

【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】	2024年8月16日提出
【発行者名】	キャピタル・インターナショナル株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 小泉 徹也
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目2番3号 丸の内二重橋ビル
【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(2024年2月16日から2025年2月13日まで) 1兆円を上限とします。
【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、2024年2月15日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、「第二部ファンド情報」及び「第三部委託会社等の情報」における訂正事項を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書を以下の内容に訂正します。下線部_____は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

委託会社の概況（2023年12月29日現在）
（前略）
（以下略）

<訂正後>

委託会社の概況（2024年6月28日現在）
（前略）
（以下略）

2【投資方針】

(2)【投資対象】

<訂正前>

<参考情報2> 投資対象ファンドの概要等
（前略）
上記は、2023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、2023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。
（以下略）

<訂正後>

<参考情報2> 投資対象ファンドの概要等
（前略）
上記は、2024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、2024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。
（以下略）

(3)【運用体制】

<訂正前>

内部管理体制
（前略）
（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（2023年12月29日現在）
運用開発部（6名）/法務コンプライアンス部（2名）/オペレーション部（8名）
（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。
（中略）

上記は2023年12月29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(2024年6月28日現在)

運用開発部(6名)/法務コンプライアンス部(3名)/オペレーション部(10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2024年6月28日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

3【投資リスク】

<訂正前>

(前略)

<リスク管理体制>

(中略)

<参考情報> 投資対象ファンドにおけるリスク管理体制

(中略)

2. 三菱UFJアセットマネジメント株式会社の投資リスクに対する管理体制

三菱UFJアセットマネジメント株式会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行なうとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行ない、ファンド管理委員会およびリスク管理委員会において、それらの状況の報告を行なうほか、必要に応じて改善策を審議しています。

(中略)

上記は2023年12月29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)

<リスク管理体制>

(中略)

<参考情報> 投資対象ファンドにおけるリスク管理体制

(中略)

2. 三菱UFJアセットマネジメント株式会社の投資リスクに対する管理体制

三菱UFJアセットマネジメント株式会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行なうとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行ない、ファンド管理委員会およびリスク管理委員会においてそれらの状況の報告を行なうほか、必要に応じて改善策を検討しています。

(中略)

上記は2024年6月28日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

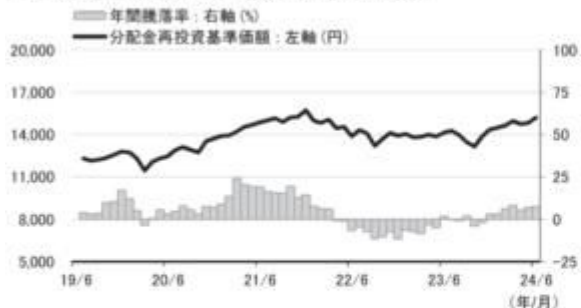
原届出書の第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 3投資リスク リスクの定量的比較につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

リスクの定量的比較

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

キャピタル・グローバル・アロケーション・ファンドF(設定為替ヘッジ)



(注1) 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、2019年7月から2024年6月までの各月末における当該基準価額を表示しています。
 (注2) 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。
 (注3) 年間騰落率は、2019年7月から2024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。

<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JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」)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JPXが有しています。なお、ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、JPX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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRIC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRICに帰属します。なお、NFRIC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】

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

(前略)

<投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担>

(中略)

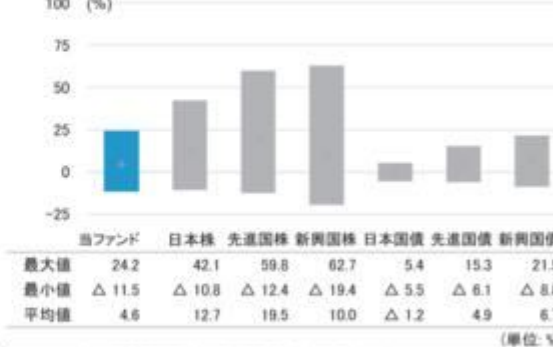
(*1) キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)の投資顧問会社への報酬は、委託会社が支払います。このため、当該ファンドに信託報酬はかかりませんが、後記「(4)その他の手数料等」に表示するファンド管理費用(上限年率0.15%)が別途かかります。

(以下略)

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較

平均値

(%)



(単位:%)

(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) ファンドの騰落率および代表的な資産クラスの騰落率は、2019年7月から2024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。

<訂正後>

(前略)

<投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担>

(中略)

(* 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 (L U X) (クラスCh-JPY) の投資顧問会社への報酬は、委託会社が支払います。このため、当該ファンドに信託報酬はかかりませんが、後記「(4) その他の手数料等」に表示するファンド管理費用が別途かかります。なお、当該ファンド管理費用の総経費率は、後記「(5) 課税上の取扱い」の(参考情報) ファンドの総経費率に表示する「投資先ファンドの運用管理費用以外」の比率でご覧いただけます。

(以下略)

(4) 【その他の手数料等】

<訂正前>

(前略)

上記4 . . に定める費用は、外国の法律により設定された投資対象ファンドについては、当該投資対象ファンド設定国における慣行等に鑑みて著しく異なる範囲の額とします。ただし、当該費用は当該投資対象ファンドの合計純資産額に対して年率10,000分の15を超えないものとします。

(以下略)

<訂正後>

(前略)

上記4 . . に定める費用は、外国の法律により設定された投資対象ファンドについては、当該投資対象ファンド設定国における慣行等に鑑みて著しく異なる範囲の額で、契約先との適正な価格設定により、当該ファンドから適切な費用の支払いを受けることができるものとします。

(以下略)

(5) 【課税上の取扱い】

<訂正前>

課税上は、株式投資信託として取扱われ、個人受益者、法人受益者毎に以下の取扱いとなります。以下の取扱内容は、2023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注意ください。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。

(中略)

(注) 税法等が改正された場合には、上記の内容が変更になることがあります。

<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、2024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注意ください。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。

(中略)

(注) 税法等が改正された場合には、上記の内容が変更になることがあります。

(参考情報) ファンドの総経費率

対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除きます。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）、その内訳は下記のとおりです。

総経費率 (+ + +)	当ファンドの運用管理費用	当ファンドの その他費用	投資先ファンド の運用管理費用	投資先ファンドの 運用管理費用以外
	0.61%			

0.71%	委託会社 0.58%	販売会社 0.01%	受託会社 0.02%	0.00%	0.00%	0.10%
-------	---------------	---------------	---------------	-------	-------	-------

- ・上記の対象期間は、2022年11月22日から2023年11月20日までのものです。
- ・上記値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。
- ・投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- ・当ファンドの費用には、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。また、当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なります。
- ・投資先ファンドの運用管理費用以外の費用には、外国ファンドにおけるカストディーフィー等のファンド管理費用が含まれています。

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）

2024年6月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	35,678,390,712	99.55
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		159,495,810	0.44
合計（純資産総額）		35,837,886,522	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）

2024年6月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	4,790,439	0.01
投資証券	ルクセンブルク	35,622,078,477	99.84
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		51,381,831	0.14
合計（純資産総額）		35,678,250,747	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）

2024年6月28日現在

資産の種類	国/地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	米国	71,174,303,078	32.85
	カナダ	13,307,365,550	6.14
	英国	9,927,999,641	4.58
	台湾	8,961,386,240	4.14
	オランダ	7,890,289,542	3.64
	日本	6,799,935,000	3.14
	スイス	6,255,425,846	2.89
	フランス	4,366,960,716	2.02

	インド	2,794,563,631	1.29
	ドイツ	2,547,973,142	1.18
	ブラジル	1,660,099,430	0.77
	デンマーク	1,405,685,362	0.65
	スペイン	891,746,525	0.41
	香港	657,520,939	0.30
債券	米国	40,155,531,961	18.54
	ドイツ	3,816,727,262	1.76
	日本	2,773,334,811	1.28
	中国	2,702,730,222	1.25
	メキシコ	2,296,183,887	1.06
	英国	1,717,906,537	0.79
	イタリア	1,615,252,579	0.75
	ブラジル	1,379,486,770	0.64
	フランス	1,166,759,082	0.54
	韓国	913,031,117	0.42
	スプラ ナショナル	846,871,922	0.39
	スペイン	803,947,961	0.37
	カナダ	680,484,490	0.31
	インドネシア	494,245,084	0.23
	オーストラリア	474,012,001	0.22
	デンマーク	390,558,234	0.18
	エジプト	370,914,265	0.17
	コロンビア	347,249,497	0.16
	パナマ	317,361,795	0.15
	イスラエル	310,183,714	0.14
	ギリシャ	306,997,348	0.14
	ノルウェー	285,317,177	0.13
	オーストリア	180,306,254	0.08
	アイルランド	157,186,816	0.07
	香港	155,340,074	0.07
	スイス	134,461,030	0.06
	ベルギー	130,521,576	0.06
	ポルトガル	122,812,817	0.06
	オランダ	119,383,300	0.06
	トルコ	113,669,423	0.05
	ドミニカ共和国	95,771,591	0.04
	タイ	82,262,975	0.04
	マレーシア	79,972,787	0.04
	ルーマニア	66,943,068	0.03
	ウクライナ	64,057,285	0.03
	ブルガリア	62,813,837	0.03
	エストニア	58,722,528	0.03
	南アフリカ	47,898,939	0.02
	チリ	40,054,116	0.02
	ポーランド	39,582,047	0.02
シンガポール	31,802,549	0.01	
フィリピン	29,983,277	0.01	

ハンガリー	18,122,008	0.01
銀行預金、その他資産（負債控除後）	12,006,099,010	5.54
合計	216,644,109,666	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

2024年1月24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	11,093,929,000	54.95
地方債	日本	99,919,000	0.49
特殊債券	日本	700,085,000	3.47
社債券	日本	7,792,355,850	38.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		503,971,673	2.50
合計(純資産総額)		20,190,260,523	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（2024年1月24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

2024年6月28日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	キャピタル・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)	21,642,942,501	1.5200	32,898,987,764	1.6485	35,678,390,712	99.55

（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

2024年6月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.55
合計	99.55

（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

2024年6月28日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	ルクセンブルク	投資証券	キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)	12,275,009.813	2,676.52	32,854,334,773	2,902	35,622,078,477	99.84
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	1.0482	4,800,514	1.046	4,790,439	0.01

(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

2024年6月28日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	0.01
投資証券	99.84
合計	99.85

(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

2024年6月28日現在

順位	銘柄	利率 (%) (上段) 償還日 (下段)	国/地域 (上段) 資産 (中段) 業種/種類 (下段)	数量	評価単価 (上段) 通貨 (下段)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	BROADCOM INC.		米国 株式 情報技術	45,330	1586.66 米ドル	11,566,345,136	5.34
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO., LTD.		台湾 株式 情報技術	1,890,000	960 台湾ドル	8,961,386,240	4.14
3	UNITED STATES TREASURY NOTE 4.5% 11-15-33	4.5 2033/11/15	米国 債券 国債・政府機関債等	48,940,000	101.5485 米ドル	7,992,160,629	3.69
4	UNITED STATES TREASURY NOTE 4.125% 08-15-53	4.125 2053/8/15	米国 債券 国債・政府機関債等	39,735,000	94.875 米ドル	6,062,494,788	2.80
5	ASTRAZENECA PLC		英国 株式 ヘルスケア	236,797	123.28 英ポンド	5,932,991,527	2.74
6	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.		米国 株式 生活必需品	324,789	101.57 米ドル	5,305,096,884	2.45
7	JPMORGAN CHASE & CO.		米国 株式 金融	149,721	199.17 米ドル	4,795,492,295	2.21
8	CONSTELLATION SOFTWARE INC.		カナダ 株式 情報技術	9,638	3927.5 カナダ・ドル	4,445,120,007	2.05
9	VISA INC.		米国 株式 金融	94,195	266.59 米ドル	4,038,297,036	1.86
10	MICROSOFT CORP.		米国 株式 情報技術	53,960	452.85 米ドル	3,929,640,926	1.81
11	UNITED STATES TREASURY NOTE 3.75% 12-31-28	3.75 2028/12/31	米国 債券 国債・政府機関債等	23,500,000	97.6094 米ドル	3,688,806,569	1.70
12	UNITEDHEALTH GROUP INC.		米国 株式 ヘルスケア	42,796	486.44 米ドル	3,347,796,213	1.55

