

## 【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】	2021年8月13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(2021年2月19日から2022年2月17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、2021年2月18日付けをもって提出した有価証券届出書（2021年6月30日付けをもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。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（2020年12月30日現在）  
（以下略）

< 訂正後 >

（前略）  
委託会社の概況（2021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、2020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、2020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、2021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、2021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(2020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2020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(2021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2021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2020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)

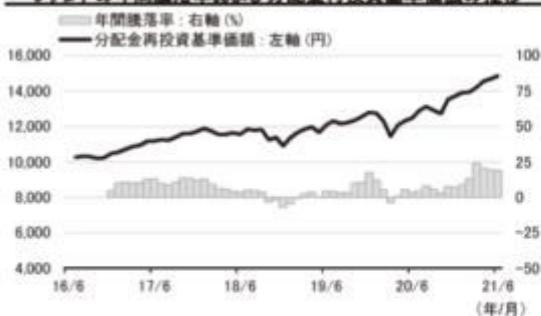
上記は2021年6月30日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

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2021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円とした基準価額です。  
 (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た基準価額であり、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。

## 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、2020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、2021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）

2021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	17,453,398,787	98.23
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		314,460,957	1.76
合計（純資産総額）		17,767,859,744	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）

2021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	4,824,787	0.02
投資証券	ルクセンブルク	17,424,868,636	99.83
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		23,966,826	0.13
合計（純資産総額）		17,453,660,249	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）

2021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	51,107,211,060	30.25
	英国	8,266,746,293	4.89
	日本	6,094,781,201	3.61
	スイス	5,588,092,198	3.31
	台湾	5,127,472,559	3.03
	オランダ	4,164,106,497	2.46
	ブラジル	3,573,490,092	2.12

株式	フランス	3,567,836,596	2.11
	香港	3,323,045,270	1.97
	カナダ	2,872,198,380	1.70
	中国	2,165,528,837	1.28
	イタリア	2,103,017,198	1.24
	ドイツ	1,944,324,602	1.15
	スペイン	1,279,181,728	0.76
	デンマーク	865,856,707	0.51
	韓国	628,266,451	0.37
	ニュージーランド	602,655,878	0.36
	メキシコ	236,491,406	0.14
債券	米国	22,873,211,242	13.54
	日本	5,662,302,613	3.35
	中国	4,332,645,910	2.56
	ドイツ	2,174,959,047	1.29
	英国	2,051,992,185	1.21
	カナダ	1,274,403,573	0.75
	フランス	1,222,414,704	0.72
	デンマーク	1,206,213,050	0.71
	メキシコ	1,094,834,106	0.65
	ルーマニア	1,058,235,156	0.63
	イタリア	1,003,251,753	0.59
	ロシア	848,706,874	0.50
	マレーシア	829,819,195	0.49
	オーストラリア	649,062,499	0.38
	ギリシャ	542,986,899	0.32
	ブラジル	402,824,477	0.24
	セルビア	340,003,735	0.20
	韓国	335,843,162	0.20
	フィリピン	321,935,700	0.19
	インドネシア	307,719,362	0.18
	エジプト	302,772,663	0.18
	サウジアラビア	290,872,919	0.17
	スペイン	263,484,708	0.16
	オランダ	253,535,129	0.15
	チェコ共和国	240,283,055	0.14
	インド	211,499,394	0.13
	ノルウェー	175,297,896	0.10
	コロンビア	167,947,134	0.10
	モロッコ	167,523,533	0.10
	イスラエル	146,049,158	0.09
	ウクライナ	144,308,297	0.09
	スリランカ	68,772,808	0.04
	アイルランド	65,753,072	0.04
ベルギー	65,665,872	0.04	
チュニジア	64,816,425	0.04	
カタール	51,922,412	0.03	
アラブ首長国連邦	48,795,735	0.03	
ポーランド	35,675,680	0.02	
スイス	27,842,653	0.02	
ペルー	25,111,513	0.01	
パラグアイ	23,358,380	0.01	
国際機関	23,244,291	0.01	
ポルトガル	15,698,178	0.01	
銀行預金、その他資産（負債控除後）	14,032,938,102	8.31	
純資産総額	168,956,837,200	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

2021年1月22日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	60,009,480	3.33
特殊債券	日本	100,031,000	5.55
社債券	日本	1,501,195,000	83.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		140,705,508	7.81
合計(純資産総額)		1,801,940,988	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(2021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

2021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)	11,061,156,466	1.4458	15,992,553,777	1.5779	17,453,398,787	98.23

(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

2021年6月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.23
合計	98.23

## (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

2021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）	6,272,450.913	2,546.13	15,970,501,004	2,778	17,424,868,636	99.83
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	1.0531	4,822,955	1.0535	4,824,787	0.02

(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

2021年6月30日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	0.02
投資証券	99.83
合計	99.86

#### (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

2021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	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	- -	台湾 株式 情報技術	2,175,000	595.00 台湾ドル	5,127,472,559	3.03
2	MICROSOFT CORP	- -	米国 株式 情報技術	144,486	271.40 米ドル	4,334,856,402	2.57
3	US TREASURY BOND 0.875% 11-15-30	0.875 2030/11/15	米国 債券 国債証券	40,148,600	94.9533 米ドル	4,214,242,764	2.49
4	HOME DEPOT INC	- -	米国 株式 一般消費 財・サー ビス	101,331	318.24 米ドル	3,564,808,448	2.11
5	NESTLE SA	- -	スイス 株式 生活必需 品	238,695	116.30 スイス・フラン	3,332,704,670	1.97
6	US TREASURY NOTE 0.375% 11-30-25	0.375 2025/11/30	米国 債券 国債証券	29,502,100	98.1965 米ドル	3,202,492,740	1.90
7	BROADCOM INC	- -	米国 株式 情報技術	58,897	477.15 米ドル	3,106,613,364	1.84
8	JPMORGAN CHASE & CO	- -	米国 株式 金融	168,234	154.14 米ドル	2,866,607,479	1.70
9	ASML HOLDING NV	- -	オランダ 株式 情報技術	34,755	589.90 ユーロ	2,697,231,670	1.60

10	US TREASURY NOTE 0.125% 11-30-22	0.125 2022/11/30	米国 債券 国債証券	22,993,900	99.9551 米ドル	2,540,718,745	1.50
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL A	- -	米国 株式 金融	48	417,000.00 米ドル	2,212,668,720	1.31
12	ASTRAZENECA PLC (GBP)	- -	英国 株式 ヘルスケア	164,841	86.74 英ポンド	2,189,298,065	1.30
13	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	- -	米国 株式 生活必需品	201,740	97.94 米ドル	2,184,194,053	1.29
14	UNITEDHEALTH GROUP INC	- -	米国 株式 ヘルスケア	45,896	398.10 米ドル	2,019,789,539	1.20
15	US TREASURY BOND 1.375% 08-15-50	1.375 2050/8/15	米国 債券 国債証券	20,807,300	83.9302 米ドル	1,930,514,602	1.14
16	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	- -	フランス 株式 一般消費 財・サー ビス	20,628	674.00 ユーロ	1,829,108,974	1.08
17	PAGSEGURO DIGITAL LTD CL A	- -	ブラジル 株式 情報技術	277,975	56.36 米ドル	1,731,872,146	1.03
18	PFIZER INC	- -	米国 株式 ヘルスケア	387,561	39.10 米ドル	1,675,158,592	0.99
19	TOKYO ELECTRON LTD	- -	日本 株式 情報技術	34,700	48,070.00 日本円	1,668,029,000	0.99
20	DOMINO'S PIZZA INC	- -	米国 株式 一般消費 財・サー ビス	28,210	463.45 米ドル	1,445,256,984	0.86
21	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	- -	香港 株式 資本財・ サービス	3,110,000	30.80 香港ドル	1,364,002,069	0.81
22	ALPHABET INC CL C	- -	米国 株式 コミュニ ケーション・サー ビス	4,832	2,520.37 米ドル	1,346,264,306	0.80
23	US TREASURY NOTE 2.5% 01-31-24	2.5 2024/1/31	米国 債券 国債証券	11,115,000	105.5149 米ドル	1,296,469,798	0.77
24	DANAHER CORP	- -	米国 株式 ヘルスケア	42,467	270.87 米ドル	1,271,603,147	0.75
25	ENEL SPA	- -	イタリア 株式 公益事業	1,193,965	8.038 ユーロ	1,262,589,459	0.75

26	HUMANA INC	- -	米国 株式 ヘルスケア	25,339	442.29 米ドル	1,238,898,411	0.73
27	ALTRIA GROUP INC	- -	米国 株式 生活必需品	237,933	46.78 米ドル	1,230,421,757	0.73
28	KWEICHOW MOUTAI CO LTD A (SSE NORTH)	- -	中国 株式 生活必需品	34,801	2,062.00 中国元	1,228,414,646	0.73
29	SOFTBANK CORP	- -	日本 株式 コミュニケーション・サービス	834,700	1,455.00 日本円	1,214,488,500	0.72
30	CROWN CASTLE INTL CORP	- -	米国 株式 不動産	53,443	197.35 米ドル	1,165,915,467	0.69

(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

2021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958回国庫短期債券	0	2021/3/22	国債証券	60,000	100.0158	60,009,480	3.33
日本	第48回韓国産業銀行 円貨債券(2018)	0.23	2021/9/3	特殊債券	100,000	100.031	100,031,000	5.55
日本	第6回マラヤン・バン キング・ベルハッド 円貨社債(2020)	0.224	2023/2/13	社債券	100,000	99.765	99,765,000	5.54
日本	第14回アサヒグループ ホールディングス (特定社債間限定同 順位特約付)(グ リーンボンド)	0.12	2025/10/15	社債券	100,000	100.113	100,113,000	5.56
日本	第14回セブン&ア イ・ホールディング ス(社債間限定同 順位特約付)	0.19	2025/12/19	社債券	100,000	100.336	100,336,000	5.57
日本	第15回Zホールディ ングス(社債間限定 同順位特約付)	0.35	2023/6/9	社債券	100,000	99.945	99,945,000	5.55
日本	第18回日立製作所 (社債間限定同順位 特約付)	0.06	2023/3/10	社債券	100,000	99.871	99,871,000	5.54

日本	第46回IHI（社債間限定同順位特約付）	0.22	2023/9/1	社債券	100,000	100.015	100,015,000	5.55
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	100.015	100,015,000	5.55
日本	第37回丸井グループ（社債間限定同順位特約付）	0.12	2023/12/1	社債券	100,000	99.802	99,802,000	5.54
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	101.542	101,542,000	5.64
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	99.838	99,838,000	5.54
日本	第16回東京センチュリーリース（社債間限定同順位特約付）	0.2	2021/4/14	社債券	100,000	100.024	100,024,000	5.55
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	99.991	99,991,000	5.55
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	100.055	100,055,000	5.55
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	99.955	99,955,000	5.55
日本	第5回ソフトバンク（社債間限定同順位特約付）	0.1	2023/7/28	社債券	100,000	99.928	99,928,000	5.55

