償却実施額

有形固定資産	11,235千円
無形固定資産	456千円

*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・マネジメント・カンパニー（以下「CRMC社」という。）との役務提供契約に基づき、当社の最終の親会社であるキャピタル・グループ・カンパニーズ・インクの各グループ会社（以下「各グループ会社」という。）との間で各種投資運用サービスを相互に提供しております。

当社の主要な事業は、当社が各グループ会社に対して提供している各種投資運用サービス（市場調査業務、投資運用関連業務、マーケティング業務、顧客リレーションサポート業務など）であり、当該サービスに係る対価は、営業費用及び一般管理費の合計額から一定の支払手数料を差引いた金額を基準に一定の利益率を加味して算定し、その他営業収益に計上しております。

当社が各グループ会社から提供を受けている各種投資運用サービスは、市場調査業務、投資運用関連業務、ITサービスなどであり、当該サービスに係る対価は、当社の委託者報酬及び運用受託報酬を基準に算定し、支払手数料に含めて計上しております。

*3. 共通発生経費負担額は、各グループ会社の利益規模に応じて負担しております。

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間

(自2019年7月1日 至2019年12月31日)

発行済株式の種類及び総数

株式の種類	当事業年度期首(株)	増加(株)	減少(株)	当中間会計期間末(株)
普通株式	56,400	-	-	56,400

[リース取引関係]

当中間会計期間

(自2019年7月1日 至2019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	934,378	千円
合計	1,264,158	千円

[金融商品関係]

当中間会計期間

(自2019年7月1日 至2019年12月31日)

1. 金融商品の時価等に関する事項

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価(千円)	差額(千円)
長期差入保証金	274,500	276,465	1,965

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、2019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
(2019年12月31日現在)

(その他有価証券)

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
その他有価証券 (証券投資信託)	100	100	-

[デリバティブ取引関係]

当中間会計期間
(自2019年7月1日 至2019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 (2019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	250,662千円
時の経過による調整額	1,799千円
当中間会計期間末残高	252,461千円

[セグメント情報等]

当中間会計期間 (自2019年7月1日 至2019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
2,449,777千円	2,549,673千円	61,065千円	5,060,516千円
(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	2,549,673千円		

[1株当たり情報]

当中間会計期間 (自2019年7月1日 至2019年12月31日)

1株当たり純資産額	54,124.75円
1株当たり中間純利益金額	3,353.26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おりません。

(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	189,124千円
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	189,124千円
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(2019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(2019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(2019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(2020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(2020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(2020年3月31日現在)

(以下略)

独立監査人の中間監査報告書

2020年7月14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2019年11月21日から2020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2020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（2019年11月21日から2020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

2020年3月23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 水野 龍也 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、「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2019年7月1日から2020年6月30日までの第36期事業年度の中間会計期間（2019年7月1日から2019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2019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（2019年7月1日から2019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。