13	BROOKFIELD CORP.		カナダ 株式 金融	471,522	56.95 カナダ・ドル	3,153,378,220	1.46
14	ALPHABET INC.		米国 株式 コミュニケーション・サービス	100,226	186.86 米ドル	3,011,780,365	1.39
15	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE EUR REG S (B) 2.6% 08-15-33	2.6 2033/8/15	ドイツ 債券 国債・政府機関債等	16,160,000	101.4335 ユーロ	2,821,468,064	1.30
16	HDFC BANK LTD.		インド 株式 金融	855,057	1696.15 インド・ルピー	2,794,563,631	1.29
17	NESTLE SA		スイス 株式 生活必需品	168,360	92.14 スイス・フラン	2,775,405,580	1.28
18	TOKYO ELECTRON LTD.	--	日本株式情報技術	76,300	34800日本円	2,655,240,000	1.23
19	CANADIAN NATURAL RESOURCES, LTD.		カナダ 株式 エネルギー	461,649	48.83 カナダ・ドル	2,647,152,725	1.22
20	UNITED STATES TREASURY NOTE 4.25% 12-31-25	4.25 2025/12/31	米国 債券 国債・政府機関債等	16,310,000	99.0558 米ドル	2,598,128,216	1.20
21	COSTCO WHOLESALE CORP.		米国 株式 生活必需品	18,412	850.62 米ドル	2,518,622,687	1.16
22	mitsui & CO., LTD.		日本 株式 資本財・サービス	693,000	3628 日本円	2,514,204,001	1.16
23	HOME DEPOT, INC.		米国 株式 一般消費財・サービス	42,947	341.49 米ドル	2,358,508,131	1.09
24	MOTOROLA SOLUTIONS, INC.		米国 株式 情報技術	36,576	386.4 米ドル	2,272,792,992	1.05
25	WOLTERS KLUWER NV		オランダ 株式 資本財・サービス	83,189	155.35 ユーロ	2,224,485,261	1.03
26	FNCL 6.0 UMBS TBA 08- 01-54	6.0 2054/8/1	米国 債券 その他債券	13,144,462	100.483 米ドル	2,124,036,862	0.98
27	BAE SYSTEMS PLC		英国 株式 資本財・サービス	720,766	13.23 英ポンド	1,938,023,517	0.89
28	DANAHER CORP.		米国 株式 ヘルスケア	43,953	251.76 米ドル	1,779,515,635	0.82
29	AON PLC		米国 株式 金融	37,178	292.8 米ドル	1,750,586,804	0.81
30	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		オランダ 株式 コミュニケーション・サービス	348,262	28.39 ユーロ	1,701,860,088	0.79

(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
2024年1月24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449回利付国債(2年)	0.005	2025/6/1	国債	1,100,000	100.006	1,100,066,000	5.45
日本	第452回利付国債(2年)	0.005	2025/9/1	国債	200,000	99.976	199,952,000	0.99
日本	第452回利付国債(2年)	0.005	2025/9/1	国債	500,000	99.976	499,880,000	2.48
日本	第452回利付国債(2年)	0.005	2025/9/1	国債	1,000,000	99.976	999,760,000	4.95
日本	第452回利付国債(2年)	0.005	2025/9/1	国債	1,000,000	99.976	999,760,000	4.95
日本	第453回利付国債(2年)	0.005	2025/10/1	国債	500,000	99.957	499,785,000	2.48
日本	第453回利付国債(2年)	0.005	2025/10/1	国債	1,500,000	99.957	1,499,355,000	7.43
日本	第454回利付国債(2年)	0.100	2025/11/1	国債	400,000	100.123	400,492,000	1.98
日本	第455回利付国債(2年)	0.005	2025/12/1	国債	900,000	99.926	899,334,000	4.45
日本	第455回利付国債(2年)	0.005	2025/12/1	国債	500,000	99.926	499,630,000	2.47
日本	第456回利付国債(2年)	0.100	2026/1/1	国債	1,500,000	100.067	1,501,005,000	7.43
日本	第150回利付国債(5年)	0.005	2026/12/20	国債	1,000,000	99.811	998,110,000	4.94
日本	第151回利付国債(5年)	0.005	2027/3/20	国債	500,000	99.733	498,665,000	2.47
日本	第153回利付国債(5年)	0.005	2027/6/20	国債	500,000	99.627	498,135,000	2.47
日本	第81回神奈川県公募公債(5年)	0.020	2025/3/19	地方債	100,000	99.919	99,919,000	0.49
日本	第287回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.091	2026/9/11	特殊債	200,000	99.687	199,374,000	0.99
日本	第68回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.355	2025/1/28	特殊債	100,000	100.245	100,245,000	0.50
日本	第72回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.529	2025/5/28	特殊債	200,000	100.514	201,028,000	1.00
日本	第99回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.225	2027/8/27	特殊債	200,000	99.719	199,438,000	0.99
日本	第35回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2021)	0.279	2026/10/21	社債	100,000	98.314	98,314,000	0.49
日本	第6回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー(非上位円貨社債)(2019)	1.258	2024/1/25	社債	100,000	99.997	99,997,000	0.50
日本	第15回クレディ・アグリコル・エス・エー期限前償還条項付非上位円貨社債(2024)	0.000	2028/1/26	社債	200,000	100.001	200,002,000	0.99
日本	第12回ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー期限前償還条項付円貨社債(2023)	1.377	2027/12/1	社債	200,000	99.9	199,800,000	0.99
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	200,000	99.742	199,484,000	0.99
日本	第24回ルノー円貨社債(2021)	1.540	2024/7/5	社債	200,000	100.327	200,654,000	0.99

日本	第508回関西電力(一般担保付)	0.455	2027/4/23	社債券	105,000	99.977	104,975,850	0.52
日本	第509回関西電力(一般担保付)	0.470	2027/5/25	社債券	100,000	100.003	100,003,000	0.50
日本	第477回東北電力(一般担保付)	0.741	2025/2/25	社債券	100,000	100.55	100,550,000	0.50
日本	第483回東北電力(一般担保付)	0.300	2026/5/25	社債券	200,000	99.849	199,698,000	0.99
日本	第503回九州電力(一般担保付)	0.360	2027/4/23	社債券	200,000	99.737	199,474,000	0.99
日本	第18回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)	0.340	2025/4/30	社債券	100,000	100.163	100,163,000	0.50
日本	第22回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)	0.130	2025/9/12	社債券	200,000	99.821	199,642,000	0.99
日本	第29回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)	0.210	2025/10/27	社債券	100,000	99.979	99,979,000	0.50
日本	第12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)	0.330	2027/6/11	社債券	200,000	99.656	199,312,000	0.99
日本	第12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)	0.330	2027/6/11	社債券	200,000	99.656	199,312,000	0.99
日本	第14回森ビル(社債間限定同順位特約付)	0.861	2024/8/14	社債券	100,000	100.345	100,345,000	0.50
日本	第12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)	0.781	2025/6/20	社債券	100,000	100.754	100,754,000	0.50
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)	0.190	2025/12/19	社債券	100,000	99.774	99,774,000	0.49
日本	第15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)	0.280	2027/12/20	社債券	200,000	99.184	198,368,000	0.98
日本	第63回神戸製鋼所(社債間限定同順位特約付)	0.924	2025/5/21	社債券	100,000	100.654	100,654,000	0.50
日本	第67回神戸製鋼所(社債間限定同順位特約付)	0.200	2026/6/10	社債券	100,000	99.245	99,245,000	0.49
日本	第19回日立製作所(社債間限定同順位特約付)	0.160	2027/3/12	社債券	200,000	99.183	198,366,000	0.98
日本	第18回デンソー(社債間限定同順位特約付)	0.315	2028/3/17	社債券	200,000	99.27	198,540,000	0.98
日本	第43回IHI(社債間限定同順位特約付)	0.200	2024/10/17	社債券	100,000	99.875	99,875,000	0.49
日本	第49回IHI(社債間限定同順位特約付)(トランジション・ボンド)	0.390	2027/6/4	社債券	100,000	99.166	99,166,000	0.49
日本	第8回J A三井リース(社債間限定同順位特約付)	0.310	2024/9/13	社債券	100,000	100.062	100,062,000	0.50
日本	第25回J A三井リース(社債間限定同順位特約付)	0.390	2026/9/1	社債券	100,000	99.808	99,808,000	0.49
日本	第27回J A三井リース(社債間限定同順位特約付)	0.430	2027/1/25	社債券	100,000	99.822	99,822,000	0.49
日本	第78回伊藤忠商事(社債間限定同順位特約付)	0.785	2024/5/30	社債券	100,000	100.245	100,245,000	0.50
日本	第19回三井住友信託銀行(社債間限定同順位特約付)	0.140	2026/4/28	社債券	200,000	99.385	198,770,000	0.98
日本	第2回NTTファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.260	2026/12/18	社債券	200,000	99.588	199,176,000	0.99
日本	第16回NTTファイナンス(日本電信電話株式会社保証付)	0.180	2025/12/19	社債券	200,000	99.661	199,322,000	0.99
日本	第80回ホンダファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.260	2026/6/19	社債券	100,000	99.758	99,758,000	0.49

日本	第81回ホンダファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.389	2028/6/20	社債券	200,000	99.238	198,476,000	0.98
日本	第18回SBIホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.690	2024/5/30	社債券	100,000	100.011	100,011,000	0.50
日本	第25回SBIホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.600	2024/7/26	社債券	100,000	99.925	99,925,000	0.49
日本	第29回SBIホールディングス(社債間限定同順位特約付)	1.000	2025/7/22	社債券	100,000	99.995	99,995,000	0.50
日本	第96回トヨタファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.060	2026/4/15	社債券	100,000	99.436	99,436,000	0.49
日本	第100回トヨタファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.370	2026/10/13	社債券	100,000	100.131	100,131,000	0.50
日本	第42回リコーリース(社債間限定同順位特約付)	0.390	2027/6/1	社債券	100,000	99.463	99,463,000	0.49
日本	第17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)	0.340	2026/7/31	社債券	200,000	99.371	198,742,000	0.98
日本	第20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)	0.590	2026/2/24	社債券	100,000	100.026	100,026,000	0.50
日本	第69回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	1.210	2024/9/26	社債券	100,000	100.62	100,620,000	0.50
日本	第79回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.290	2025/2/28	社債券	100,000	99.939	99,939,000	0.49
日本	第80回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.280	2026/2/26	社債券	100,000	99.55	99,550,000	0.49
日本	第84回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.550	2026/12/18	社債券	100,000	99.903	99,903,000	0.49
日本	第57回日立キャピタル(社債間限定同順位特約付)	0.616	2024/12/20	社債券	100,000	100.339	100,339,000	0.50
日本	第219回オリックス(社債間限定同順位特約付)	0.430	2026/11/27	社債券	100,000	99.977	99,977,000	0.50
日本	第1回三井住友ファイナンス&リース(社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)	0.170	2025/3/12	社債券	100,000	99.869	99,869,000	0.49
日本	第35回三井住友ファイナンス&リース(社債間限定同順位特約付)	0.709	2028/2/2	社債券	100,000	100.276	100,276,000	0.50
日本	第32回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付)	0.695	2024/10/25	社債券	100,000	100.36	100,360,000	0.50
日本	第75回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付)	0.220	2025/1/23	社債券	100,000	99.947	99,947,000	0.50
日本	第18回大和証券グループ本社(社債間限定同順位特約付)	0.871	2024/8/28	社債券	100,000	100.335	100,335,000	0.50
日本	第40回大和証券グループ本社(社債間限定同順位特約付)	0.575	2026/11/27	社債券	100,000	100.047	100,047,000	0.50
日本	第3回野村ホールディングス(担保提供制限等財務上特約無)	0.280	2026/9/4	社債券	100,000	98.948	98,948,000	0.49
日本	第27回野村ホールディングス	2.107	2025/9/24	社債券	100,000	102.451	102,451,000	0.51
日本	第37回イオンモール(社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)	1.107	2028/12/14	社債券	100,000	100.406	100,406,000	0.50
日本	第184回東日本旅客鉄道(社債間限定同順位特約付)	0.210	2025/10/14	社債券	100,000	99.922	99,922,000	0.49
日本	第184回東日本旅客鉄道(社債間限定同順位特約付)	0.210	2025/10/14	社債券	100,000	99.922	99,922,000	0.49
日本	第6回ファーストリテイリング(特定社債間限定同順位特約付)	0.220	2025/6/6	社債券	100,000	99.93	99,930,000	0.49