（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（2021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
第5期 (2020年11月20日)	11,044,502,013	11,044,502,013	1.3391	1.3391
2020年 6月末日	7,512,778,062		1.2481	
7月末日	11,036,338,012		1.2901	
8月末日	11,010,673,706		1.3127	
9月末日	10,768,411,741		1.2920	
10月末日	10,475,579,676		1.2740	
11月末日	11,084,190,777		1.3532	
12月末日	11,713,181,873		1.3732	
2021年 1月末日	12,390,582,929		1.3916	
2月末日	12,861,198,204		1.3950	
3月末日	14,276,820,324		1.4215	
4月末日	14,896,334,256		1.4561	
5月末日	15,472,911,597		1.4700	
6月末日	17,767,859,744		1.4866	

(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

第5期	2019年11月21日～2020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期	2019年11月21日～2020年11月20日	7.1
第6中間計算期間末	2020年11月21日～2021年 5月20日	7.8

(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期	2019年11月21日～2020年11月20日	3,507,142,815	1,919,973,800	8,247,933,135
第6中間計算期間末	2020年11月21日～2021年 5月20日	2,929,258,363	852,011,897	10,325,179,601

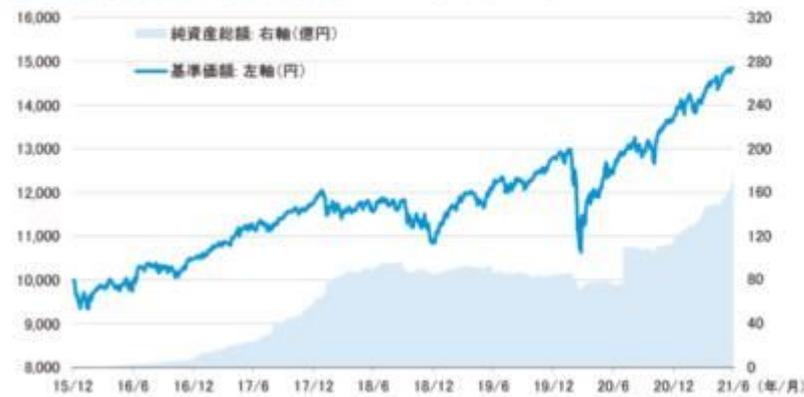
(注)第1期の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(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

2021年6月30日現在

## 基準価額・純資産の推移(設定～2021年6月30日)



## 分配金の推移

期	年月	金額
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
第5期	2020年11月	0円
	設定来累計	0円

分配金は1万円当たり、税引前

## 主要な資産の状況(2021年6月30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Ch-JPY)	99.83
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.02

&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;

(2021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	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	台湾	株式	情報技術	3.03
2	MICROSOFT CORP	米国	株式	情報技術	2.57
3	US TREASURY BOND 0.875% 11-15-30	米国	債券	国債証券	2.49
4	HOME DEPOT INC	米国	株式	一般消費財・サービス	2.11
5	NESTLE SA	スイス	株式	生活必需品	1.97
6	US TREASURY NOTE 0.375% 11-30-25	米国	債券	国債証券	1.90
7	BROADCOM INC	米国	株式	情報技術	1.84
8	JPMORGAN CHASE & CO	米国	株式	金融	1.70
9	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	1.60
10	US TREASURY NOTE 0.125% 11-30-22	米国	債券	国債証券	1.50

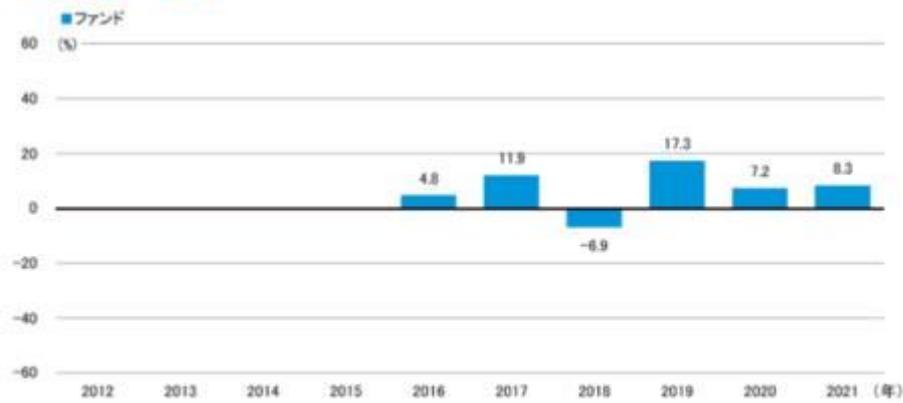
## 資産別構成比率

資産	証券種別	投資比率(%)
株式		61.26
債券		30.43
	国債証券	25.13
	社債券	4.53
	その他証券	0.77
現金・その他		8.31

## 国別構成比率

国名	投資比率(%)		
	株式	債券	合計
米国	30.25	13.54	43.79
日本	3.61	3.35	6.96
英国	4.89	1.21	6.11
中国	1.28	2.56	3.85
スイス	3.31	0.02	3.32
その他国	17.93	9.75	27.67
現金・その他			8.31

## 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。

2021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6期中間計算期間（2020年11月21日から2021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5期 2020年11月20日現在	第6期中間計算期間 2021年5月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	85,040,304	89,206,438
親投資信託受益証券	11,001,760,317	14,874,510,643
未収入金	3,000,000	-
流動資産合計	11,089,800,621	14,963,717,081
資産合計	11,089,800,621	14,963,717,081
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	8,171,424	6,748,997
未払受託者報酬	1,065,883	1,415,808
未払委託者報酬	35,173,948	46,721,218
未払利息	244	244
その他未払費用	887,109	884,547
流動負債合計	45,298,608	55,770,814
負債合計	45,298,608	55,770,814
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	8,247,933,135	10,325,179,601
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,796,568,878	4,582,766,666
元本等合計	11,044,502,013	14,907,946,267
純資産合計	11,044,502,013	14,907,946,267
負債純資産合計	11,089,800,621	14,963,717,081

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	第5期中間計算期間 自 2019年11月21日 至 2020年5月20日	第6期中間計算期間 自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	280,539,348	1,002,750,326
<b>営業収益合計</b>	<b>280,539,348</b>	<b>1,002,750,326</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	14,049	61,767
受託者報酬	884,341	1,415,808
委託者報酬	29,183,273	46,721,218
その他費用	877,952	884,547
<b>営業費用合計</b>	<b>30,959,615</b>	<b>49,083,340</b>
営業利益又は営業損失（ ）	311,498,963	953,666,986
経常利益又は経常損失（ ）	311,498,963	953,666,986
中間純利益又は中間純損失（ ）	311,498,963	953,666,986
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（ ）	17,265,776	44,464,141
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,669,460,645	2,796,568,878
剰余金増加額又は欠損金減少額	116,358,799	1,171,367,554
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	116,358,799	1,171,367,554
剰余金減少額又は欠損金増加額	173,206,508	294,372,611
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	173,206,508	294,372,611
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（ ）	1,318,379,749	4,582,766,666

## (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5期 2020年11月20日現在	第6期中間計算期間 2021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 8,247,933,135口	1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数 10,325,179,601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 1.3391円 (1万口当たり純資産額) (13,391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 1.4438円 (1万口当たり純資産額) (14,438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5期 自 2019年11月21日 至 2020年11月20日	第6期中間計算期間 自 2020年11月21日 至 2021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5期	第6期中間計算期間
	自 2019年11月21日 至 2020年11月20日	自 2020年11月21日 至 2021年5月20日
期首元本額	6,660,764,120円	8,247,933,135円
期中追加設定元本額	3,507,142,815円	2,929,258,363円
期中一部解約元本額	1,919,973,800円	852,011,897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）

2021年5月20日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	69,984,752
投資信託受益証券	4,824,329
投資証券	14,848,338,741
流動資産合計	14,923,147,822
<b>資産合計</b>	<b>14,923,147,822</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	49,000,000
未払利息	191
流動負債合計	49,000,191
<b>負債合計</b>	<b>49,000,191</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	9,716,186,977
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,157,960,654
元本等合計	14,874,147,631
純資産合計	14,874,147,631
<b>負債純資産合計</b>	<b>14,923,147,822</b>

#### 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	2021年5月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数		9,716,186,977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	1.5309円
	(1万口当たり純資産額)	(15,309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 2020年11月21日 至 2021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	2021年5月20日現在
同計算期間の期首元本額	7,784,447,971円
同計算期間の追加設定元本額	2,232,341,049円
同計算期間の一部解約元本額	300,602,043円
計算日の元本額	9,716,186,977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）	9,716,186,977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、2020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 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<b>Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing</b>				
<b>Bonds</b>				
<i>Australia</i>				
Australia Government Bond, Reg. S 2.75% 21/11/2028	AUD	2,110,000	1,877,475	0.16
Australia Government Bond, Reg. S 1% 21/11/2031	AUD	1,230,000	943,696	0.08
Australia Government Bond, Reg. S 1.75% 21/06/2051	AUD	850,000	624,294	0.06
			3,445,465	0.30
<i>Belgium</i>				
KBC Group NV, Reg. S 0.125% 10/09/2026	EUR	500,000	612,729	0.05
			612,729	0.05
<i>Bermuda</i>				
Bermuda Government Bond, 144A 2.375% 20/08/2030	USD	200,000	210,250	0.02
			210,250	0.02
<i>Brazil</i>				
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/01/2022	BRL	180,000	337,101	0.03
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/07/2022	BRL	1,920,000	349,939	0.03
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2025	BRL	2,830,000	630,334	0.05
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2027	BRL	2,600,000	592,288	0.05
Vale Overseas Ltd. 3.75% 08/07/2030	USD	276,000	307,329	0.03
			2,216,991	0.19
<i>Canada</i>				
Canada Government Bond 2.25% 01/06/2025	CAD	2,930,000	2,491,156	0.22
Canada Government Bond 1% 01/06/2027	CAD	1,870,000	1,518,727	0.13
Canada Government Bond 2.25% 01/06/2029	CAD	3,020,000	2,697,667	0.23
Canadian Natural Resources Ltd. 2.95% 15/07/2030	USD	434,000	464,741	0.04
Canadian Natural Resources Ltd. 4.95% 01/06/2047	USD	37,000	46,994	-
Cenovus Energy, Inc. 4.25% 15/04/2027	USD	70,000	76,476	0.01
Province of Quebec Canada 2.375% 31/01/2022	USD	46,000	47,052	-
TransCanada PipeLines Ltd. 4.1% 15/04/2030	USD	177,000	209,256	0.02
			7,552,069	0.65
<i>Chile</i>				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4.5% 01/03/2026	CLP	635,000,000	1,025,240	0.09
			1,025,240	0.09
<i>China</i>				
Agricultural Development Bank of China 3.75% 25/01/2029	CNY	1,330,000	204,972	0.02
Agricultural Development Bank of China 2.96% 17/04/2030	CNY	11,300,000	1,636,537	0.14
Baidu, Inc. 4.375% 14/05/2024	USD	300,000	330,438	0.03
China Construction Bank Corp., Reg. S 1% 04/08/2023	USD	700,000	701,816	0.06
China Development Bank 3.43% 14/01/2027	CNY	15,100,000	2,309,890	0.20
China Development Bank 4.24% 24/08/2027	CNY	10,900,000	1,746,980	0.15

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)  
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
China Development Bank 4.04% 06/07/2028	CNY	6,000,000	946,833	0.08
China Development Bank 3.48% 08/01/2029	CNY	27,200,000	4,124,029	0.36
China Government Bond 3.39% 16/03/2050	CNY	1,010,000	144,228	0.01
China Government Bond 3.12% 05/12/2026	CNY	17,600,000	2,691,548	0.23
China Government Bond 3.29% 23/05/2029	CNY	21,050,000	3,235,311	0.28
China Government Bond 3.86% 22/07/2049	CNY	13,000,000	2,018,923	0.17
China Government Bond, Reg. S 0.125% 12/11/2026	EUR	200,000	246,405	0.02
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd., 144A 3.5% 04/05/2027	USD	350,000	389,511	0.03
Tencent Holdings Ltd., Reg. S 1.81% 26/01/2026	USD	200,000	204,704	0.02
			20,932,125	1.80
<i>Colombia</i>				
Colombian TES 7.25% 26/10/2050	COP	1,889,000,000	596,152	0.05
Colombian TES 5.75% 03/11/2027	COP	4,971,000,000	1,542,855	0.13
			2,139,007	0.18
<i>Denmark</i>				
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab, Reg. S, 144A 0.5% 01/10/2040	DKK	4,170,524	688,037	0.06
Nykredit Realkredit A/S 1.5% 01/10/2037	DKK	1,759,181	301,166	0.03
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 0.5% 01/10/2040	DKK	31,604,752	5,218,695	0.45
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 1.5% 01/10/2040	DKK	2,158,422	367,921	0.03
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 0.5% 01/10/2050	DKK	3,017,257	488,935	0.04
			7,064,754	0.61
<i>France</i>				
BPCE SA, Reg. S 0.875% 31/01/2024	EUR	200,000	251,355	0.02
BPCE SA, Reg. S 0.25% 15/01/2026	EUR	300,000	372,088	0.03
Credit Agricole SA, Reg. S 0.875% 14/01/2032	EUR	300,000	385,038	0.03
France Government Bond OAT, Reg. S 0.75% 25/11/2028	EUR	210,000	282,295	0.03
France Government Bond OAT, Reg. S, 144A 2% 25/05/2048	EUR	365,000	650,116	0.06
Pernod Ricard SA, Reg. S 1.125% 07/04/2025	EUR	100,000	128,526	0.01
Peugeot SA, Reg. S 2.75% 15/05/2026	EUR	200,000	273,278	0.02
			2,342,696	0.20
<i>Germany</i>				
Allianz SE, Reg. S, FRN 4.75% Perpetual	EUR	100,000	136,855	0.01
Bayer AG, Reg. S 0.75% 06/01/2027	EUR	300,000	378,049	0.03
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0% 10/10/2025	EUR	2,170,000	2,746,192	0.24
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0% 15/08/2030 15/08/2027	EUR	1,700,000	2,194,608	0.19
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.5% 15/02/2029	EUR	1,400,000	1,851,482	0.16
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.25% 15/02/2029	EUR	4,490,000	5,900,625	0.51
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0% 15/02/2030	EUR	1,020,000	1,316,499	0.11
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0% 15/08/2050	EUR	1,500,000	1,923,843	0.17
Daimler International Finance BV, Reg. S 0.875% 09/04/2024	EUR	275,000	345,244	0.03
Hannover Rueck SE, Reg. S, FRN 1.75% 08/10/2040	EUR	200,000	262,414	0.02

## Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Volkswagen Financial Services NV, Reg. S 1.625% 10/02/2024	GBP	100,000	140,413	0.01
			17,196,224	1.48
<i>Greece</i>				
Greece Government Bond, Reg. S, 144A 3.375% 15/02/2025	EUR	720,000	998,481	0.09
Greece Government Bond, Reg. S 3.75% 30/01/2028	EUR	1,575,000	2,369,449	0.20
			3,367,930	0.29
<i>India</i>				
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Reg. S 7.125% 10/10/2022	INR	20,000,000	279,847	0.02
National Highways Authority of India, Reg. S 7.3% 18/05/2022	INR	30,000,000	423,457	0.04
			703,304	0.06
<i>Indonesia</i>				
Indonesia Government Bond, 144A 3.85% 18/07/2027	USD	625,000	715,287	0.06
Indonesia Government Bond 3.85% 15/10/2030	USD	425,000	494,949	0.04
Indonesia Government Bond, Reg. S 3.85% 18/07/2027	USD	250,000	286,115	0.03
Indonesia Treasury 8.25% 15/05/2029	IDR	3,386,000,000	278,133	0.02
Indonesia Treasury 7% 15/09/2030	IDR	10,223,000,000	789,099	0.07
Indonesia Treasury 6.5% 15/02/2031	IDR	4,520,000,000	336,945	0.03
Indonesia Treasury 7.5% 15/08/2032	IDR	1,691,000,000	131,286	0.01
Indonesia Treasury 6.625% 15/05/2033	IDR	4,226,000,000	309,475	0.03
			3,341,289	0.29
<i>Israel</i>				
Israel Government Bond 2% 31/03/2027	ILS	2,275,000	777,326	0.07
Israel Government Bond 2.5% 15/01/2030	USD	210,000	227,757	0.02
Israel Government Bond 2.75% 03/07/2030	USD	270,000	298,186	0.03
Israel Government Bond 5.5% 31/01/2042	ILS	1,295,000	690,316	0.06
Israel Government Bond 3.75% 31/03/2047	ILS	1,480,000	643,659	0.05
Israel Government Bond, Reg. S 2.875% 29/01/2024	EUR	520,000	694,872	0.06
Israel Government Bond, Reg. S 1.5% 16/01/2029	EUR	110,000	148,958	0.01
			3,481,074	0.30
<i>Italy</i>				
Intesa Sanpaolo SpA, Reg. S 1.36% 25/03/2022	JPY	100,000,000	975,120	0.08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S, 144A 0.95% 15/09/2027	EUR	2,780,000	3,566,081	0.31
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 0.1% 15/05/2023	EUR	1,826,000	2,345,304	0.20
			6,886,505	0.59
<i>Japan</i>				
American Honda Finance Corp. 1.2% 08/07/2025	USD	316,000	323,524	0.03
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/03/2024	JPY	391,000,000	3,815,488	0.33
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/06/2024	JPY	247,300,000	2,414,235	0.21
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/12/2024	JPY	93,800,000	916,551	0.08
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/09/2025	JPY	276,550,000	2,704,694	0.23
Japan Government Forty Year Bond 0.5% 20/03/2059	JPY	16,000,000	145,861	0.01

## Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/03/2027	JPY	269,350,000	2,641,128	0.23
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/09/2029	JPY	738,300,000	7,233,691	0.62
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/09/2030	JPY	1,041,850,000	10,168,130	0.88
Japan Government Thirty Year Bond 0.5% 20/03/2049	JPY	86,550,000	815,110	0.07
Japan Government Thirty Year Bond 2% 20/03/2042	JPY	10,000,000	127,498	0.01
Japan Government Thirty Year Bond 1.7% 20/03/2044	JPY	32,400,000	398,171	0.03
Japan Government Twenty Year Bond 1.2% 20/03/2035	JPY	130,000,000	1,434,048	0.12
Japan Government Twenty Year Bond 2.2% 20/03/2030	JPY	5,000,000	58,281	0.01
Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/06/2037	JPY	95,700,000	972,704	0.08
Japan Government Twenty Year Bond 0.4% 20/06/2040	JPY	125,000,000	1,212,576	0.11
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., Reg. S 2.25% 21/11/2026	EUR	250,000	343,752	0.03
Toyota Motor Credit Corp. 1.8% 13/02/2025	USD	290,000	304,214	0.03
Toyota Motor Credit Corp. 3.05% 11/01/2028	USD	147,000	165,268	0.01
Toyota Motor Credit Corp. 3.375% 01/04/2030	USD	123,000	143,999	0.01
			36,338,923	3.13
<i>Mexico</i>				
Mexican Bonos 7.5% 03/06/2027	MXN	64,000,000	3,662,693	0.32
Mexican Bonos 8.5% 31/05/2029	MXN	34,500,000	2,114,955	0.18
Mexican Bonos 8% 07/11/2047	MXN	14,000,000	830,995	0.07
Mexico City Airport Trust, Reg. S 5.5% 31/07/2047	USD	400,000	422,300	0.04
Mexico Government Bond 2.659% 24/05/2031	USD	276,000	283,190	0.02
Mexico Government Bond 3.9% 27/04/2025	USD	240,000	269,669	0.02
Petroleos Mexicanos 7.47% 12/11/2026	MXN	5,440,000	228,360	0.02
Petroleos Mexicanos, Reg. S 7.19% 12/09/2024	MXN	6,900,000	314,340	0.03
			8,126,502	0.70
<i>Morocco</i>				
Morocco Government Bond, 144A 1.375% 30/03/2026	EUR	360,000	443,286	0.04
Morocco Government Bond, 144A 1.5% 27/11/2031	EUR	210,000	250,717	0.02
Morocco Government Bond, Reg. S 4.25% 11/12/2022	USD	400,000	421,063	0.04
Morocco Government Bond, Reg. S 3.5% 19/06/2024	EUR	120,000	160,047	0.01
Morocco Government Bond, Reg. S 1.5% 27/11/2031	EUR	240,000	286,533	0.02
			1,561,646	0.13
<i>Netherlands</i>				
BAT Netherlands Finance BV, Reg. S 3.125% 07/04/2028	EUR	300,000	428,219	0.04
Conti-Gummi Finance BV, Reg. S 1.125% 25/09/2024	EUR	80,000	101,228	0.01
Cooperatieve Rabobank UA, Reg. S 1.25% 14/01/2025	GBP	300,000	424,123	0.04
Cooperatieve Rabobank UA, Reg. S 3.875% 25/07/2023	EUR	100,000	134,412	0.01
Enel Finance International NV, Reg. S 1% 16/09/2024	EUR	150,000	191,024	0.02