(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(2024年1月24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
第6期 (2021年11月22日)	36,427,720,340	36,427,720,340	1.5405	1.5405
第7期 (2022年11月21日)	48,984,925,068	48,984,925,068	1.4057	1.4057
第8期 (2023年11月20日)	38,578,276,366	38,578,276,366	1.3837	1.3837
2023年 6月末日	51,322,766,252		1.4139	
7月末日	52,943,115,853		1.4277	
8月末日	53,051,492,545		1.3969	
9月末日	36,447,692,611		1.3460	
10月末日	36,339,492,886		1.3170	
11月末日	38,830,621,100		1.3892	
12月末日	40,994,236,682		1.4362	
2024年 1月末日	26,743,939,913		1.4495	
2月末日	28,481,501,762		1.4665	
3月末日	30,478,394,738		1.4980	
4月末日	31,210,103,709		1.4763	
5月末日	33,303,611,184		1.4841	
6月末日	35,837,886,522		1.5214	

(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
第6期	2020年11月21日～2021年11月22日	0
第7期	2021年11月23日～2022年11月21日	0
第8期	2022年11月22日～2023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期	2020年11月21日～2021年11月22日	15.0
第7期	2021年11月23日～2022年11月21日	8.8
第8期	2022年11月22日～2023年11月20日	1.6
第9中間計算期間末	2023年11月21日～2024年5月20日	9.5

(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期	2020年11月21日～2021年11月22日	17,330,058,561	1,930,893,865	23,647,097,831
第7期	2021年11月23日～2022年11月21日	13,630,861,227	2,430,492,916	34,847,466,142
第8期	2022年11月22日～2023年11月20日	7,516,064,748	14,482,381,931	27,881,148,959

第9中間計算期間末	2023年11月21日～2024年 5月20日	5,568,330,216	11,769,627,923	21,679,851,252
-----------	-------------------------	---------------	----------------	----------------

(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。

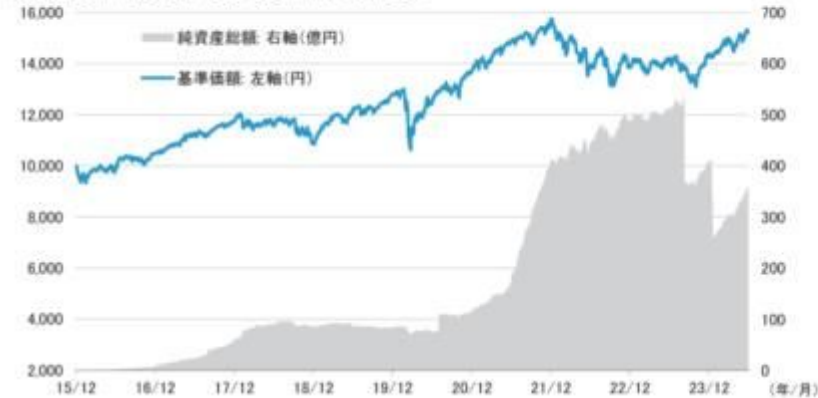
(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

参考情報

2024年6月28日現在

基準価額・純資産の推移(設定～2024年6月28日)

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)



分配金の推移

第8期	2023年11月	0円
第7期	2022年11月	0円
第6期	2021年11月	0円
第5期	2020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1万口当たり、税引前

主要な資産の状況(2024年6月28日現在)

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)

<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C-JPY)	99.84
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.01

<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>

(2024年6月28日現在)

上位10銘柄

順位	銘柄名	国名/地域名	業種/証券種別	投資比率(%)
1	BROADCOM INC.	米国	情報技術	5.34
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO., LTD.	台湾	情報技術	4.14
3	UNITED STATES TREASURY NOTE 4.5% 11-15-33	米国	国債・政府機関債等	3.69
4	UNITED STATES TREASURY NOTE 4.125% 08-15-53	米国	国債・政府機関債等	2.80
5	ASTRAZENECA PLC	英国	ヘルスケア	2.74
6	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	米国	生活必需品	2.45
7	JPMORGAN CHASE & CO.	米国	金融	2.21
8	CONSTELLATION SOFTWARE INC.	カナダ	情報技術	2.05
9	VISA INC.	米国	金融	1.86
10	MICROSOFT CORP.	米国	情報技術	1.81

資産別構成比率

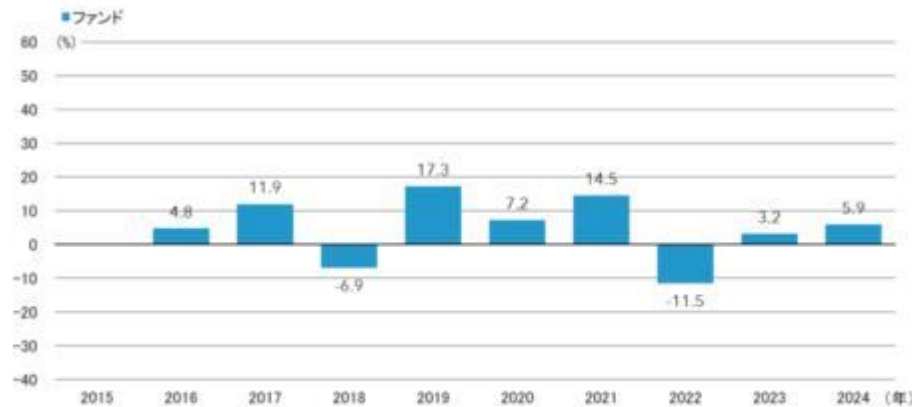
資産	証券種別	投資比率(%)
株式		63.99
債券		30.46
	国債・政府機関債等	20.84
	社債	4.71
	その他債券	4.91
現金・その他		5.54

国別構成比率

国名	投資比率(%)		
	株式	債券	合計
米国	32.85	18.54	51.39
カナダ	6.14	0.31	6.46
英国	4.58	0.79	5.38
日本	3.14	1.28	4.42
台湾	4.14	-	4.14
その他国	13.14	9.54	22.68
現金・その他			5.54

年間収益率の推移

キャピタル・グローバル・アロケーション・ファンドF(鑑定為替ヘッジ)



ファンドにはベンチマークはありません。

ファンドの年間収益率は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

2024年は年初から6月末までの収益率を表示。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

(前略)

(2) 取得の申込みの受付は、申込不可日(*1)を除く販売会社の営業日(*2)に行なわれます。

(中略)

(*2) 原則として、午後3時までに取得の申込みが行なわれ、かつ当該申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを、当日の受付分とします。この受付時間を過ぎてからの取得の受付は、特に指定がない場合、翌営業日の取扱いとなります。

(以下略)

<訂正後>

(前略)

(2) 取得の申込みの受付は、申込不可日(*1)を除く販売会社の営業日(*2)に行なわれます。

(中略)

(*2) 原則として、午後3時までに取得の申込みが行なわれ、かつ当該申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを、当日の受付分とします(2024年11月5日からは、原則として午後3時30分までに取得の申込みが行なわれ、かつ当該申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを、当日の受付分とします。)。この受付時間を過ぎてからの取得の受付は、特に指定がない場合、翌営業日の取扱いとなります。

(以下略)

2【換金（解約）手続等】

<訂正前>

(前略)

(2) 換金の申込みの受付は、申込不可日(*1)を除く販売会社の営業日(*2)に行なわれます。

(中略)

(*2) 原則として、午後3時までに換金の申込みが行なわれ、かつ当該換金の受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを、当日の受付分とします。この受付時間を過ぎてからの換金の受付は、特に指定がない場合、翌営業日の取扱いとなります。

(以下略)

<訂正後>

(前略)

(2) 換金の申込みの受付は、申込不可日(*1)を除く販売会社の営業日(*2)に行なわれます。

(中略)

(*2) 原則として、午後3時までに換金の申込みが行なわれ、かつ当該換金の受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを、当日の受付分とします(2024年11月5日からは、原則として午後3時30分までに換金の申込みが行なわれ、かつ当該申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを、当日の受付分とします。)。この受付時間を過ぎてからの換金の受付

は、特に指定がない場合、翌営業日の取扱いとなります。
(以下略)

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9期中間計算期間（2023年11月21日から2024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8期 2023年11月20日現在	第9期中間計算期間 2024年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	266,261,026	220,262,532
親投資信託受益証券	38,530,993,331	32,744,427,927
未収利息	-	60
流動資産合計	38,797,254,357	32,964,690,519
資産合計	38,797,254,357	32,964,690,519
負債の部		
流動負債		
未払解約金	67,838,359	30,635,381
未払受託者報酬	5,032,744	3,548,319
未払委託者報酬	145,300,791	94,917,526
未払利息	729	-
その他未払費用	805,368	871,780
流動負債合計	218,977,991	129,973,006
負債合計	218,977,991	129,973,006
純資産の部		
元本等		
元本	27,881,148,959	21,679,851,252
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,697,127,407	11,154,866,261
元本等合計	38,578,276,366	32,834,717,513
純資産合計	38,578,276,366	32,834,717,513
負債純資産合計	38,797,254,357	32,964,690,519

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	(単位：円)	
	第8期中間計算期間 自 2022年11月22日 至 2023年5月21日	第9期中間計算期間 自 2023年11月21日 至 2024年5月20日
営業収益		
受取利息	-	2,114
有価証券売買等損益	240,627,633	3,133,434,596
営業収益合計	240,627,633	3,133,436,710

	第8期中間計算期間 自 2022年11月22日 至 2023年5月21日	第9期中間計算期間 自 2023年11月21日 至 2024年5月20日
営業費用		
支払利息	77,695	121,627
受託者報酬	5,419,593	3,548,319
委託者報酬	165,297,449	94,917,526
その他費用	1,078,085	871,780
営業費用合計	171,872,822	99,459,252
営業利益又は営業損失（ ）	412,500,455	3,033,977,458
経常利益又は経常損失（ ）	412,500,455	3,033,977,458
中間純利益又は中間純損失（ ）	412,500,455	3,033,977,458
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（ ）	8,381,455	579,640,505
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	14,137,458,926	10,697,127,407
剰余金増加額又は欠損金減少額	908,309,810	2,540,243,491
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	908,309,810	2,540,243,491
剰余金減少額又は欠損金増加額	496,206,493	4,536,841,590
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	496,206,493	4,536,841,590
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（ ）	14,145,443,243	11,154,866,261

(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8期 2023年11月20日現在	第9期中間計算期間 2024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 27,881,148,959口	1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数 21,679,851,252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 1.3837円 (1万口当たり純資産額) (13,837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 1.5145円 (1万口当たり純資産額) (15,145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8期 自 2022年11月22日 至 2023年11月20日	第9期中間計算期間 自 2023年11月21日 至 2024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	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
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8期	第9期中間計算期間
	自 2022年11月22日 至 2023年11月20日	自 2023年11月21日 至 2024年5月20日
期首元本額	34,847,466,142円	27,881,148,959円
期中追加設定元本額	7,516,064,748円	5,568,330,216円
期中一部解約元本額	14,482,381,931円	11,769,627,923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）

2024年5月20日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	197,379,233
投資信託受益証券	4,788,607
投資証券	32,691,907,793
未収利息	54
流動資産合計	32,894,075,687
資産合計	32,894,075,687
負債の部	
流動負債	
未払金	150,000,000
流動負債合計	150,000,000
負債合計	150,000,000
純資産の部	
元本等	
元本	19,966,114,590
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,777,961,097
元本等合計	32,744,075,687
純資産合計	32,744,075,687
負債純資産合計	32,894,075,687

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	2024年5月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数		19,966,114,590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	1.6400円

項目	2024年5月20日現在
	(1万口当たり純資産額) (16,400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 2023年11月21日 至 2024年5月20日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 投資信託受益証券 「(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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	2024年5月20日現在
同計算期間の期首元本額	25,809,493,825円
同計算期間の追加設定元本額	4,201,131,556円
同計算期間の一部解約元本額	10,044,510,791円
計算日の元本額	19,966,114,590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）	19,966,114,590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）」（ルクセンブルク籍外国投資法人（以下、当外国投資法人と申します。）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、2023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ブライズウォータハウスクラス・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 2023