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)  
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Netherlands Government Bond 5.5% 15/01/2028	EUR	80,000	140,789	0.01
Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 2.25% 15/07/2022	EUR	50,000	63,883	-
Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 2% 15/07/2024	EUR	40,000	53,643	-
Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 0% 15/01/2027	EUR	2,300,000	2,920,504	0.25
			4,457,825	0.38
<i>Norway</i>				
Equinor ASA 3.7% 01/03/2024	USD	60,000	65,990	0.01
Equinor ASA 1.75% 22/01/2026	USD	84,000	88,262	0.01
Equinor ASA 2.375% 22/05/2030	USD	134,000	143,525	0.01
Norway Government Bond, Reg. S, 144A 1.75% 13/03/2025	NOK	10,680,000	1,306,624	0.11
			1,604,401	0.14
<i>Panama</i>				
Panama Government Bond 3.16% 23/01/2030	USD	700,000	776,563	0.06
Panama Government Bond 4.5% 01/04/2056	USD	335,000	432,987	0.04
			1,209,550	0.10
<i>Paraguay</i>				
Paraguay Government Bond, Reg. S 4.625% 25/01/2023	USD	200,000	215,500	0.02
Paraguay Government Bond, Reg. S 4.95% 28/04/2031	USD	800,000	971,000	0.08
			1,186,500	0.10
<i>Peru</i>				
Peru Government Bond 2.392% 23/01/2026	USD	220,000	235,072	0.02
Peru Government Bond 6.15% 12/08/2032	PEN	1,960,000	659,049	0.06
			894,121	0.08
<i>Philippines</i>				
Philippine Government Bond 1.648% 10/06/2031	USD	431,000	437,466	0.04
			437,466	0.04
<i>Portugal</i>				
Portugal Government Bond, Reg. S 5.125% 15/10/2024	USD	125,000	145,483	0.01
			145,483	0.01
<i>Qatar</i>				
Qatar Government Bond, 144A 4.5% 23/04/2028	USD	655,000	794,761	0.07
Qatar Government Bond, Reg. S 3.75% 16/04/2030	USD	200,000	235,765	0.02
Qatar Government Bond, Reg. S 4.4% 16/04/2050	USD	200,000	261,180	0.02
			1,291,706	0.11
<i>Romania</i>				
Romania Government Bond, 144A 2% 28/01/2032	EUR	170,000	218,392	0.02
Romania Government Bond, 144A 3.5% 03/04/2034	EUR	80,000	116,604	0.01
Romania Government Bond, 144A 3.375% 08/02/2038	EUR	175,000	246,620	0.02
Romania Government Bond, 144A 4.625% 03/04/2049	EUR	308,000	509,473	0.04

## Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Romania Government Bond, Reg. S 3.624% 26/05/2030	EUR	1,920,000	2,804,326	0.24
Romania Government Bond, Reg. S 2% 28/01/2032	EUR	1,150,000	1,477,355	0.13
Romania Government Bond, Reg. S 3.875% 29/10/2035	EUR	175,000	262,374	0.02
Romania Government Bond, Reg. S 4.125% 11/03/2039	EUR	125,000	191,628	0.02
Romania Government Bond, Reg. S 4.625% 03/04/2049	EUR	530,000	876,690	0.08
			6,703,462	0.58
<i>Russian Federation</i>				
Russian Federal Bond - OFZ 7% 16/08/2023	RUB	29,100,000	415,000	0.03
Russian Federal Bond - OFZ 6.9% 23/05/2029	RUB	117,390,000	1,706,964	0.15
Russian Federal Bond - OFZ 7.65% 10/04/2030	RUB	17,300,000	264,262	0.02
Russian Federal Bond - OFZ 8.5% 17/09/2031	RUB	5,390,000	87,541	0.01
Russian Federal Bond - OFZ 7.7% 23/03/2033	RUB	38,190,000	582,072	0.05
Russian Federal Bond - OFZ 7.25% 10/05/2034	RUB	7,920,000	116,584	0.01
Russian Foreign Bond - Eurobond, Reg. S 2.875% 04/12/2025	EUR	700,000	946,045	0.08
Russian Foreign Bond - Eurobond, Reg. S 4.25% 23/06/2027	USD	400,000	457,250	0.04
			4,575,718	0.39
<i>Saudi Arabia</i>				
KSA Sukuk Ltd., 144A 2.894% 20/04/2022	USD	200,000	206,249	0.02
KSA Sukuk Ltd., 144A 3.628% 20/04/2027	USD	225,000	253,092	0.02
Saudi Arabian Oil Co., 144A 1.625% 24/11/2025	USD	200,000	205,041	0.02
Saudi Government Bond, Reg. S 2.9% 22/10/2025	USD	400,000	431,690	0.04
Saudi Government Bond, Reg. S 3.625% 04/03/2028	USD	260,000	291,829	0.02
			1,387,901	0.12
<i>Serbia</i>				
Serbia Government Bond, 144A 3.125% 15/05/2027	EUR	1,010,000	1,389,580	0.12
Serbia Government Bond, 144A 1.5% 26/06/2029	EUR	110,000	139,308	0.01
Serbia Government Bond, Reg. S 3.125% 15/05/2027	EUR	1,150,000	1,582,196	0.14
			3,111,084	0.27
<i>Singapore</i>				
Singapore Government Bond 2.625% 01/05/2028	SGD	673,000	576,709	0.05
Singapore Government Bond 2.875% 01/07/2029	SGD	293,000	259,473	0.02
Singapore Government Bond 2.875% 01/09/2030	SGD	314,000	282,457	0.03
			1,118,639	0.10
<i>South Africa</i>				
South Africa Government Bond 6.5% 28/02/2041	ZAR	4,690,000	209,211	0.02
South Africa Government Bond 8.75% 28/02/2048	ZAR	11,765,000	659,628	0.06
			868,839	0.08
<i>South Korea</i>				
Korea Housing Finance Corp., Reg. S 2% 11/10/2021	USD	475,000	480,752	0.04
Korea Treasury 2% 10/09/2022	KRW	844,000,000	791,626	0.07
Korea Treasury 1.5% 10/03/2025	KRW	1,988,000,000	1,847,825	0.16
Korea Treasury 4.25% 10/06/2021	KRW	58,500,000	54,701	-
			3,174,904	0.27

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)  
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Spain</i>				
CaixaBank SA, Reg. S, FRN 3.5% 15/02/2027	EUR	100,000	126,017	0.01
			126,017	0.01
<i>Sri Lanka</i>				
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.25% 27/07/2021	USD	630,000	548,339	0.05
			548,339	0.05
<i>Supra National</i>				
International Finance Corp. 6.3% 25/11/2024	INR	15,000,000	213,019	0.02
			213,019	0.02
<i>Thailand</i>				
Thailand Government Bond 3.65% 20/06/2031	THB	16,725,000	690,995	0.06
			690,995	0.06
<i>Ukraine</i>				
Ukraine Government Bond, Reg. S 6.75% 20/06/2026	EUR	350,000	472,270	0.04
			472,270	0.04
<i>United Arab Emirates</i>				
Abu Dhabi Government Bond, 144A 2.5% 11/10/2022	USD	775,000	803,346	0.07
Abu Dhabi Government Bond, 144A 2.5% 16/04/2025	USD	415,000	444,087	0.04
Abu Dhabi Government Bond, Reg. S 0.75% 02/09/2023	USD	655,000	657,063	0.05
			1,904,496	0.16
<i>United Kingdom</i>				
Anglo American Capital plc, 144A 4% 11/09/2027	USD	200,000	229,706	0.02
Barclays Bank plc, Reg. S 10% 21/05/2021	GBP	50,000	70,660	0.01
BAT Capital Corp. 3.215% 06/09/2026	USD	349,000	384,773	0.03
BAT Capital Corp. 4.7% 02/04/2027	USD	123,000	144,773	0.01
BAT Capital Corp. 4.758% 06/09/2049	USD	140,000	162,583	0.01
HSBC Holdings plc, FRN 4.292% 12/09/2026	USD	250,000	285,167	0.02
HSBC Holdings plc 4% 30/03/2022	USD	110,000	114,979	0.01
HSBC Holdings plc, FRN 3.033% 22/11/2023	USD	275,000	289,108	0.02
Lloyds Banking Group plc, FRN 3.87% 09/07/2025	USD	270,000	298,004	0.03
Lloyds Banking Group plc, Reg. S, FRN 1.875% 15/01/2026	GBP	128,000	181,155	0.01
NatWest Markets plc, Reg. S 2.75% 02/04/2025	EUR	250,000	339,592	0.03
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/09/2021	USD	90,000	91,185	0.01
UK Treasury, Reg. S 1.625% 22/10/2028	GBP	365,000	560,228	0.05
UK Treasury, Reg. S 4.75% 07/12/2030	GBP	1,150,000	2,276,745	0.20
UK Treasury, Reg. S 4.25% 07/06/2032	GBP	740,000	1,461,293	0.13
UK Treasury, Reg. S 4.5% 07/09/2034	GBP	590,000	1,247,290	0.11
UK Treasury, Reg. S 0.625% 31/07/2035	GBP	1,901,000	2,639,813	0.23
UK Treasury, Reg. S 0.625% 22/10/2050	GBP	520,000	689,006	0.06
			11,466,060	0.99

## Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>United States of America</i>				
Abbott Laboratories 3.75% 30/11/2026	USD	57,000	66,807	0.01
AbbVie, Inc. 3.2% 14/05/2026	USD	300,000	332,692	0.03
Alexandria Real Estate Equities, Inc. 1.875% 01/02/2033	USD	372,000	372,138	0.03
Altria Group, Inc. 1% 15/02/2023	EUR	125,000	155,755	0.01
Altria Group, Inc. 4.4% 14/02/2026	USD	55,000	63,872	0.01
Altria Group, Inc. 2.2% 15/06/2027	EUR	375,000	500,433	0.04
American Campus Communities Operating Partnership LP, REIT 3.875% 30/01/2031	USD	50,000	56,696	-
American Electric Power Co., Inc. 1% 01/11/2025	USD	50,000	50,631	-
Anheuser-Busch Cos. LLC 4.9% 01/02/2046	USD	260,000	339,434	0.03
AT&T, Inc. 1.65% 01/02/2028	USD	150,000	153,174	0.01
AT&T, Inc. 2.25% 01/02/2032	USD	375,000	380,920	0.03
Avangrid, Inc. 3.8% 01/06/2029	USD	300,000	344,396	0.03
Becton Dickinson and Co. 2.823% 20/05/2030	USD	67,000	73,689	0.01
Becton Dickinson and Co. 3.734% 15/12/2024	USD	180,000	199,634	0.02
Berkshire Hathaway Energy Co. 3.75% 15/11/2023	USD	60,000	65,387	0.01
Boeing Co. (The) 3.625% 01/02/2031	USD	13,000	14,265	-
Boeing Co. (The) 4.875% 01/05/2025	USD	15,000	17,109	-
BP Capital Markets America, Inc. 2.939% 04/06/2051	USD	390,000	398,250	0.03
BP Capital Markets America, Inc. 4.234% 06/11/2028	USD	225,000	268,952	0.02
Cigna Corp. 3.4% 17/09/2021	USD	115,000	117,488	0.01
Cigna Corp. 4.125% 15/11/2025	USD	80,000	92,172	0.01
Cigna Corp. 4.375% 15/10/2028	USD	160,000	193,432	0.02
CMS Energy Corp. 3.45% 15/08/2027	USD	175,000	197,956	0.02
CMS Energy Corp. 3.6% 15/11/2025	USD	25,000	28,035	-
Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 4% 01/12/2028	USD	200,000	236,227	0.02
Enbridge Energy Partners LP 7.375% 15/10/2045	USD	22,000	33,596	-
Enterprise Products Operating LLC 2.8% 31/01/2030	USD	38,000	41,228	-
Essex Portfolio LP, REIT 3.5% 01/04/2025	USD	30,000	33,257	-
Exxon Mobil Corp. 3.482% 19/03/2030	USD	290,000	338,016	0.03
FirstEnergy Corp. 3.9% 15/07/2027	USD	225,000	248,202	0.02
FirstEnergy Corp. 2.65% 01/03/2030	USD	100,000	100,423	0.01
FirstEnergy Corp. 2.25% 01/09/2030	USD	100,000	96,800	0.01
General Motors Financial Co., Inc. 3.55% 08/07/2022	USD	140,000	146,054	0.01
Global Payments, Inc. 2.9% 15/05/2030	USD	135,000	146,906	0.01
Harley-Davidson Financial Services, Inc., Reg. S 3.875% 19/05/2023	EUR	230,000	304,618	0.03
International Business Machines Corp. 1.95% 15/05/2030	USD	290,000	298,992	0.03
Medtronic, Inc. 3.5% 15/03/2025	USD	25,000	28,061	-
Morgan Stanley, FRN 0.637% 26/07/2024	EUR	250,000	311,014	0.03
MPLX LP 2.65% 15/08/2030	USD	218,000	228,720	0.02
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2.25% 01/06/2030	USD	1,661,000	1,742,622	0.15
Oracle Corp. 3.6% 01/04/2050	USD	310,000	362,040	0.03
Philip Morris International, Inc. 2.1% 01/05/2030	USD	106,000	110,629	0.01
Philip Morris International, Inc. 2.9% 15/11/2021	USD	25,000	25,584	-

## Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Prologis LP, REIT 3.75% 01/11/2025	USD	25,000	28,407	–
Public Service Enterprise Group, Inc. 2% 15/11/2021	USD	80,000	80,990	0.01
Raytheon Technologies Corp. 4.125% 16/11/2028	USD	215,000	256,372	0.02
Reynolds American, Inc. 4.45% 12/06/2025	USD	195,000	222,148	0.02
Roper Technologies, Inc. 1% 15/09/2025	USD	350,000	354,386	0.03
Stryker Corp. 0.75% 01/03/2029	EUR	190,000	241,492	0.02
Thermo Fisher Scientific, Inc. 4.133% 25/03/2025	USD	161,000	183,102	0.02
US Bank NA 3.45% 16/11/2021	USD	400,000	410,318	0.04
US Treasury 1.875% 30/09/2022	USD	1,270,000	1,308,651	0.11
US Treasury 0.125% 30/11/2022	USD	20,875,000	20,877,073	1.80
US Treasury 2.5% 31/01/2024	USD	11,115,000	11,908,132	1.03
US Treasury 2.125% 31/03/2024	USD	2,125,000	2,257,861	0.19
US Treasury 2.25% 30/04/2024	USD	5,140,000	5,490,260	0.47
US Treasury 1.75% 31/12/2024	USD	4,970,000	5,264,483	0.45
US Treasury 0.375% 30/11/2025	USD	21,593,000	21,620,902	1.86
US Treasury 0.625% 15/05/2030	USD	2,960,000	2,893,260	0.25
US Treasury 0.625% 15/08/2030	USD	4,260,000	4,152,083	0.36
US Treasury 0.875% 15/11/2030	USD	35,852,000	35,714,753	3.07
US Treasury 1.25% 15/05/2050	USD	276,000	250,317	0.02
US Treasury 1.375% 15/08/2050	USD	20,073,000	18,783,291	1.62
US Treasury Inflation Indexed 0.125% 15/01/2030	USD	1,570,000	1,772,319	0.15
US Treasury Inflation Indexed 1% 15/02/2049	USD	1,900,000	2,772,706	0.24
US Treasury Inflation Indexed 1% 15/02/2046	USD	305,000	457,716	0.04
Verizon Communications, Inc. 0.85% 20/11/2025	USD	750,000	756,074	0.07
Walt Disney Co. (The) 2.65% 13/01/2031	USD	490,000	537,352	0.05
Wells Fargo & Co., Reg. S, FRN 1.338% 04/05/2025	EUR	340,000	432,813	0.04
			148,343,567	12.77
<b>Total Bonds</b>			<b>324,477,085</b>	<b>27.93</b>
<b>Equities</b>				
<i>Brazil</i>				
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	BRL	393,755	4,698,498	0.40
Pagueuro Digital Ltd. 'A'	USD	249,600	14,197,248	1.22
Petroleo Brasileiro SA, ADR	USD	193,162	2,169,209	0.19
Vale SA	BRL	349,964	5,892,024	0.51
			26,956,979	2.32
<i>Canada</i>				
TC Energy Corp.	CAD	130,608	5,309,894	0.46
			5,309,894	0.46
<i>China</i>				
Alibaba Group Holding Ltd.	HKD	141,600	4,248,484	0.37
Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	CNY	31,301	9,562,892	0.82
Longfor Group Holdings Ltd., Reg. S	HKD	945,500	5,537,050	0.48
Shimao Group Holdings Ltd.	HKD	843,000	2,685,873	0.23
			22,034,299	1.90
<i>Denmark</i>				
Coloplast A/S 'B'	DKK	43,989	6,711,998	0.58
			6,711,998	0.58
<i>France</i>				
Airbus SE	EUR	69,324	7,603,438	0.65

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)  
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Edenred	EUR	96,564	5,474,868	0.47
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	18,564	11,586,553	1.00
Peugeot SA	EUR	81,595	2,229,853	0.19
			26,894,712	2.31
<i>Germany</i>				
Bayer AG	EUR	37,335	2,196,364	0.19
Carl Zeiss Meditec AG	EUR	25,586	3,403,902	0.29
Deutsche Boerse AG	EUR	27,338	4,650,598	0.40
MTU Aero Engines AG	EUR	16,500	4,301,552	0.37
			14,552,416	1.25
<i>Hong Kong</i>				
AIA Group Ltd.	HKD	527,200	6,460,409	0.56
Budweiser Brewing Co. APAC Ltd., Reg. S	HKD	928,200	3,065,085	0.26
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	HKD	109,100	5,981,013	0.52
Shimao Services Holdings Ltd., Reg. S	HKD	7,829	12,078	-
SITC International Holdings Co. Ltd.	HKD	2,801,000	6,048,248	0.52
			21,566,833	1.86
<i>Italy</i>				
Enel SpA	EUR	931,225	9,415,034	0.81
Ferrari NV	EUR	14,091	3,247,472	0.28
FinecoBank Banca Fineco SpA	EUR	224,102	3,668,575	0.32
			16,331,081	1.41
<i>Japan</i>				
Keyence Corp.	JPY	10,100	5,673,333	0.49
Murata Manufacturing Co. Ltd.	JPY	47,800	4,314,522	0.37
Nidec Corp.	JPY	19,000	2,388,456	0.21
Nintendo Co. Ltd.	JPY	11,300	7,204,290	0.62
SMC Corp.	JPY	9,300	5,669,798	0.49
SoftBank Corp.	JPY	755,200	9,456,913	0.81
Tokio Marine Holdings, Inc.	JPY	102,600	5,274,329	0.45
Tokyo Electron Ltd.	JPY	31,200	11,603,119	1.00
			51,584,760	4.44
<i>Mexico</i>				
America Movil SAB de CV, ADR 'L'	USD	127,347	1,851,625	0.16
			1,851,625	0.16
<i>Netherlands</i>				
Akzo Nobel NV	EUR	37,408	4,015,157	0.35
ASML Holding NV	EUR	54,278	26,361,031	2.27
Coca-Cola European Partners plc	USD	52,084	2,595,346	0.22
Koninklijke DSM NV	EUR	22,133	3,807,060	0.33
Koninklijke Philips NV	EUR	43,311	2,316,438	0.20
			39,095,032	3.37
<i>New Zealand</i>				
Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd.	NZD	220,898	5,240,124	0.45
			5,240,124	0.45
<i>South Korea</i>				
Samsung Electronics Co. Ltd. Preference	KRW	76,556	5,186,893	0.45
			5,186,893	0.45

## Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Switzerland</i>				
Givaudan SA	CHF	1,658	6,985,587	0.60
Nestle SA	CHF	124,229	14,630,199	1.26
Novartis AG	CHF	52,796	4,988,575	0.43
Zurich Insurance Group AG	CHF	33,376	14,081,030	1.21
			40,685,391	3.50
<i>Taiwan</i>				
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	1,957,000	36,914,015	3.18
			36,914,015	3.18
<i>United Kingdom</i>				
AstraZeneca plc	GBP	173,209	17,347,869	1.49
BAE Systems plc	GBP	628,590	4,201,709	0.36
British American Tobacco plc, ADR	USD	10,569	396,232	0.04
British American Tobacco plc	GBP	225,791	8,361,470	0.72
Croda International plc	GBP	61,381	5,536,585	0.48
Ocado Group plc	GBP	231,269	7,232,874	0.62
Rio Tinto plc	GBP	34,723	2,597,358	0.22
Spirax-Sarco Engineering plc	GBP	32,352	4,997,062	0.43
			50,671,159	4.36
<i>United States of America</i>				
Alphabet, Inc. 'C'	USD	4,349	7,618,926	0.66
Altria Group, Inc.	USD	210,440	8,628,040	0.74
Amazon.com, Inc.	USD	2,284	7,438,828	0.64
American Tower Corp., REIT	USD	20,818	4,672,808	0.40
Amphenol Corp. 'A'	USD	35,244	4,608,858	0.40
Baker Hughes Co.	USD	200,602	4,182,552	0.36
Berkshire Hathaway, Inc. 'A'	USD	30	10,434,450	0.90
BlackRock, Inc.	USD	10,278	7,415,988	0.64
Boeing Co. (The)	USD	7,495	1,604,380	0.14
Broadcom, Inc.	USD	49,871	21,836,017	1.88
Brookfield Infrastructure Partners LP	CAD	45,154	2,234,110	0.19
Chevron Corp.	USD	36,701	3,099,400	0.27
Cigna Corp.	USD	17,780	3,701,440	0.32
Coca-Cola Co. (The)	USD	47,344	2,596,345	0.22
Crown Castle International Corp., REIT	USD	48,116	7,659,586	0.66
CSX Corp.	USD	41,771	3,790,718	0.33
Darden Restaurants, Inc.	USD	44,305	5,277,612	0.45
Domino's Pizza, Inc.	USD	12,216	4,684,347	0.40
Equinix, Inc., REIT	USD	8,973	6,408,337	0.55
Gaming and Leisure Properties, Inc., REIT	USD	111,498	4,727,515	0.41
General Motors Co.	USD	89,767	3,737,898	0.32
Gilead Sciences, Inc.	USD	42,097	2,452,571	0.21
Home Depot, Inc. (The)	USD	37,637	9,997,140	0.86
Honeywell International, Inc.	USD	16,197	3,445,102	0.30
Humana, Inc.	USD	22,692	9,309,847	0.80
JPMorgan Chase & Co.	USD	137,409	17,460,562	1.50
Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	250,559	8,017,888	0.69
LyondellBasell Industries NV 'A'	USD	44,433	4,072,729	0.35
Mastercard, Inc. 'A'	USD	13,410	4,786,565	0.41
Merck & Co., Inc.	USD	86,798	7,100,076	0.61

## Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Mettler-Toledo International, Inc.	USD	5,273	6,009,533	0.52
Microsoft Corp.	USD	130,027	28,920,605	2.49
Pfizer, Inc.	USD	225,518	8,301,318	0.71
Philip Morris International, Inc.	USD	162,005	13,412,394	1.15
Procter & Gamble Co. (The)	USD	15,553	2,164,045	0.19
S&P Global, Inc.	USD	15,343	5,043,704	0.43
Thermo Fisher Scientific, Inc.	USD	15,375	7,161,368	0.62
Union Pacific Corp.	USD	12,997	2,706,235	0.23
United Parcel Service, Inc. 'B'	USD	16,277	2,741,047	0.24
UnitedHealth Group, Inc.	USD	37,412	13,119,640	1.13
Verizon Communications, Inc.	USD	120,661	7,088,834	0.61
Viatis, Inc.	USD	158,784	2,975,612	0.26
Visa, Inc. 'A'	USD	23,495	5,139,061	0.44
Watsco, Inc.	USD	17,200	3,896,660	0.34
Wynn Resorts Ltd.	USD	13,593	1,533,698	0.13
			303,214,389	26.10
<b>Total Equities</b>			<b>674,801,600</b>	<b>58.10</b>
<b>Total Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing</b>			<b>999,278,685</b>	<b>86.03</b>
<b>Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market</b>				
<b>Bonds</b>				
<i>Brazil</i>				
BRAZIL NTN, FRN 1.977% 15/08/2024	BRL	180,000	1,369,137	0.12
			1,369,137	0.12
<i>Canada</i>				
Province of Quebec Canada 1.9% 01/09/2030	CAD	1,760,000	1,459,601	0.13
Toronto-Dominion Bank (The) 1.15% 12/06/2025	USD	400,000	408,624	0.03
			1,868,225	0.16
<i>France</i>				
BPCE SA 0.64% 27/01/2022	JPY	300,000,000	2,914,412	0.25
BPCE SA, 144A 5.15% 21/07/2024	USD	211,000	240,477	0.02
Vinci SA, 144A 3.75% 10/04/2029	USD	225,000	264,085	0.03
			3,418,974	0.30
<i>Germany</i>				
Daimler Finance North America LLC, 144A 3% 22/02/2021	USD	250,000	250,833	0.02
Daimler Finance North America LLC, 144A 2% 06/07/2021	USD	200,000	201,624	0.02
Deutsche Bank AG 2.129% 24/11/2026	USD	200,000	204,642	0.02
Deutsche Telekom International Finance BV, 144A 2.485% 19/09/2023	USD	175,000	183,215	0.01
			840,314	0.07
<i>Japan</i>				
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/09/2024	JPY	27,000,000	264,893	0.02
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2027	JPY	15,000,000	148,133	0.01

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)  
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2028	JPY	309,200,000	3,021,714	0.26
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2029	JPY	404,000,000	3,928,705	0.34
Mizuho Financial Group, Inc., FRN 2.721% 16/07/2023	USD	347,000	358,486	0.03
Nissan Motor Acceptance Corp., 144A 2.6% 28/09/2022	USD	60,000	61,583	0.01
			7,783,514	0.67
<i>Malaysia</i>				
Malaysia Government Bond 3.62% 30/11/2021	MYR	325,000	82,122	0.01
Malaysia Government Bond 3.9% 30/11/2026	MYR	2,300,000	621,658	0.05
Malaysia Government Bond 3.899% 16/11/2027	MYR	3,090,000	843,176	0.07
Malaysia Government Bond 4.893% 08/06/2038	MYR	4,906,000	1,439,825	0.12
Malaysia Government Bond 3.757% 22/05/2040	MYR	6,929,000	1,810,541	0.16
Malaysia Government Bond 4.736% 15/03/2046	MYR	1,134,000	322,446	0.03
			5,119,768	0.44
<i>Mexico</i>				
Mexico Government Bond 0.62% 05/07/2022	JPY	100,000,000	965,338	0.08
			965,338	0.08
<i>Netherlands</i>				
Enel Finance International NV, 144A 2.75% 06/04/2023	USD	200,000	209,389	0.02
Enel Finance International NV, 144A 3.5% 06/04/2028	USD	550,000	626,936	0.05
			836,325	0.07
<i>United Kingdom</i>				
AstraZeneca plc 3.375% 16/11/2025	USD	350,000	393,795	0.04
Niagara Mohawk Power Corp., Reg. S 3.508% 01/10/2024	USD	5,000	5,495	-
			399,290	0.04
<i>United States of America</i>				
Altria Group, Inc. 3.4% 06/05/2030	USD	25,000	28,079	-
Amazon.com, Inc. 2.5% 03/06/2050	USD	610,000	632,952	0.06
Amgen, Inc. 1.9% 21/02/2025	USD	79,000	83,184	0.01
Apple, Inc. 2.4% 20/08/2050	USD	230,000	235,895	0.02
Apple, Inc. 2.65% 11/05/2050	USD	71,000	75,360	0.01
Bank of America Corp. 1.319% 19/06/2026	USD	246,000	251,412	0.02
Bank of America Corp., FRN 2.456% 22/10/2025	USD	109,000	116,240	0.01
Bank of America Corp., FRN 3.419% 20/12/2028	USD	298,000	337,146	0.03
BMW US Capital LLC, 144A 3.15% 18/04/2024	USD	105,000	113,254	0.01
Broadcom, Inc. 3.15% 15/11/2025	USD	130,000	142,003	0.01
Broadcom, Inc. 4.15% 15/11/2030	USD	130,000	150,579	0.01
Charter Communications Operating LLC 2.3% 01/02/2032	USD	510,000	510,764	0.04
Citigroup, Inc., FRN 3.106% 08/04/2026	USD	525,000	574,291	0.05
Citigroup, Inc., FRN 2.572% 03/06/2031	USD	340,000	362,494	0.03
Comcast Corp. 3.95% 15/10/2025	USD	115,000	132,179	0.01
CSX Corp. 2.5% 15/05/2051	USD	200,000	198,668	0.02

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)  
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
CSX Corp. 3.8% 15/04/2050	USD	12,000	14,868	–
Equinix, Inc., REIT 1.8% 15/07/2027	USD	222,000	228,773	0.02
Equinix, Inc., REIT 2.15% 15/07/2030	USD	910,000	927,032	0.08
Exelon Corp. 3.497% 01/06/2022	USD	90,000	93,633	0.01
Exelon Corp. 3.4% 15/04/2026	USD	20,000	22,538	–
FHLMC Q52216 3.5% 01/11/2047	USD	31,669	33,622	–
General Mills, Inc. 3.2% 16/04/2021	USD	35,000	35,271	–
GNMA MA5764 4.5% 20/02/2049	USD	467,262	505,746	0.04
GNMA MA5877 4.5% 20/04/2049	USD	9,622	10,407	–
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 1.093% 09/12/2026	USD	400,000	404,501	0.04
Grand Parkway Transportation Corp. 3.236% 01/10/2052	USD	150,000	156,998	0.01
Interstate Power and Light Co. 2.3% 01/06/2030	USD	75,000	79,430	0.01
Intuit, Inc. 1.35% 15/07/2027	USD	90,000	92,185	0.01
JPMorgan Chase & Co. 1.045% 19/11/2026	USD	750,000	758,661	0.07
JPMorgan Chase & Co., FRN 4.005% 23/04/2029	USD	340,000	399,388	0.03
JPMorgan Chase & Co., FRN 3.54% 01/05/2028	USD	100,000	114,387	0.01
Keurig Dr Pepper, Inc. 4.597% 25/05/2028	USD	400,000	487,398	0.04
Keurig Dr Pepper, Inc. 3.2% 01/05/2030	USD	30,000	34,003	–
Morgan Stanley 0.985% 10/12/2026	USD	1,310,000	1,320,280	0.11
Ohio Turnpike & Infrastructure Commission 3.216% 15/02/2048	USD	175,000	178,514	0.02
Pacific Gas and Electric Co. 2.1% 01/08/2027	USD	1,068,000	1,085,375	0.09
Pacific Gas and Electric Co. 3.3% 01/12/2027	USD	250,000	267,234	0.02
Pacific Gas and Electric Co. 3.3% 01/08/2040	USD	880,000	879,350	0.08
Pacific Oil and Gas 3.85% 15/11/2023	USD	20,000	21,272	–
PayPal Holdings, Inc. 2.3% 01/06/2030	USD	72,000	77,184	0.01
Philip Morris International, Inc. 0.875% 01/05/2026	USD	208,000	208,973	0.02
Southern California Edison Co. 2.85% 01/08/2029	USD	420,000	458,440	0.04
Southern California Gas Co. 2.55% 01/02/2030	USD	440,000	477,551	0.04
UMBS BJ9358 4% 01/03/2048	USD	65,400	69,906	0.01
UMBS MA4228 1.5% 01/01/2036	USD	1,492,000	1,535,974	0.13
UMBS SB8083 1.5% 01/01/2036	USD	58,191	59,906	0.01
UMBS SI2002 4% 01/03/2048	USD	263,254	281,783	0.02
Wells Fargo & Co., FRN 2.393% 02/06/2028	USD	750,000	798,849	0.07
			16,063,932	1.38
<b>Total Bonds</b>			<b>38,664,817</b>	<b>3.33</b>
<b>Total Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market</b>			<b>38,664,817</b>	<b>3.33</b>
<b>Recently issued securities</b>				
<b>Bonds</b>				
<i>South Korea</i>				
Hyundai Capital America, 144A 2.375% 15/10/2027	USD	264,000	277,104	0.03
			277,104	0.03
<i>Switzerland</i>				
UBS Group AG, 144A 1.008% 30/07/2024	USD	250,000	252,560	0.02
			252,560	0.02

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)  
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>United States of America</i>				
AT&T, Inc., Reg. S 2.55% 01/12/2033	USD	116,000	119,538	0.01
Berkshire Hathaway Energy Co., 144A 1.65% 15/05/2031	USD	300,000	300,338	0.03
BMW US Capital LLC, 144A 3.9% 09/04/2025	USD	130,000	146,413	0.01
BMW US Capital LLC, 144A 4.15% 09/04/2030	USD	130,000	157,335	0.01
New York Life Insurance Co., 144A 3.75% 15/05/2050	USD	41,000	49,094	-
T-Mobile USA, Inc., 144A 3.875% 15/04/2030	USD	425,000	492,685	0.04
T-Mobile USA, Inc., 144A 2.55% 15/02/2031	USD	200,000	210,264	0.02
T-Mobile USA, Inc., 144A 3% 15/02/2041	USD	211,000	219,144	0.02
Viatis, Inc., 144A 2.3% 22/06/2027	USD	75,000	79,931	0.01
			1,774,742	0.15
<b>Total Bonds</b>			<b>2,304,406</b>	<b>0.20</b>
<b>Total Recently issued securities</b>			<b>2,304,406</b>	<b>0.20</b>
<b>Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings</b>				
<b>Collective Investment Schemes - UCITS</b>				
<i>Luxembourg</i>				
JPMorgan USD Treasury CNAV Fund - JPM USD Treasury CNAV Institutional (dist.)	USD	76,115,151	76,115,151	6.55
			76,115,151	6.55
<b>Total Collective Investment Schemes - UCITS</b>			<b>76,115,151</b>	<b>6.55</b>
<b>Total Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings</b>			<b>76,115,151</b>	<b>6.55</b>
<b>Total Investments</b>			<b>1,116,363,059</b>	<b>96.11</b>
<b>Cash</b>			<b>36,997,161</b>	<b>3.19</b>
<b>Other assets/(liabilities)</b>			<b>8,189,794</b>	<b>0.70</b>
<b>Total net assets</b>			<b>1,161,550,014</b>	<b>100.00</b>

## Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

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	118,168	126,545	(504)	0.01
United States of America	GNMA, 4.50%, 15/02/2050	USD	282,832	303,148	(215)	0.03
United States of America	UMBS, 1.50%, 25/02/2035	USD	4,390,807	4,511,585	11,170	0.39
United States of America	UMBS, 2.00%, 25/02/2050	USD	461,074	478,076	2,301	0.04
United States of America	UMBS, 4.50%, 25/02/2050	USD	669,572	726,603	614	0.06
United States of America	UMBS, 2.00%, 25/03/2050	USD	599,087	620,171	2,031	0.05
<b>Total To Be Announced Contracts Long Positions</b>				<b>6,766,128</b>	<b>15,397</b>	<b>0.58</b>
<b>Net To Be Announced Contracts</b>				<b>6,766,128</b>	<b>15,397</b>	<b>0.58</b>

## Interest Rate Swap Contracts

Nominal Amount	Currency	Counterparty	Security Description	Maturity Date	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
2,800,000	EUR	Citigroup	Pay floating EURIBOR 6 month Receive fixed (0.122)%	25/07/2024	24,880	24,880	-
<b>Total Unrealised Gain on Interest Rate Swap Contracts</b>					<b>24,880</b>	<b>24,880</b>	<b>-</b>
<b>Net Unrealised Gain on Interest Rate Swap Contracts</b>					<b>24,880</b>	<b>24,880</b>	<b>-</b>

## Financial Futures Contracts

Security Description	Number of Contracts	Currency	Global Exposure USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
US 2 Year Note, 31/03/2021	18	USD	3,977,578	3,784	-
US 5 Year Note, 31/03/2021	18	USD	2,270,953	4,908	-
US 10 Year Ultra Bond, 22/03/2021	(10)	USD	(1,563,594)	3,385	-
<b>Total Unrealised Gain on Financial Futures Contracts</b>				<b>12,077</b>	<b>-</b>
Euro-Bund, 08/03/2021	(7)	EUR	(1,519,097)	(6,554)	-
US Ultra Bond, 22/03/2021	(2)	USD	(427,125)	(4,413)	-
<b>Total Unrealised Loss on Financial Futures Contracts</b>				<b>(10,967)</b>	<b>-</b>
<b>Net Unrealised Gain on Financial Futures Contracts</b>				<b>1,110</b>	<b>-</b>

## Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Forward Currency Exchange Contracts							
Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
MYR	2,030,000	USD	497,756	07/01/2021	Standard Chartered	6,864	-
AUD	460,000	USD	342,578	08/01/2021	UBS	12,075	-
CNH	1,770,000	USD	271,429	08/01/2021	Citibank	702	-
CNH	1,750,000	USD	267,637	08/01/2021	Standard Chartered	1,420	-
CZK	14,155,000	EUR	539,064	08/01/2021	HSBC	472	-
EUR	1,140,000	USD	1,375,615	08/01/2021	Bank of America	17,188	-
EUR	6,522,127	USD	7,841,326	08/01/2021	Morgan Stanley	127,130	0.01
EUR	810,000	USD	982,240	08/01/2021	Standard Chartered	7,384	-
GBP	460,000	USD	612,574	08/01/2021	Citibank	16,498	-
SGD	350,000	USD	261,614	08/01/2021	Bank of America	3,218	-
ZAR	2,380,000	USD	154,009	08/01/2021	Bank of America	7,863	-
CLP	473,300,000	USD	641,676	14/01/2021	Citibank	24,381	-
JPY	69,740,000	USD	671,857	14/01/2021	Goldman Sachs	3,640	-
JPY	725,460,000	USD	6,959,053	14/01/2021	HSBC	67,707	0.01
JPY	31,100,000	USD	300,197	14/01/2021	Morgan Stanley	1,036	-
KRW	2,858,440,000	USD	2,629,499	14/01/2021	Citibank	2,361	-
CNH	5,120,000	USD	782,303	19/01/2021	Goldman Sachs	4,299	-
DKK	3,720,000	USD	607,276	19/01/2021	Goldman Sachs	3,542	-
THB	22,600,000	USD	752,155	19/01/2021	UBS	2,176	-
USD	998,593	BRL	5,110,000	22/01/2021	Goldman Sachs	14,876	-
EUR	770,000	USD	939,798	25/01/2021	HSBC	1,352	-
EUR	400,000	USD	488,109	25/01/2021	Morgan Stanley	800	-
GBP	1,994,710	USD	2,693,775	25/01/2021	Morgan Stanley	34,459	-
CAD	3,060,000	USD	2,346,489	29/01/2021	Bank of America	57,723	0.01
CAD	2,510,000	USD	1,924,169	29/01/2021	Citibank	47,913	0.01
EUR	4,316,066	DKK	32,120,000	29/01/2021	Citibank	579	-
EUR	151,857	DKK	1,130,000	29/01/2021	Goldman Sachs	39	-
MXN	15,990,000	USD	766,539	29/01/2021	Goldman Sachs	34,748	-
CAD	340,000	USD	262,034	10/02/2021	Barclays	5,109	-
CAD	3,630,000	USD	2,800,730	10/02/2021	UBS	51,411	0.01
<b>Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>558,965</b>	<b>0.05</b>
<b>EUR Hedged Share Class</b>							
CHF	16,826	EUR	15,556	15/01/2021	J.P. Morgan	4	-
EUR	14,442,616	CHF	15,554,280	15/01/2021	J.P. Morgan	73,372	0.01
EUR	12,046,750	HKD	113,593,770	15/01/2021	J.P. Morgan	67,683	-
EUR	148,651	JPY	18,741,868	15/01/2021	J.P. Morgan	115	-
EUR	218,697,138	USD	266,011,175	15/01/2021	J.P. Morgan	1,233,687	0.11
GBP	22,979	EUR	25,238	15/01/2021	J.P. Morgan	586	-
HKD	3,768	EUR	396	15/01/2021	J.P. Morgan	2	-
JPY	179,224	EUR	1,415	15/01/2021	J.P. Morgan	7	-
USD	8,805	EUR	7,178	15/01/2021	J.P. Morgan	34	-

## Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Forward Currency Exchange Contracts							
Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
<b>JPY Hedged Share Class</b>							
GBP	403	JPY	55,850	15/01/2021	J.P. Morgan	10	-
JPY	399,353,146	CHF	3,400,915	15/01/2021	J.P. Morgan	25,348	-
JPY	1,595,480,438	EUR	12,619,884	15/01/2021	J.P. Morgan	32,588	-
JPY	323,022,346	HKD	24,089,433	15/01/2021	J.P. Morgan	21,343	-
JPY	6,027,551,277	USD	57,994,225	15/01/2021	J.P. Morgan	388,968	0.04
<b>Unrealised Gain on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>1,843,747</b>	<b>0.16</b>
<b>Total Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>2,402,712</b>	<b>0.21</b>
GBP	205,000	EUR	229,473	06/01/2021	Citibank	(3)	-
USD	500,105	ILS	1,670,000	06/01/2021	Standard Chartered	(19,596)	-
USD	347,975	AUD	460,000	08/01/2021	HSBC	(6,678)	-
USD	1,340,809	CNH	8,760,000	08/01/2021	Goldman Sachs	(6,013)	-
USD	616,764	CZK	13,470,000	08/01/2021	Citibank	(10,418)	-
USD	1,085,841	EUR	890,000	08/01/2021	Citibank	(1,522)	-
USD	265,035	MXN	5,340,000	08/01/2021	Goldman Sachs	(3,214)	-
USD	540,877	MXN	10,870,000	08/01/2021	HSBC	(5,166)	-
USD	577,891	ZAR	8,870,000	08/01/2021	Goldman Sachs	(25,390)	-
ZAR	2,390,000	USD	163,519	08/01/2021	UBS	(967)	-
JPY	56,200,000	USD	545,666	14/01/2021	Citibank	(1,316)	-
USD	992,801	AUD	1,320,000	14/01/2021	Bank of America	(24,980)	-
USD	325,294	AUD	430,000	14/01/2021	HSBC	(6,256)	-
USD	983,363	INR	72,700,000	14/01/2021	HSBC	(10,502)	-
USD	1,515,953	KRW	1,674,370,000	14/01/2021	Citibank	(25,695)	-
EUR	440,000	USD	540,127	25/01/2021	HSBC	(2,327)	-
USD	272,670	GBP	200,000	25/01/2021	Morgan Stanley	(877)	-
USD	4,200,002	CAD	5,570,000	29/01/2021	Citibank	(176,294)	(0.02)
USD	1,504,084	MXN	32,360,000	29/01/2021	Morgan Stanley	(117,531)	(0.01)
USD	409,629	ZAR	6,780,000	29/01/2021	Bank of America	(50,135)	(0.01)
CAD	350,000	USD	275,341	10/02/2021	BNY Mellon	(342)	-
USD	2,714,475	CAD	3,490,000	10/02/2021	Goldman Sachs	(27,667)	(0.01)
<b>Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>(522,889)</b>	<b>(0.05)</b>
<b>EUR Hedged Share Class</b>							
CHF	65	EUR	60	15/01/2021	J.P. Morgan	-	-
EUR	220,213	CHF	238,616	15/01/2021	J.P. Morgan	(523)	-
EUR	23,696,286	GBP	21,605,191	15/01/2021	J.P. Morgan	(591,563)	(0.05)
EUR	114,473	HKD	1,087,665	15/01/2021	J.P. Morgan	(421)	-
EUR	38,722,918	JPY	4,895,095,091	15/01/2021	J.P. Morgan	(95,293)	(0.01)
EUR	2,078,194	USD	2,546,190	15/01/2021	J.P. Morgan	(6,666)	-
HKD	118,525	EUR	12,555	15/01/2021	J.P. Morgan	(53)	-
JPY	5,040,820	EUR	39,988	15/01/2021	J.P. Morgan	(39)	-
USD	277,537	EUR	227,985	15/01/2021	J.P. Morgan	(1,057)	-

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)  
As at 31 December 2020

Forward Currency Exchange Contracts							Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets	
Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty				
<b>JPY Hedged Share Class</b>									
CHF	294	JPY	34,559	15/01/2021	J.P. Morgan	(2)	-		
EUR	1,090	JPY	137,831	15/01/2021	J.P. Morgan	(3)	-		
HKD	2,138	JPY	28,663	15/01/2021	J.P. Morgan	(2)	-		
JPY	1,209,576	CHF	10,375	15/01/2021	J.P. Morgan	(7)	-		
JPY	2,067,476	EUR	16,401	15/01/2021	J.P. Morgan	(16)	-		
JPY	647,340,910	GBP	4,666,351	15/01/2021	J.P. Morgan	(111,703)	(0.01)		
JPY	9,200,901	HKD	690,970	15/01/2021	J.P. Morgan	(13)	-		
JPY	3,642,476	USD	35,336	15/01/2021	J.P. Morgan	(55)	-		
USD	5,004	JPY	520,353	15/01/2021	J.P. Morgan	(36)	-		
<b>Unrealised Loss on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>(807,452)</b>	<b>(0.07)</b>		
<b>Total Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>(1,330,341)</b>	<b>(0.12)</b>		
<b>Net Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>1,072,371</b>	<b>0.09</b>		
<b>Credit Default Swap Contracts</b>									
Nominal Amount	Currency	Counterparty	Reference Entity	Buy/ Sell	Interest(Paid)/ Received Rate	Maturity Date	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
7,500,000	USD	Citigroup	CDX.NA.IG.35-V1	Sell	1.00%	20/12/2025	183,728	183,728	0.02
<b>Total Unrealised Gain on Credit Default Swap Contracts</b>							<b>183,728</b>	<b>183,728</b>	<b>0.02</b>
<b>Net Unrealised Gain on Credit Default Swap Contracts</b>							<b>183,728</b>	<b>183,728</b>	<b>0.02</b>