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>Australia</i>				
Australia Government Bond, Reg. S 2.75% 21/11/2028	AUD	790,000	517,182	0.04
Australia Government Bond, Reg. S 1.5% 21/06/2031	AUD	2,460,000	1,423,982	0.11
Australia Government Bond, Reg. S 1% 21/11/2031	AUD	2,220,000	1,220,371	0.10
Australia Government Bond, Reg. S 3% 21/11/2033	AUD	3,245,000	2,039,822	0.16
			<u>5,201,357</u>	<u>0.41</u>
<i>Austria</i>				
Austria Government Bond, Reg. S, 144A 0% 20/02/2031	EUR	1,310,000	1,217,516	0.10
			<u>1,217,516</u>	<u>0.10</u>
<i>Belgium</i>				
Belgium Government Bond, Reg. S, 144A 3% 22/06/2033	EUR	760,000	866,979	0.07
			<u>866,979</u>	<u>0.07</u>
<i>Brazil</i>				
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2031	BRL	13,285,000	2,702,826	0.22
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2025	BRL	3,173,000	653,818	0.05
			<u>3,356,644</u>	<u>0.27</u>
<i>Bulgaria</i>				
Bulgaria Government Bond, Reg. S 4.5% 27/01/2033	EUR	350,000	406,688	0.03
			<u>406,688</u>	<u>0.03</u>
<i>Canada</i>				
Canada Government Bond 0.25% 01/03/2026	CAD	2,239,000	1,572,124	0.12
Canada Government Bond 1% 01/06/2027	CAD	1,870,000	1,309,529	0.10
Canada Government Bond 3.5% 01/03/2028	CAD	1,139,000	868,599	0.07
Canada Government Bond 0.5% 01/12/2030	CAD	730,000	462,918	0.04
Canadian Pacific Railway Co. 3.1% 02/12/2051	USD	130,000	94,041	0.01
Cenovus Energy, Inc. 4.25% 15/04/2027	USD	70,000	68,469	0.01
Royal Bank of Canada 5% 01/02/2033	USD	254,000	258,431	0.02
			<u>4,634,111</u>	<u>0.37</u>
<i>Chile</i>				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, Reg. S, 144A 5.8% 01/06/2024	CLP	495,000,000	559,662	0.05
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, Reg. S, 144A 4.7% 01/09/2030	CLP	255,000,000	279,024	0.02
			<u>838,686</u>	<u>0.07</u>
<i>China</i>				
China Development Bank 2.89% 22/06/2025	CNY	8,520,000	1,211,263	0.10
China Development Bank 3.68% 26/02/2026	CNY	1,320,000	191,682	0.01
China Development Bank 3.43% 14/01/2027	CNY	1,490,000	216,612	0.02
China Development Bank 4.88% 09/02/2028	CNY	1,180,000	181,549	0.01
China Government Bond 2.64% 15/01/2028	CNY	28,760,000	4,094,470	0.32

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
China Government Bond 3.29% 23/05/2029	CNY	15,420,000	2,273,968	0.18
China Government Bond 2.62% 25/06/2030	CNY	4,630,000	656,327	0.05
China Government Bond 2.88% 25/02/2033	CNY	20,630,000	2,980,057	0.24
China Government Bond 3.39% 16/03/2050	CNY	4,770,000	732,752	0.06
China Government Bond 3.81% 14/09/2050	CNY	5,380,000	887,007	0.07
China Government Bond 3.12% 25/10/2052	CNY	19,530,000	2,872,328	0.23
China Government Bond, Reg. S 0.125% 12/11/2026	EUR	200,000	203,014	0.02
			16,501,029	1.31
<i>Colombia</i>				
Colombia Titulos De Tesoreria 5.75% 03/11/2027	COP	3,931,200,000	899,278	0.07
Colombia Titulos De Tesoreria 7% 26/03/2031	COP	271,300,000	60,433	0.01
			959,711	0.08
<i>Denmark</i>				
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 0.5% 01/10/2043	DKK	6,827,428	819,469	0.06
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 0.5% 01/10/2050	DKK	722,049	79,264	0.01
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 1% 01/10/2050	DKK	5,600,978	650,629	0.05
Realkredit Danmark A/S, Reg. S 1% 01/10/2053	DKK	2,066,085	237,291	0.02
			1,786,653	0.14
<i>France</i>				
BPCE SA, Reg. S 0.875% 31/01/2024	EUR	200,000	220,263	0.02
BPCE SA, Reg. S 4.5% 13/01/2033	EUR	300,000	348,933	0.03
Cie de Saint-Gobain SA, Reg. S 3.5% 18/01/2029	EUR	100,000	112,853	0.01
Credit Agricole SA, Reg. S 0.875% 14/01/2032	EUR	300,000	272,985	0.02
Electricite de France SA, Reg. S, FRN 2.625% Perpetual	EUR	200,000	196,942	0.01
Electricite de France SA, Reg. S, FRN 2.875% Perpetual	EUR	200,000	205,246	0.01
Engie SA, Reg. S 4.25% 11/01/2043	EUR	100,000	115,992	0.01
France Government Bond OAT, Reg. S 0.75% 25/02/2028	EUR	710,000	738,700	0.06
France Government Bond OAT, Reg. S 0% 25/11/2030	EUR	3,810,000	3,597,424	0.28
France Government Bond OAT, Reg. S 2% 25/11/2032	EUR	1,410,000	1,500,987	0.12
France Government Bond OAT, Reg. S, 144A 2% 25/05/2048	EUR	365,000	333,929	0.03
Orange SA, Reg. S 3.875% 11/09/2035	EUR	300,000	353,221	0.03
			7,997,475	0.63
<i>Germany</i>				
Bundesobligation, Reg. S 0% 16/04/2027	EUR	630,000	651,412	0.05
Bundesobligation, Reg. S 2.2% 13/04/2028	EUR	2,295,000	2,557,961	0.20
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 2.3% 15/02/2033	EUR	13,815,000	15,646,163	1.24
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 2.6% 15/08/2033	EUR	370,000	428,961	0.03
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0% 15/08/2052	EUR	270,000	159,081	0.01
Bundesschatzanweisungen, Reg. S 2.5% 13/03/2025	EUR	1,525,000	1,677,236	0.13
Daimler Truck International Finance BV, Reg. S 1.625% 06/04/2027	EUR	300,000	317,185	0.03
Deutsche Bank AG, Reg. S, FRN 1.75% 19/11/2030	EUR	400,000	384,451	0.03
Deutsche Bank AG, Reg. S, FRN 4% 24/06/2032	EUR	300,000	319,329	0.03

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
E.ON SE, Reg. S 1.625% 29/03/2031	EUR	540,000	539,485	0.04
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, Reg. S 1.125% 04/07/2025	GBP	305,000	370,016	0.03
Volkswagen Financial Services NV, Reg. S 1.625% 10/02/2024	GBP	100,000	126,891	0.01
			<u>23,178,171</u>	<u>1.83</u>
<i>Greece</i>				
Greece Government Bond, Reg. S, 144A 2% 22/04/2027	EUR	30,000	32,949	-
Greece Government Bond, Reg. S, 144A 3.875% 15/06/2028	EUR	2,150,000	2,510,125	0.20
Greece Government Bond, Reg. S, 144A 1.5% 18/06/2030	EUR	430,000	438,743	0.03
Greece Government Bond, Reg. S, 144A 1.75% 18/06/2032	EUR	720,000	724,930	0.06
Greece Government Bond, Reg. S, 144A 4.25% 15/06/2033	EUR	2,155,000	2,611,714	0.21
Greece Government Bond, Reg. S, 144A 1.875% 24/01/2052	EUR	1,403,000	1,112,770	0.09
			<u>7,431,231</u>	<u>0.59</u>
<i>Hong Kong</i>				
AIA Group Ltd., Reg. S, FRN 0.88% 09/09/2033	EUR	500,000	471,430	0.04
			<u>471,430</u>	<u>0.04</u>
<i>Hungary</i>				
Magyar Export-Import Bank Zrt., Reg. S 6% 16/05/2029	EUR	100,000	117,437	0.01
			<u>117,437</u>	<u>0.01</u>
<i>India</i>				
India Government Bond 5.22% 15/06/2025	INR	30,790,000	360,702	0.03
			<u>360,702</u>	<u>0.03</u>
<i>Indonesia</i>				
Indonesia Government Bond 9% 15/03/2029	IDR	2,376,000,000	170,769	0.01
Indonesia Government Bond 8.25% 15/05/2029	IDR	4,485,000,000	314,134	0.03
Indonesia Government Bond 6.375% 15/04/2032	IDR	6,574,000,000	422,658	0.03
Indonesia Treasury 6.375% 15/08/2028	IDR	20,419,000,000	1,323,833	0.11
			<u>2,231,394</u>	<u>0.18</u>
<i>Ireland</i>				
Ireland Government Bond, Reg. S 3% 18/10/2043	EUR	340,000	390,715	0.03
			<u>390,715</u>	<u>0.03</u>
<i>Israel</i>				
Israel Government Bond 4.5% 17/01/2033	USD	285,000	271,413	0.02
Israel Government Bond, Reg. S 2.875% 29/01/2024	EUR	520,000	574,005	0.05
			<u>845,418</u>	<u>0.07</u>
<i>Italy</i>				
Enel Finance International NV, Reg. S 1% 16/09/2024	EUR	150,000	162,357	0.01
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 0.95% 15/09/2027	EUR	75,000	77,422	0.01

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 4.4% 01/05/2033	EUR	2,220,000	2,611,873	0.21
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 4.35% 01/11/2033	EUR	1,570,000	1,835,824	0.14
			4,687,476	0.37
<i>Japan</i>				
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/06/2024	JPY	247,300,000	1,755,800	0.14
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/12/2024	JPY	93,800,000	666,158	0.05
Japan Government Five Year Bond 0.2% 20/03/2028	JPY	305,350,000	2,169,349	0.17
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/09/2029	JPY	35,000,000	246,190	0.02
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/06/2031	JPY	221,550,000	1,534,716	0.12
Japan Government Ten Year Bond 0.5% 20/03/2033	JPY	235,050,000	1,655,395	0.13
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/03/2027	JPY	229,250,000	1,627,724	0.13
Japan Government Thirty Year Bond 0.5% 20/03/2049	JPY	27,900,000	153,688	0.01
Japan Government Thirty Year Bond 0.6% 20/06/2050	JPY	105,450,000	586,466	0.05
Japan Government Thirty Year Bond 1% 20/03/2052	JPY	231,250,000	1,405,494	0.11
Japan Government Thirty Year Bond 1.4% 20/09/2052	JPY	187,700,000	1,257,088	0.10
Japan Government Thirty Year Bond 2% 20/03/2042	JPY	10,000,000	78,832	0.01
Japan Government Thirty Year Bond 1.7% 20/03/2044	JPY	32,400,000	241,578	0.02
Japan Government Twenty Year Bond 1.2% 20/03/2035	JPY	729,550,000	5,423,041	0.43
Japan Government Twenty Year Bond 0.4% 20/06/2040	JPY	125,000,000	781,185	0.06
Japan Government Twenty Year Bond 0.5% 20/12/2041	JPY	71,900,000	444,634	0.04
Japan Government Twenty Year Bond 2.2% 20/03/2030	JPY	5,000,000	39,661	-
Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/06/2037	JPY	95,700,000	648,476	0.05
			20,715,475	1.64
<i>Korea, Republic Of</i>				
Export-Import Bank of Korea 5.125% 11/01/2033	USD	255,000	265,242	0.02
Export-Import Bank of Korea 5.125% 18/09/2033	USD	300,000	312,944	0.02
Korea Development Bank (The) 4.375% 15/02/2033	USD	650,000	638,079	0.05
Korea Treasury 1.5% 10/03/2025	KRW	418,130,000	317,837	0.03
Korea Treasury 2.375% 10/12/2027	KRW	845,780,000	637,492	0.05
Korea Treasury 4.25% 10/12/2032	KRW	4,005,390,000	3,361,627	0.27
			5,533,221	0.44
<i>Malaysia</i>				
MISC Capital Two Labuan Ltd., 144A 3.75% 06/04/2027	USD	520,000	500,995	0.04
			500,995	0.04
<i>Mexico</i>				
America Movil SAB de CV 9.5% 27/01/2031	MXN	26,860,000	1,538,611	0.12
Mexican Bonos 8% 07/11/2047	MXN	2,500,000	131,696	0.01
Mexican Bonos 8% 31/07/2053	MXN	69,900,000	3,656,156	0.29

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Petroleos Mexicanos, Reg. S 7.19% 12/09/2024	MXN	29,685,700	1,671,819	0.13
			6,998,282	0.55
<i>Morocco</i>				
Morocco Government Bond, Reg. S 3.5% 19/06/2024	EUR	120,000	132,297	0.01
			132,297	0.01
<i>Netherlands</i>				
Cooperatieve Rabobank UA, Reg. S 1.25% 14/01/2025	GBP	300,000	368,072	0.03
ING Groep NV, Reg. S, FRN 5.25% 14/11/2033	EUR	200,000	243,130	0.02
Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 5.5% 15/01/2028	EUR	80,000	99,581	0.01
Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 2% 15/07/2024	EUR	40,000	43,840	-
			754,623	0.06
<i>Norway</i>				
Equinor ASA, Reg. S 1.375% 22/05/2032	EUR	300,000	293,045	0.02
			293,045	0.02
<i>Philippines</i>				
Philippines Government Bond 0.25% 28/04/2025	EUR	180,000	189,664	0.01
			189,664	0.01
<i>Poland</i>				
Poland Government Bond 2.75% 25/10/2029	PLN	1,130,000	256,549	0.02
			256,549	0.02
<i>Portugal</i>				
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, Reg. S, 144A 3.5% 18/06/2038	EUR	710,000	822,610	0.06
			822,610	0.06
<i>Qatar</i>				
QatarEnergy, 144A 3.125% 12/07/2041	USD	716,000	551,902	0.05
QatarEnergy, 144A 3.3% 12/07/2051	USD	400,000	293,053	0.02
			844,955	0.07
<i>Romania</i>				
Romania Government Bond, 144A 2.125% 07/03/2028	EUR	420,000	422,106	0.03
			422,106	0.03
<i>Saudi Arabia</i>				
SA Global Sukuk Ltd., Reg. S 0.946% 17/06/2024	USD	500,000	489,697	0.04
			489,697	0.04
<i>Serbia</i>				
Serbia Government Bond, 144A 3.125% 15/05/2027	EUR	760,000	804,393	0.06
Serbia Government Bond, 144A 2.05% 23/09/2036	EUR	250,000	192,748	0.02
			997,141	0.08
<i>South Africa</i>				
Anglo American Capital plc, 144A 2.25% 17/03/2028	USD	200,000	178,446	0.01
Anglo American Capital plc, 144A 4% 11/09/2027	USD	200,000	192,308	0.02
South Africa Government Bond 8% 31/01/2030	ZAR	8,900,000	448,503	0.04
South Africa Government Bond 6.5% 28/02/2041	ZAR	9,090,000	300,789	0.02

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
South Africa Government Bond 8.75% 28/02/2048	ZAR	22,400,000	903,347	0.07
			2,023,393	0.16
<i>Spain</i>				
Banco de Sabadell SA, Reg. S, FRN 5.25% 07/02/2029	EUR	500,000	570,596	0.05
CaixaBank SA, Reg. S, FRN 1.5% 03/12/2026	GBP	200,000	237,503	0.02
CaixaBank SA, Reg. S, FRN 0.75% 26/05/2028	EUR	300,000	302,163	0.03
Spain Bonos y Obligaciones del Estado 0% 31/01/2027	EUR	770,000	787,049	0.06
Spain Bonos y Obligaciones del Estado, Reg. S, 144A 1.25% 31/10/2030	EUR	300,000	301,677	0.02
Spain Bonos y Obligaciones del Estado, Reg. S, 144A 0.5% 31/10/2031	EUR	815,000	757,897	0.06
Spain Government Bond, Reg. S, 144A 3.15% 30/04/2033	EUR	579,000	650,610	0.05
Spain Government Bond, Reg. S, 144A 3.55% 31/10/2033	EUR	760,000	879,729	0.07
			4,487,224	0.36
<i>Supranational</i>				
Asian Development Bank 1.125% 10/06/2025	GBP	330,000	400,924	0.03
European Investment Bank, Reg. S 0.375% 15/09/2027	EUR	320,000	328,649	0.03
European Investment Bank, Reg. S 0.25% 20/01/2032	EUR	1,410,000	1,303,881	0.10
European Union, Reg. S 0% 06/07/2026	EUR	500,000	519,088	0.04
European Union, Reg. S 0.25% 22/10/2026	EUR	180,000	187,415	0.02
International Finance Corp. 6.3% 25/11/2024	INR	15,000,000	179,155	0.01
			2,919,112	0.23
<i>Switzerland</i>				
ABB Finance BV, Reg. S 3.25% 16/01/2027	EUR	100,000	111,790	0.01
UBS Group AG, Reg. S, FRN 4.49% 05/08/2025	USD	730,000	724,708	0.06
			836,498	0.07
<i>Tunisia</i>				
Tunisia Government Bond, Reg. S 5.625% 17/02/2024	EUR	760,000	811,810	0.06
			811,810	0.06
<i>United Kingdom</i>				
Barclays plc, FRN 5.304% 09/08/2026	USD	325,000	323,857	0.03
Barclays plc, FRN 5.501% 09/08/2028	USD	440,000	442,269	0.03
BAT Capital Corp. 3.215% 06/09/2026	USD	349,000	333,955	0.03
BAT Capital Corp. 4.7% 02/04/2027	USD	123,000	121,825	0.01
BP Capital Markets America, Inc. 4.234% 06/11/2028	USD	225,000	223,849	0.02
HSBC Holdings plc, FRN 4.292% 12/09/2026	USD	250,000	244,965	0.02
HSBC Holdings plc, FRN 7.39% 03/11/2028	USD	575,000	616,504	0.05
HSBC Holdings plc, FRN 4.583% 19/06/2029	USD	200,000	194,089	0.02
HSBC Holdings plc, FRN 7.399% 13/11/2034	USD	640,000	702,309	0.06

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Lloyds Banking Group plc, FRN 3.87% 09/07/2025	USD	270,000	267,502	0.02
Lloyds Banking Group plc, FRN 1.627% 11/05/2027	USD	900,000	825,298	0.07
Lloyds Banking Group plc, Reg. S, FRN 1.875% 15/01/2026	GBP	128,000	156,810	0.01
NatWest Group plc, Reg. S, FRN 0.78% 26/02/2030	EUR	325,000	309,565	0.02
NatWest Markets plc, Reg. S 2.75% 02/04/2025	EUR	250,000	273,505	0.02
Reynolds American, Inc. 4.45% 12/06/2025	USD	195,000	192,921	0.01
UK Treasury, Reg. S 4.75% 07/12/2030	GBP	100,000	138,047	0.01
UK Treasury, Reg. S 0.25% 31/07/2031	GBP	1,505,000	1,516,982	0.12
UK Treasury, Reg. S 1% 31/01/2032	GBP	1,020,000	1,077,754	0.08
UK Treasury, Reg. S 4.25% 07/06/2032	GBP	480,000	647,893	0.05
UK Treasury, Reg. S 1.25% 31/07/2051	GBP	965,602	655,526	0.05
UK Treasury, Reg. S 4.25% 07/12/2027	GBP	1,720,000	2,260,298	0.18
			11,525,723	0.91
<i>United States of America</i>				
Altria Group, Inc. 2.2% 15/06/2027	EUR	375,000	399,392	0.03
American Tower Corp., REIT 0.45% 15/01/2027	EUR	730,000	737,816	0.06
AT&T, Inc. 4.3% 18/11/2034	EUR	100,000	116,912	0.01
Avangrid, Inc. 3.8% 01/06/2029	USD	300,000	283,078	0.02
Becton Dickinson & Co. 4.298% 22/08/2032	USD	430,000	415,192	0.03
Becton Dickinson & Co. 3.734% 15/12/2024	USD	50,000	49,239	-
Boeing Co. (The) 4.875% 01/05/2025	USD	15,000	14,937	-
Boeing Co. (The) 2.75% 01/02/2026	USD	300,000	287,249	0.02
Boeing Co. (The) 3.625% 01/02/2031	USD	13,000	12,081	-
Celanese US Holdings LLC 6.379% 15/07/2032	USD	110,000	116,375	0.01
CMS Energy Corp. 3.6% 15/11/2025	USD	25,000	24,280	-
Comcast Corp. 0% 14/09/2026	EUR	1,075,000	1,095,400	0.09
Consumers Energy Co. 4.65% 01/03/2028	USD	420,000	423,059	0.03
Consumers Energy Co. 3.6% 15/08/2032	USD	610,000	565,807	0.05
Corporate Office Properties LP, REIT 2.75% 15/04/2031	USD	309,000	250,153	0.02
Crown Castle, Inc., REIT 5% 11/01/2028	USD	133,000	132,599	0.01
Crown Castle, Inc., REIT 2.5% 15/07/2031	USD	230,000	191,962	0.02
DTE Electric Co. 2.625% 01/03/2031	USD	330,000	289,101	0.02
Duke Energy Carolinas LLC 4.95% 15/01/2033	USD	280,000	285,359	0.02
Duke Energy Carolinas LLC 5.35% 15/01/2053	USD	280,000	287,451	0.02
Elevance Health, Inc. 4.75% 15/02/2033	USD	61,000	61,051	0.01
Elevance Health, Inc. 5.125% 15/02/2053	USD	52,000	52,130	0.01
Eli Lilly & Co. 3.375% 15/03/2029	USD	300,000	288,698	0.02
Eli Lilly & Co. 4.7% 27/02/2033	USD	161,000	165,167	0.01
Entergy Louisiana LLC 4.75% 15/09/2052	USD	200,000	184,181	0.02
Exxon Mobil Corp. 0.524% 26/06/2028	EUR	300,000	300,271	0.02
General Motors Financial Co., Inc. 1.05% 08/03/2024	USD	225,000	223,005	0.02
Intercontinental Exchange, Inc. 4.35% 15/06/2029	USD	300,000	299,388	0.02
Mastercard, Inc. 4.85% 09/03/2033	USD	268,000	276,951	0.02
McDonald's Corp., Reg. S 0.25% 04/10/2028	EUR	300,000	292,354	0.02
Morgan Stanley, FRN 2.95% 07/05/2032	EUR	960,000	1,005,072	0.08
Norfolk Southern Corp. 4.45% 01/03/2033	USD	98,000	96,790	0.01

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Northrop Grumman Corp. 4.7% 15/03/2033	USD	260,000	262,364	0.02
Northrop Grumman Corp. 4.95% 15/03/2053	USD	45,000	44,628	-
ONEOK, Inc. 5.8% 01/11/2030	USD	15,000	15,604	-
ONEOK, Inc. 6.05% 01/09/2033	USD	110,000	116,597	0.01
Oracle Corp. 3.6% 01/04/2050	USD	310,000	229,889	0.02
Pacific Gas and Electric Co. 3% 15/06/2028	USD	1,600,000	1,459,424	0.12
Pacific Gas and Electric Co. 3.25% 01/06/2031	USD	475,000	411,809	0.03
Pacific Gas and Electric Co. 5.9% 15/06/2032	USD	500,000	508,996	0.04
PepsiCo, Inc. 0.75% 14/10/2033	EUR	325,000	294,357	0.02
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4.75% 19/05/2033	USD	445,000	446,163	0.04
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 5.3% 19/05/2053	USD	47,000	48,017	-
Philip Morris International, Inc. 2.1% 01/05/2030	USD	106,000	90,989	0.01
Philip Morris International, Inc. 5.375% 15/02/2033	USD	400,000	410,482	0.03
Prologis LP, REIT 5.25% 15/06/2053	USD	29,000	30,321	-
Salesforce, Inc. 2.9% 15/07/2051	USD	425,000	304,143	0.02
Southern California Edison Co. 3.65% 01/02/2050	USD	210,000	162,864	0.01
Southern California Edison Co. 3.45% 01/02/2052	USD	375,000	274,053	0.02
Stryker Corp. 0.75% 01/03/2029	EUR	190,000	186,847	0.02
Thermo Fisher Scientific, Inc. 0.5% 01/03/2028	EUR	300,000	301,439	0.02
T-Mobile USA, Inc. 2.55% 15/02/2031	USD	200,000	172,359	0.01
Toyota Motor Credit Corp. 1.9% 13/01/2027	USD	180,000	167,530	0.01
Toyota Motor Credit Corp. 3.375% 01/04/2030	USD	123,000	115,663	0.01
Union Pacific Corp. 2.95% 10/03/2052	USD	764,000	542,514	0.04
US Treasury 3.875% 31/03/2025	USD	14,661,900	14,535,833	1.15
US Treasury 5% 31/08/2025	USD	4,450,000	4,491,838	0.36
US Treasury 3.625% 15/05/2026	USD	670,000	662,436	0.05
US Treasury 0.75% 31/05/2026	USD	1,290,000	1,191,335	0.10
US Treasury 2.125% 31/05/2026	USD	780,000	745,052	0.06
US Treasury 4.625% 15/11/2026	USD	521,000	529,345	0.04
US Treasury 4.125% 30/09/2027	USD	106,900	107,622	0.01
US Treasury 3.625% 31/03/2028	USD	22,189,800	21,953,166	1.74
US Treasury 4.375% 31/08/2028	USD	7,830,000	7,998,834	0.63
US Treasury 3.75% 31/05/2030	USD	2,000,000	1,983,094	0.16
US Treasury 3.5% 15/02/2033	USD	49,917,000	48,435,092	3.84
US Treasury 3.375% 15/05/2033	USD	775,000	744,303	0.06
US Treasury 3.875% 15/08/2033	USD	1,597,000	1,596,002	0.13
US Treasury 1.875% 15/02/2041	USD	50,000	36,023	-
US Treasury 1.75% 15/08/2041	USD	1,703,000	1,187,177	0.09
US Treasury 2% 15/11/2041	USD	600,000	435,188	0.04
US Treasury 3.875% 15/05/2043	USD	380,000	363,117	0.03
US Treasury 1.25% 15/05/2050	USD	180,000	97,355	0.01
US Treasury 2.375% 15/05/2051	USD	123,000	88,051	0.01
US Treasury 2% 15/08/2051	USD	2,559,000	1,676,011	0.13
US Treasury 2.25% 15/02/2052	USD	940,000	653,362	0.05
US Treasury 2.875% 15/05/2052	USD	300,000	239,459	0.02