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  
2020年12月31日現在

(USD)

収益	
債券および転換社債に係る利息（源泉徴収税額控除後）	5,318,293
受取配当金（源泉徴収税額控除後）	9,796,679
その他収益	1,141

銀行預金利息	113,430
スワップ取引	26,272
収益小計	15,255,815
費用	
運用報酬	8,349,778
管理手数料	479,282
年次税	329,061
専門家サービス	315,459
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	173,163
印刷費用	64,379
その他費用	47,097
スワップ取引	20,536
当座貸越利息 *	-
費用小計	9,778,755
費用の払戻し	197,924
投資純利益 / (損失) (a)	5,674,984
実現純利益 / (損失)	
投資有価証券の売却取引	3,936,377
金融先物取引	612,569
為替取引	24,800,862
スワップ取引	-459,772
当期実現純利益 / (損失) (b)	28,890,036
未実現評価利益 / (損失)の増減	
投資有価証券	93,905,428
金融先物取引	21,539
スワップ取引	220,402
為替取引	-218,786
当期末実現評価利益 / (損失)の増減 (c)	93,928,583
当期損益 (a+b+c)	128,493,603
配当金の分配	-358,846
当期投資証券の差引増減額	325,268,896
期首純資産総額	708,146,361
期末純資産総額	1,161,550,014

\*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2020年7月23日から2021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）

（2021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958回国庫短期債券	0	2021/3/22	国債証券	60,000	100.0158	60,009,480
日本	第48回韓国産業銀行円貨債券(2018)	0.23	2021/9/3	特殊債券	100,000	100.031	100,031,000
日本	第6回マラヤン・バンキング・ベルハッド円貨社債(2020)	0.224	2023/2/13	社債券	100,000	99.765	99,765,000
日本	第14回アサヒグループホールディングス(特定社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)	0.12	2025/10/15	社債券	100,000	100.113	100,113,000
日本	第14回セブン&アイ・ホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.19	2025/12/19	社債券	100,000	100.336	100,336,000
日本	第15回Zホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.35	2023/6/9	社債券	100,000	99.945	99,945,000
日本	第18回日立製作所(社債間限定同順位特約付)	0.06	2023/3/10	社債券	100,000	99.871	99,871,000
日本	第46回IHI(社債間限定同順位特約付)	0.22	2023/9/1	社債券	100,000	100.015	100,015,000
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	100.015	100,015,000
日本	第37回丸井グループ(社債間限定同順位特約付)	0.12	2023/12/1	社債券	100,000	99.802	99,802,000
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	101.542	101,542,000
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	99.838	99,838,000
日本	第16回東京センチュリーリース(社債間限定同順位特約付)	0.2	2021/4/14	社債券	100,000	100.024	100,024,000
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	99.991	99,991,000
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	100.055	100,055,000
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	99.955	99,955,000

日本	第5回ソフトバンク(社債間限定同順位特約付)	0.1	2023/7/28	社債券	100,000	99.928	99,928,000
合 計					1,660,000		1,661,235,480

## 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)

2021年6月30日現在

資産総額	17,782,984,337円
負債総額	15,124,593円
純資産総額( - )	17,767,859,744円
発行済口数	11,952,271,179口
1口当たり純資産額( / )	1.4866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)

2021年6月30日現在

資産総額	18,073,662,013円
負債総額	620,001,764円
純資産総額( - )	17,453,660,249円
発行済口数	11,061,156,466口
1口当たり純資産額( / )	1.5779円

(参考)日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

2021年1月22日現在

資産総額	136,250,414円
負債総額	99,942円
純資産総額( - )	136,150,472円
発行済口数	129,286,925口
1口当たり純資産額( / )	1.0531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】

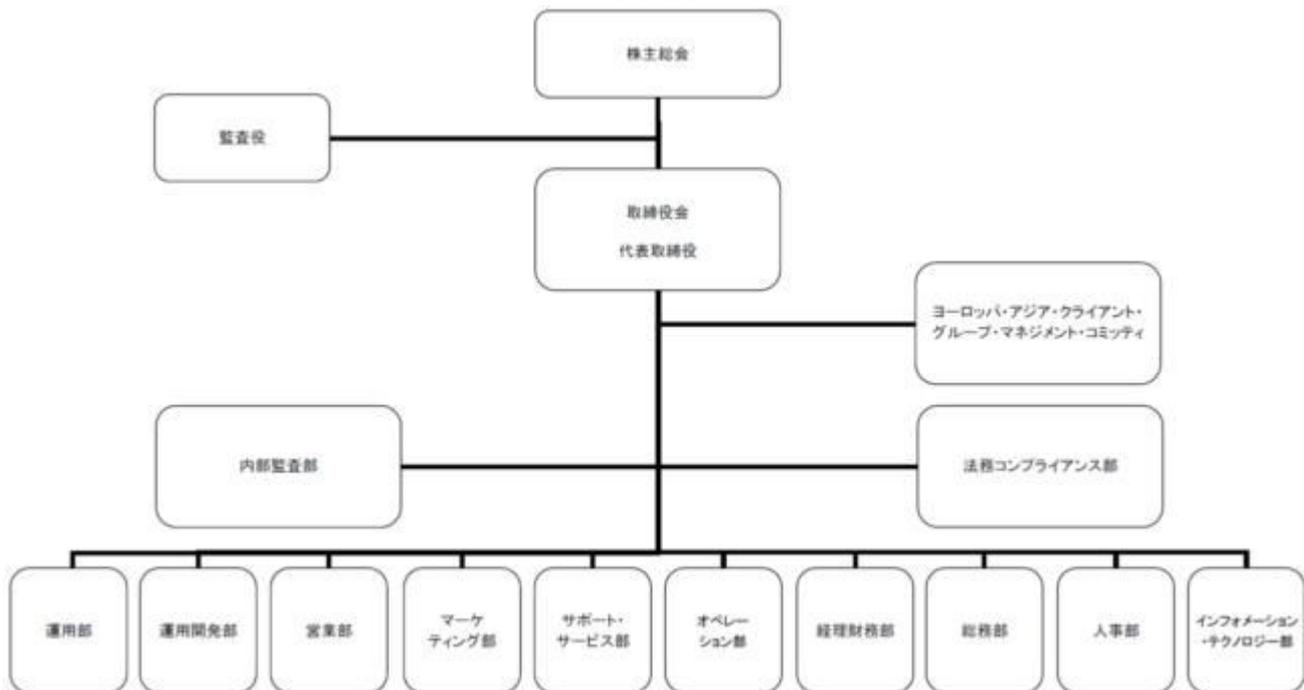
<訂正前>

(1) 資本金の額（2020年12月30日現在）

（中略）

(2) 会社の機構（2020年12月30日現在）

（中略）



（以下略）

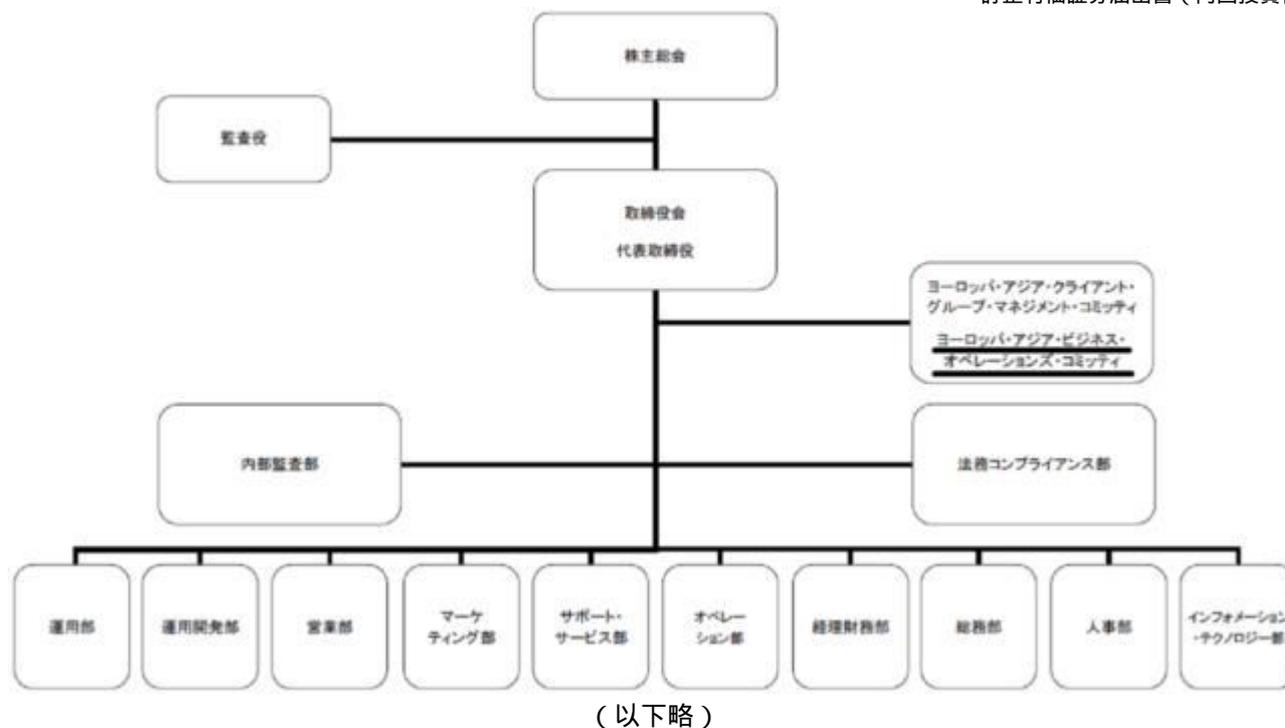
<訂正後>

(1) 資本金の額（2021年6月30日現在）

（中略）

(2) 会社の機構（2021年6月30日現在）

（中略）



## 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2020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	28	412,501
合計	28	412,501

### <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2021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	577,957
合計	29	577,957

## 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】

## &lt; 訂正前 &gt;

## ( 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（2020年9月30日現在）

（中略）

## &lt; 再信託受託会社の概要 &gt;

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9月30日現在）

（以下略）

## &lt; 訂正後 &gt;

## ( 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（2021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（2021年3月31日現在）

（中略）

## &lt; 再信託受託会社の概要 &gt;

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（2021年3月31日現在）

（以下略）

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年7月13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  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 山田信之 印

## 中間監査意見

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2020年11月21日から2021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。

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2021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（2020年11月21日から2021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。

## 中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、キャピタル・インターナショナル株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 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．XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。