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
US Treasury 3.625% 15/02/2053	USD	40,378,300	37,384,629	2.96
US Treasury Inflation Indexed 1.375% 15/07/2033	USD	1,640,000	1,613,045	0.13
US Treasury Inflation Indexed, FRN 2.375% 15/10/2028	USD	4,277,900	4,428,226	0.35
US Treasury Inflation Indexed, FRN 1% 15/02/2049	USD	570,000	563,354	0.05
US Treasury Inflation Indexed, FRN 1.5% 15/02/2053	USD	1,500,000	1,413,858	0.11
VICI Properties LP, REIT 4.375% 15/05/2025	USD	276,000	271,408	0.02
Wells Fargo & Co., Reg. S, FRN 1.338% 04/05/2025	EUR	340,000	371,621	0.03
			171,615,388	13.58
Total Bonds			316,650,631	25.07
Convertible Bonds				
<i>United States of America</i>				
AES Corp. (The) 6.875% 15/02/2024	USD	52,900	4,024,632	0.32
			4,024,632	0.32
Total Convertible Bonds			4,024,632	0.32
Equities				
<i>Brazil</i>				
Equatorial Energia SA	BRL	1,259,665	9,258,898	0.73
Pagseguro Digital Ltd. 'A'	USD	268,228	3,344,803	0.26
Vale SA	BRL	243,533	3,861,677	0.31
			16,465,378	1.30
<i>Canada</i>				
Brookfield Asset Management Ltd. 'A'	CAD	65,641	2,636,440	0.21
Brookfield Corp.	CAD	448,411	17,986,525	1.42
Canadian Natural Resources Ltd.	CAD	219,907	14,407,099	1.14
Constellation Software, Inc.	CAD	9,188	22,780,318	1.80
Restaurant Brands International, Inc.	CAD	120,513	9,416,030	0.75
TC Energy Corp.	CAD	220,262	8,604,023	0.68
Tourmaline Oil Corp.	CAD	162,926	7,327,090	0.58
			83,157,525	6.58
<i>Denmark</i>				
Coloplast A/S 'B'	DKK	69,100	7,900,086	0.63
			7,900,086	0.63
<i>France</i>				
Airbus SE	EUR	56,107	8,660,580	0.69
Kering SA	EUR	6,059	2,688,869	0.21
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	8,968	7,274,170	0.58
Pernod Ricard SA	EUR	31,638	5,594,550	0.44
Sanofi SA	EUR	72,469	7,184,677	0.57
Schneider Electric SE	EUR	27,752	5,587,868	0.44
			36,990,714	2.93
<i>Germany</i>				
MTU Aero Engines AG	EUR	24,728	5,329,686	0.42
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG	EUR	17,959	7,436,754	0.59
			12,766,440	1.01
<i>Hong Kong</i>				
AIA Group Ltd.	HKD	575,200	4,995,845	0.40
			4,995,845	0.40

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>India</i>				
HDFC Bank Ltd.	INR	815,933	16,738,434	1.32
			<u>16,738,434</u>	<u>1.32</u>
<i>Japan</i>				
Keyence Corp.	JPY	11,000	4,821,777	0.38
Mitsui & Co. Ltd.	JPY	212,700	7,925,020	0.63
Murata Manufacturing Co. Ltd.	JPY	157,800	3,332,566	0.26
SMC Corp.	JPY	10,100	5,401,182	0.43
Tokyo Electron Ltd.	JPY	72,600	12,904,694	1.02
			<u>34,385,239</u>	<u>2.72</u>
<i>Netherlands</i>				
Akzo Nobel NV	EUR	41,120	3,397,565	0.27
ASML Holding NV	EUR	9,185	6,934,795	0.55
DSM-Firmenich AG	EUR	24,156	2,459,477	0.19
Universal Music Group NV	EUR	331,691	9,471,817	0.75
Wolters Kluwer NV	EUR	79,039	11,231,787	0.89
			<u>33,495,441</u>	<u>2.65</u>
<i>Spain</i>				
Industria de Diseno Textil SA	EUR	105,097	4,583,954	0.36
			<u>4,583,954</u>	<u>0.36</u>
<i>Switzerland</i>				
Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	CHF	521	6,257,934	0.50
Givaudan SA	CHF	1,818	7,562,957	0.60
Nestle SA	CHF	220,998	25,577,728	2.02
Zurich Insurance Group AG	CHF	10,647	5,566,337	0.44
			<u>44,964,956</u>	<u>3.56</u>
<i>Taiwan, Province Of China</i>				
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	1,799,000	34,622,624	2.74
			<u>34,622,624</u>	<u>2.74</u>
<i>United Kingdom</i>				
AstraZeneca plc	GBP	225,436	30,362,482	2.40
BAE Systems plc	GBP	687,490	9,726,528	0.77
National Grid plc	GBP	384,766	5,195,238	0.41
Rio Tinto plc	GBP	48,581	3,608,014	0.29
			<u>48,892,262</u>	<u>3.87</u>
<i>United States of America</i>				
AES Corp. (The)	USD	284,400	5,474,700	0.43
Alphabet, Inc. 'C'	USD	95,438	13,450,077	1.06
Altria Group, Inc.	USD	111,926	4,515,095	0.36
Aon plc 'A'	USD	35,380	10,296,288	0.82
Baker Hughes Co.	USD	244,731	8,364,906	0.66
Boeing Co. (The)	USD	37,493	9,772,925	0.77
Broadcom, Inc.	USD	53,147	59,325,339	4.70
Brookfield Infrastructure Partners LP	CAD	92,559	2,917,070	0.23
Carlyle Group, Inc. (The)	USD	192,076	7,815,572	0.62
Centene Corp.	USD	72,397	5,372,581	0.43
Chevron Corp.	USD	49,752	7,421,008	0.59
Cigna Group (The)	USD	26,530	7,944,409	0.63

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Costco Wholesale Corp.	USD	17,658	11,655,693	0.92
Crown Castle, Inc., REIT	USD	91,200	10,505,328	0.83
Danaher Corp.	USD	41,938	9,701,937	0.77
Darden Restaurants, Inc.	USD	55,998	9,200,471	0.73
Gilead Sciences, Inc.	USD	91,597	7,420,273	0.59
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	USD	10,218	3,941,798	0.31
Home Depot, Inc. (The)	USD	41,233	14,289,296	1.13
JPMorgan Chase & Co.	USD	142,694	24,272,249	1.92
Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	279,039	9,297,580	0.74
Merck & Co., Inc.	USD	50,583	5,514,559	0.44
Microsoft Corp.	USD	82,828	31,146,641	2.47
Motorola Solutions, Inc.	USD	34,776	10,888,018	0.86
Northrop Grumman Corp.	USD	21,864	10,235,413	0.81
Pfizer, Inc.	USD	163,693	4,712,721	0.37
Philip Morris International, Inc.	USD	309,051	29,075,518	2.30
Pioneer Natural Resources Co.	USD	19,818	4,456,672	0.35
Procter & Gamble Co. (The)	USD	26,216	3,841,693	0.30
Southwest Airlines Co.	USD	106,448	3,074,218	0.24
TE Connectivity Ltd.	USD	54,434	7,647,977	0.61
Thermo Fisher Scientific, Inc.	USD	15,231	8,084,463	0.64
United Parcel Service, Inc. 'B'	USD	29,641	4,660,454	0.37
UnitedHealth Group, Inc.	USD	51,194	26,952,105	2.13
Veralto Corp.	USD	15,099	1,242,044	0.10
Visa, Inc. 'A'	USD	89,717	23,357,821	1.85
			<u>417,844,912</u>	<u>33.08</u>
Total Equities			797,803,810	63.15
Total Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing			1,118,479,073	88.54
Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market				
Bonds				
<i>Australia</i>				
Commonwealth Bank of Australia, 144A 2.688% 11/03/2031	USD	700,000	576,330	0.05
National Australia Bank Ltd., 144A 2.99% 21/05/2031	USD	500,000	418,734	0.03
			<u>995,064</u>	<u>0.08</u>
<i>Brazil</i>				
BNTNF 10 10% 01/01/2033	BRL	12,146,000	2,464,792	0.19
Brazil Notas do Tesouro Nacional, FRN 6% 15/08/2040	BRL	11,000	101,219	0.01
Brazil Notas do Tesouro Nacional, FRN 6% 15/08/2060	BRL	11,000	102,299	0.01
Brazil Treasury, FRN 2.5% 15/08/2050	BRL	79,200	734,180	0.06
			<u>3,402,490</u>	<u>0.27</u>
<i>Colombia</i>				
Ecopetrol SA 6.875% 29/04/2030	USD	345,000	342,304	0.03
			<u>342,304</u>	<u>0.03</u>

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Denmark</i>				
Danske Bank A/S, FRN, 144A 0.976% 10/09/2025	USD	780,000	754,548	0.06
			<u>754,548</u>	<u>0.06</u>
<i>France</i>				
BNP Paribas SA, FRN, 144A 2.159% 15/09/2029	USD	200,000	174,145	0.01
BPCE SA, 144A 5.15% 21/07/2024	USD	211,000	209,234	0.02
			<u>383,379</u>	<u>0.03</u>
<i>Germany</i>				
BMW US Capital LLC, 144A 3.9% 09/04/2025	USD	130,000	128,571	0.01
Daimler Truck Finance North America LLC, 144A 3.65% 07/04/2027	USD	150,000	144,645	0.01
Deutsche Bank AG, FRN 2.129% 24/11/2026	USD	200,000	187,587	0.02
Deutsche Bank AG, FRN 2.311% 16/11/2027	USD	300,000	274,479	0.02
			<u>735,282</u>	<u>0.06</u>
<i>Ireland</i>				
AIB Group plc, FRN, 144A 7.583% 14/10/2026	USD	395,000	407,778	0.03
			<u>407,778</u>	<u>0.03</u>
<i>Japan</i>				
Japan Government CPI Linked Bond, FRN 0.1% 10/09/2024	JPY	27,000,000	210,896	0.02
Japan Treasury Bill 0% 20/02/2024	JPY	556,600,000	3,948,472	0.31
			<u>4,159,368</u>	<u>0.33</u>
<i>Mexico</i>				
Petroleos Mexicanos 4.875% 18/01/2024	USD	31,000	30,945	-
Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/2025	USD	114,000	111,462	0.01
Petroleos Mexicanos 6.875% 04/08/2026	USD	441,000	428,532	0.04
Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	USD	709,000	665,753	0.05
			<u>1,236,692</u>	<u>0.10</u>
<i>Panama</i>				
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA, Reg. S 5.125% 11/08/2061	USD	205,000	156,359	0.01
			<u>156,359</u>	<u>0.01</u>
<i>Philippines</i>				
Philippines Government Bond, Reg. S 0.001% 12/04/2024	JPY	300,000,000	2,123,660	0.17
			<u>2,123,660</u>	<u>0.17</u>
<i>Ukraine</i>				
Ukraine Government Bond, Reg. S 6.876% 21/05/2031	USD	1,384,000	322,749	0.02
			<u>322,749</u>	<u>0.02</u>
<i>United Kingdom</i>				
Astrazeneca Finance LLC 2.25% 28/05/2031	USD	319,000	275,192	0.02
AstraZeneca plc 3.375% 16/11/2025	USD	350,000	342,445	0.03
			<u>617,637</u>	<u>0.05</u>
<i>United States of America</i>				
7-Eleven, Inc., 144A 0.95% 10/02/2026	USD	125,000	115,579	0.01
Affirm Asset Securitization Trust 'A', 144A 7.11% 15/11/2028	USD	188,000	188,590	0.02
American Electric Power Co., Inc. 1% 01/11/2025	USD	50,000	46,432	-

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Amgen, Inc. 4.2% 01/03/2033	USD	775,000	737,669	0.06
Amgen, Inc. 5.65% 02/03/2053	USD	344,000	362,180	0.03
Apple, Inc. 2.65% 11/05/2050	USD	71,000	48,936	-
AT&T, Inc. 2.55% 01/12/2033	USD	116,000	94,603	0.01
AT&T, Inc. 3.5% 15/09/2053	USD	477,000	346,555	0.03
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC 'A', 144A 5.2% 20/10/2027	USD	294,000	294,732	0.02
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC 'A', 144A 5.81% 20/12/2029	USD	240,000	245,590	0.02
Bank of America Corp., FRN 1.843% 04/02/2025	USD	1,000,000	996,180	0.08
Bank of America Corp., FRN 0.976% 22/04/2025	USD	1,200,000	1,181,007	0.09
Bank of America Corp., FRN 2.456% 22/10/2025	USD	109,000	106,164	0.01
Bank of America Corp., FRN 1.319% 19/06/2026	USD	246,000	231,667	0.02
Bank of America Corp., FRN 5.202% 25/04/2029	USD	266,000	267,816	0.02
Baxter International, Inc. 2.539% 01/02/2032	USD	451,000	378,380	0.03
Berkshire Hathaway Energy Co. 1.65% 15/05/2031	USD	300,000	240,876	0.02
Broadcom, Inc., 144A 4% 15/04/2029	USD	77,000	74,379	0.01
Broadcom, Inc., 144A 3.137% 15/11/2035	USD	50,000	41,076	-
Broadcom, Inc., 144A 3.75% 15/02/2051	USD	109,000	85,814	0.01
Broadcom, Inc. 4.15% 15/11/2030	USD	130,000	124,243	0.01
Broadcom, Inc., Reg. S 3.419% 15/04/2033	USD	99,000	86,997	0.01
Charter Communications Operating LLC 2.3% 01/02/2032	USD	510,000	406,226	0.03
Citigroup, Inc., FRN 0.981% 01/05/2025	USD	448,000	440,504	0.04
Connecticut Avenue Securities Trust, FRN '1M1', 144A 7.637% 25/05/2043	USD	393,628	402,153	0.03
Connecticut Avenue Securities Trust, FRN '1M1', 144A 7.237% 25/06/2043	USD	241,492	243,358	0.02
Connecticut Avenue Securities Trust, FRN '1M1', 144A 7.037% 25/07/2043	USD	179,682	180,532	0.01
Corebridge Financial, Inc. 3.9% 05/04/2032	USD	212,000	191,793	0.02
CSX Corp. 3.8% 15/04/2050	USD	12,000	9,817	-
CSX Corp. 2.5% 15/05/2051	USD	200,000	129,335	0.01
Equinix, Inc., REIT 1.8% 15/07/2027	USD	222,000	201,133	0.02
Equinix, Inc., REIT 2.15% 15/07/2030	USD	813,000	689,413	0.06
FirstEnergy Transmission LLC, 144A 2.866% 15/09/2028	USD	250,000	226,918	0.02
Gilead Sciences, Inc. 5.25% 15/10/2033	USD	378,000	394,161	0.03
Gilead Sciences, Inc. 5.55% 15/10/2053	USD	325,000	352,432	0.03
GNMA 2.5% 20/08/2051	USD	661,949	570,673	0.05
GNMA 2.5% 20/10/2051	USD	238,063	204,097	0.02
GNMA 2.5% 20/12/2051	USD	313,457	270,972	0.02
GNMA 3.5% 20/09/2052	USD	1,399,420	1,302,940	0.10
Grand Parkway Transportation Corp. 3.236% 01/10/2052	USD	150,000	113,042	0.01
Hyundai Capital America, 144A 1.65% 17/09/2026	USD	300,000	272,782	0.02
JPMorgan Chase & Co., FRN 1.045% 19/11/2026	USD	750,000	694,963	0.06
JPMorgan Chase & Co., FRN 1.578% 22/04/2027	USD	466,000	430,216	0.03

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
JPMorgan Chase & Co., FRN 4.323% 26/04/2028	USD	600,000	591,356	0.05
JPMorgan Chase & Co., FRN 3.54% 01/05/2028	USD	100,000	95,495	0.01
Morgan Stanley, FRN 4.21% 20/04/2028	USD	2,000	1,956	-
Morgan Stanley, FRN 5.25% 21/04/2034	USD	400,000	400,147	0.03
Niagara Mohawk Power Corp., Reg. S 3.508% 01/10/2024	USD	5,000	4,913	-
Ohio Turnpike & Infrastructure Commission 3.216% 15/02/2048	USD	175,000	132,040	0.01
Pacific Gas and Electric Co. 2.1% 01/08/2027	USD	1,068,000	963,301	0.08
Pacific Gas and Electric Co. 3.3% 01/12/2027	USD	250,000	233,557	0.02
Philip Morris International, Inc. 5.75% 17/11/2032	USD	248,000	260,387	0.02
Roche Holdings, Inc., 144A 2.076% 13/12/2031	USD	350,000	294,839	0.02
SMB Private Education Loan Trust, FRN 'A1B', 144A 6.888% 15/11/2052	USD	213,726	214,160	0.02
Southern California Edison Co. 2.85% 01/08/2029	USD	420,000	383,155	0.03
Stellantis Finance US, Inc., 144A 1.711% 29/01/2027	USD	700,000	636,030	0.05
Stellantis Finance US, Inc., 144A 2.691% 15/09/2031	USD	200,000	167,444	0.01
T-Mobile USA, Inc. 3.875% 15/04/2030	USD	425,000	403,139	0.03
T-Mobile USA, Inc. 3% 15/02/2041	USD	211,000	158,054	0.01
Tricon Residential Trust 'A', 144A 5.1% 17/07/2040	USD	166,846	164,971	0.01
Tricon Residential Trust 'B', 144A 5.1% 17/07/2040	USD	100,000	97,472	0.01
Tricon Residential Trust 'C', 144A 5.1% 17/07/2040	USD	100,000	96,910	0.01
UMBS 2% 01/09/2040	USD	1,674,873	1,442,505	0.11
UMBS 3% 01/01/2051	USD	4,448	3,945	-
UMBS 3% 01/12/2051	USD	1,275	1,129	-
UMBS 3.5% 01/06/2052	USD	24,056	22,081	-
UMBS 5% 01/12/2052	USD	1,043,961	1,033,594	0.08
UMBS 5.5% 01/02/2053	USD	59,833	60,119	0.01
UMBS 5.5% 01/05/2053	USD	10,197	10,242	-
UMBS 5.5% 01/06/2053	USD	36,319	36,480	-
UMBS 5.5% 01/06/2053	USD	160,728	161,440	0.01
UMBS 5% 01/07/2053	USD	56,043	55,457	-
UMBS 5% 01/07/2053	USD	98,184	97,157	0.01
UMBS 5.5% 01/07/2053	USD	135,765	136,395	0.01
UMBS 5.5% 01/07/2053	USD	426,703	428,528	0.03
Warnermedia Holdings, Inc. 5.05% 15/03/2042	USD	589,000	519,545	0.04
Wells Fargo & Co., FRN 3.526% 24/03/2028	USD	845,000	806,543	0.06
Wells Fargo & Co., FRN 4.611% 25/04/2053	USD	300,000	270,056	0.02
Westlake Automobile Receivables Trust 'A2A', 144A 5.51% 15/06/2026	USD	165,641	165,452	0.01
Westlake Automobile Receivables Trust 'A3', 144A 5.21% 18/01/2028	USD	45,000	44,889	-
			24,617,808	1.95
Total Bonds			40,255,118	3.19

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2023

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Total Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market			40,255,118	3.19
Recently issued securities				
Bonds				
<i>Spain</i>				
CaixaBank SA, FRN, 144A 6.208% 18/01/2029	USD	325,000	331,794	0.02
			331,794	0.02
<i>United States of America</i>				
Metropolitan Life Global Funding I, 144A 5.05% 06/01/2028	USD	280,000	283,123	0.02
New York Life Global Funding, 144A 4.55% 28/01/2033	USD	99,000	97,663	0.01
			380,786	0.03
Total Bonds			712,580	0.05
Total Recently issued securities			712,580	0.05
Other transferable securities and money market instruments				
Warrants				
<i>Canada</i>				
Constellation Software, Inc. 31/03/2040 [*]	CAD	8,547	-	-
			-	-
Total Warrants			-	-
Total Other transferable securities and money market instruments			-	-
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	49,908,938	49,908,938	3.95
			49,908,938	3.95
Total Collective Investment Schemes - UCITS			49,908,938	3.95
Total Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings			49,908,938	3.95
Total Investments			1,209,355,709	95.73
Cash			37,262,300	2.95
Other assets/(liabilities)			16,634,848	1.32
Total net assets			1,263,252,857	100.00

* Security is valued at its fair value under the direction of the Board of Directors of the Company.

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

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, 6.50%, 15/01/2053	USD	2,580,000	2,641,376	16,226	0.21
United States of America	UMBS, 2.50%, 25/01/2053	USD	6,850,000	5,828,387	306,606	0.46
United States of America	UMBS, 4.00%, 25/01/2053	USD	3,270,121	3,093,202	105,640	0.24
United States of America	UMBS, 4.50%, 25/01/2053	USD	6,195,000	6,005,762	265,707	0.48
United States of America	UMBS, 5.00%, 25/01/2053	USD	5,085,556	5,031,919	132,050	0.40
United States of America	UMBS, 5.50%, 25/01/2053	USD	2,766,600	2,778,704	44,543	0.22
United States of America	UMBS, 6.00%, 25/01/2053	USD	3,005,000	3,051,484	47,834	0.24
United States of America	UMBS, 6.50%, 25/01/2053	USD	1,275,000	1,306,726	23,060	0.10
United States of America	UMBS, 7.00%, 25/01/2053	USD	2,515,000	2,594,478	35,465	0.21
United States of America	UMBS, 3.50%, 25/02/2053	USD	2,466,861	2,265,658	(3,903)	0.18
United States of America	UMBS, 6.00%, 25/02/2053	USD	2,000,000	2,030,859	703	0.16
United States of America	UMBS, 2.00%, 25/01/2054	USD	1,825,000	1,491,937	52,539	0.12
United States of America	UMBS, 3.50%, 25/01/2054	USD	1,215,139	1,114,890	38,169	0.09
Total To Be Announced Contracts Long Positions				39,235,382	1,064,639	3.11
Net To Be Announced Contracts				39,235,382	1,064,639	3.11

Financial Futures Contracts					
Security Description	Number of Contracts	Currency	Global Exposure USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
Canada 10 Year Bond, 19/03/2024	38	CAD	3,561,254	2,964	-
Euro-Bobl, 07/03/2024	87	EUR	11,456,087	171,605	0.01
Euro-BTP, 07/03/2024	2	EUR	263,071	8,301	-
Euro-Bund, 07/03/2024	22	EUR	3,332,648	95,912	0.01
Euro-OAT, 07/03/2024	21	EUR	3,048,790	106,439	0.01
Euro-Schatz, 07/03/2024	11	EUR	1,293,824	5,248	-
Long Gilt, 26/03/2024	47	GBP	6,149,613	311,294	0.02
US 2 Year Note, 28/03/2024	98	USD	20,179,578	187,573	0.02
US 5 Year Note, 28/03/2024	141	USD	15,337,055	302,737	0.02
US 10 Year Note, 19/03/2024	32	USD	3,612,500	68,100	0.01
US Long Bond, 19/03/2024	24	USD	2,998,500	220,967	0.02
US Ultra Bond, 19/03/2024	21	USD	2,805,469	215,223	0.02
Total Unrealised Gain on Financial Futures Contracts				1,696,363	0.14
Euro-Buxl 30 Year Bond, 07/03/2024	(5)	EUR	(782,259)	(63,923)	(0.01)
Japan 10 Year Bond, 13/03/2024	(9)	JPY	(9,364,468)	(31,686)	-
US 10 Year Ultra Bond, 19/03/2024	(49)	USD	(5,782,766)	(259,212)	(0.02)
Total Unrealised Loss on Financial Futures Contracts				(354,821)	(0.03)
Net Unrealised Gain on Financial Futures Contracts				1,341,542	0.11

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Interest Rate Swap Contracts								
Nominal Amount	Currency	Counterparty	Security Description	Maturity Date	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets	
3,705,000	GBP	Citigroup	Pay floating SONIA 1 day Receive fixed 4.98%	21/06/2028	294,804	294,804	0.02	
1,820,000	GBP	Citigroup	Pay floating SONIA 1 day Receive fixed 4.96%	21/06/2028	142,945	142,945	0.01	
6,760,000	USD	Citigroup	Pay fixed 3.29% Receive floating SOFR 1 day	13/01/2030	74,104	74,104	0.01	
Total Unrealised Gain on Interest Rate Swap Contracts					511,853	511,853	0.04	
2,005,000	GBP	Citigroup	Pay fixed 4.367% Receive floating SONIA 1 day	21/06/2033	(221,618)	(221,618)	(0.02)	
38,800,000	MXN	Citigroup	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 6.58%	25/06/2026	(141,905)	(141,905)	(0.01)	
30,700,000	MXN	Citigroup	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 6.633%	25/06/2026	(110,148)	(110,148)	(0.01)	
990,000	GBP	Citigroup	Pay fixed 4.349% Receive floating SONIA 1 day	21/06/2033	(107,622)	(107,622)	(0.01)	
29,500,000	MXN	Citigroup	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 6.618%	25/06/2026	(106,442)	(106,442)	(0.01)	
30,656,888	MXN	Citigroup	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 7.52%	30/10/2026	(74,460)	(74,460)	(0.01)	
14,873,112	MXN	Citigroup	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 7.62%	29/10/2026	(33,933)	(33,933)	-	
9,000,000	MXN	Citigroup	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 6.585%	25/06/2026	(32,857)	(32,857)	-	
6,900,000	MXN	Citigroup	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 6.59%	25/06/2026	(25,145)	(25,145)	-	
9,900,000	MXN	Citigroup	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 7.59%	29/10/2026	(23,024)	(23,024)	-	
4,700,000	NZD	Citigroup	Pay floating BBR 3 month Receive fixed 2.985%	22/03/2024	(18,052)	(18,052)	-	
2,795,000	USD	Citigroup	Pay floating SOFR 1 day Receive fixed 3.792%	13/01/2026	(15,170)	(15,170)	-	
Total Unrealised Loss on Interest Rate Swap Contracts					(910,376)	(910,376)	(0.07)	
Net Unrealised Loss on Interest Rate Swap Contracts					(398,523)	(398,523)	(0.03)	

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Credit Default Swap Contracts

Nominal Amount	Currency	Counterparty	Reference Entity	Buy/ Sell	Interest(Paid)/ Received Rate	Maturity Date	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
2,710,000	USD	Citigroup	CDX.NA.IG.41-V1	Sell	1.00%	20/12/2028	52,782	52,782	-
11,500,000	EUR	Citigroup	ITRAXX.EUROPE. MAIN.40-V1	Sell	1.00%	20/12/2028	247,124	247,124	0.02
Total Unrealised Gain on Credit Default Swap Contracts							299,906	299,906	0.02
Net Unrealised Gain on Credit Default Swap Contracts							299,906	299,906	0.02

Forward Currency Exchange Contracts

Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
CAD	300,000	USD	221,439	08/01/2024	HSBC	4,986	-
CZK	4,500,000	USD	200,891	08/01/2024	BNP Paribas	299	-
EUR	1,180,292	PLN	5,120,000	08/01/2024	BNY Mellon	2,078	-
GBP	560,000	USD	707,333	08/01/2024	UBS	6,490	-
SGD	370,000	USD	277,618	08/01/2024	BNP Paribas	2,804	-
CNH	9,580,000	USD	1,338,363	09/01/2024	BNP Paribas	6,691	-
DKK	8,100,000	USD	1,174,611	09/01/2024	BNP Paribas	25,265	-
EUR	803,691	DKK	5,990,000	09/01/2024	Citibank	124	-
HUF	231,070,000	USD	663,024	09/01/2024	J.P. Morgan	2,474	-
PLN	2,615,000	USD	661,282	09/01/2024	J.P. Morgan	3,266	-
SEK	2,510,000	USD	240,405	09/01/2024	Citibank	8,513	-
ZAR	12,000,000	USD	653,635	09/01/2024	Morgan Stanley	2,050	-
EUR	250,000	USD	269,888	11/01/2024	BNP Paribas	6,186	-
EUR	340,000	USD	372,922	11/01/2024	HSBC	2,538	-
EUR	6,180,000	USD	6,673,980	11/01/2024	Morgan Stanley	150,570	0.01
BRL	1,610,000	USD	325,010	12/01/2024	Morgan Stanley	6,156	-
INR	2,900,000	USD	34,764	12/01/2024	Standard Chartered	62	-
JPY	94,130,000	USD	661,374	12/01/2024	Citibank	7,170	-
USD	699,799	CLP	609,840,000	12/01/2024	Morgan Stanley	7,817	-
USD	490,504	KRW	630,460,000	12/01/2024	Citibank	4,183	-
ILS	500,000	USD	136,154	18/01/2024	BNP Paribas	1,983	-
CNH	1,440,000	USD	200,619	19/01/2024	HSBC	1,704	-
EUR	970,000	USD	1,067,652	19/01/2024	BNP Paribas	3,897	-
EUR	2,760,000	USD	2,970,588	19/01/2024	Goldman Sachs	78,354	0.01
GBP	1,080,000	USD	1,357,646	19/01/2024	Morgan Stanley	19,105	-
JPY	732,300,000	USD	5,095,717	19/01/2024	HSBC	111,299	0.01
MYR	1,780,000	USD	382,138	19/01/2024	HSBC	6,468	-
THB	52,590,000	USD	1,473,935	19/01/2024	Citibank	69,097	0.01
CAD	2,670,000	USD	1,989,535	22/01/2024	BNP Paribas	26,053	-
CHF	590,000	USD	684,057	22/01/2024	Morgan Stanley	18,913	-
EUR	2,419,111	USD	2,646,713	22/01/2024	Bank of America	26,009	-
IDR	7,500,000,000	USD	486,003	22/01/2024	UBS	1,212	-
JPY	127,390,000	USD	873,042	22/01/2024	Morgan Stanley	33,209	0.01

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Forward Currency Exchange Contracts

Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
MXN	1,360,000	USD	78,257	22/01/2024	UBS	1,565	-
PLN	980,000	USD	247,676	22/01/2024	Citibank	1,323	-
SEK	5,200,000	USD	508,961	22/01/2024	Barclays	7,024	-
USD	710,035	KRW	915,420,000	22/01/2024	Bank of America	2,907	-
USD	371,331	PLN	1,460,000	22/01/2024	BNP Paribas	373	-
CNH	22,870,000	USD	3,210,253	23/01/2024	Morgan Stanley	3,932	-
DKK	1,900,000	USD	278,995	23/01/2024	Citibank	2,680	-
JPY	140,380,000	USD	965,734	23/01/2024	Morgan Stanley	33,091	-
THB	39,490,000	USD	1,130,304	23/01/2024	UBS	28,835	-
NZD	380,000	USD	236,480	25/01/2024	Standard Chartered	3,758	-
JPY	38,100,000	USD	269,224	26/01/2024	Citibank	1,996	-
JPY	1,086,060,000	USD	7,604,584	09/02/2024	Morgan Stanley	143,690	0.01
MXN	35,730,000	USD	1,987,208	14/02/2024	Goldman Sachs	101,841	0.01
USD	4,395,396	JPY	556,600,000	16/02/2024	HSBC	420,264	0.04
USD	4,360,924	JPY	556,600,000	20/02/2024	HSBC	383,401	0.03
Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts						1,783,705	0.14
EUR Hedged Share Class							
CAD	266,968	EUR	181,817	19/01/2024	J.P. Morgan	675	-
CHF	116,007	EUR	123,027	19/01/2024	J.P. Morgan	2,266	-
EUR	22,352,570	CAD	32,616,038	19/01/2024	J.P. Morgan	71,780	0.01
EUR	2	CHF	1	19/01/2024	J.P. Morgan	-	-
EUR	13,342,573	GBP	11,437,867	19/01/2024	J.P. Morgan	158,757	0.01
EUR	7,024	JPY	1,084,031	19/01/2024	J.P. Morgan	51	-
EUR	170,328,646	USD	183,317,691	19/01/2024	J.P. Morgan	4,842,520	0.38
GBP	26,358	EUR	30,357	19/01/2024	J.P. Morgan	66	-
JPY	84,702,313	EUR	542,439	19/01/2024	J.P. Morgan	3,051	-
USD	287,736	EUR	259,156	19/01/2024	J.P. Morgan	1,449	-
JPY Hedged Share Class							
CHF	4,390	JPY	734,921	19/01/2024	J.P. Morgan	3	-
JPY	2,972,861,054	CAD	27,700,666	19/01/2024	J.P. Morgan	228,123	0.02
JPY	4,042,067	CHF	24,064	19/01/2024	J.P. Morgan	79	-
JPY	5,598,873,142	EUR	35,751,312	19/01/2024	J.P. Morgan	316,682	0.02
JPY	1,766,693,642	GBP	9,673,640	19/01/2024	J.P. Morgan	230,413	0.02
JPY	22,138,745,365	USD	152,170,985	19/01/2024	J.P. Morgan	5,246,498	0.42
Unrealised Gain on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts						11,102,413	0.88
Total Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts						12,886,118	1.02
USD	326,352	GBP	260,000	08/01/2024	Standard Chartered	(5,066)	-
CNH	3,800,000	USD	534,664	09/01/2024	UBS	(1,136)	-
PLN	6,710,000	EUR	1,545,033	09/01/2024	HSBC	(826)	-
USD	649,491	ZAR	12,290,000	09/01/2024	UBS	(22,039)	-
USD	1,049,307	BRL	5,150,000	12/01/2024	Standard Chartered	(10,010)	-
USD	651,647	COP	2,638,520,000	12/01/2024	Standard Chartered	(27,959)	-
USD	356,248	IDR	5,500,000,000	12/01/2024	Citibank	(1,054)	-

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2023

Forward Currency Exchange Contracts

Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
USD	1,497,276	AUD	2,280,000	18/01/2024	BNP Paribas	(57,234)	(0.01)
USD	72,417	AUD	110,000	18/01/2024	Citibank	(2,581)	-
CNH	2,100,000	USD	295,656	19/01/2024	Goldman Sachs	(602)	-
EUR	270,000	USD	299,522	19/01/2024	Goldman Sachs	(1,256)	-
GBP	210,000	USD	267,831	19/01/2024	HSBC	(130)	-
EUR	968,405	CAD	1,430,000	22/01/2024	HSBC	(9,580)	-
INR	11,400,000	USD	137,003	22/01/2024	BNP Paribas	(151)	-
USD	2,036,627	BRL	10,020,000	22/01/2024	Citibank	(23,521)	-
USD	3,800,143	MXN	66,100,000	22/01/2024	J.P. Morgan	(79,459)	(0.01)
USD	317,855	MXN	5,500,000	22/01/2024	Standard Chartered	(4,956)	-
USD	669,128	ZAR	12,360,000	22/01/2024	UBS	(5,403)	-
USD	582,649	MXN	10,000,000	23/01/2024	Standard Chartered	(4,170)	-
USD	1,051,996	JPY	148,000,000	26/01/2024	HSBC	(1,563)	-
USD	2,986,092	JPY	443,000,000	09/02/2024	J.P. Morgan	(174,401)	(0.02)
JPY	556,600,000	USD	4,358,448	16/02/2024	HSBC	(383,316)	(0.03)
USD	1,071,979	BRL	5,350,000	20/02/2024	Citibank	(24,641)	-
USD	1,341,179	BRL	6,600,000	29/02/2024	Bank of America	(9,912)	-
Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts						(850,966)	(0.07)
EUR Hedged Share Class							
CAD	91,683	EUR	62,718	19/01/2024	J.P. Morgan	(76)	-
EUR	638	CAD	936	19/01/2024	J.P. Morgan	(1)	-
EUR	11,348,448	CHF	10,696,780	19/01/2024	J.P. Morgan	(204,113)	(0.02)
EUR	23,085	GBP	20,022	19/01/2024	J.P. Morgan	(21)	-
EUR	17,632,812	JPY	2,762,006,310	19/01/2024	J.P. Morgan	(160,462)	(0.01)
EUR	703,392	USD	782,488	19/01/2024	J.P. Morgan	(5,459)	-
GBP	98,969	EUR	114,832	19/01/2024	J.P. Morgan	(691)	-
JPY	7,881,459	EUR	50,854	19/01/2024	J.P. Morgan	(136)	-
USD	1,749,453	EUR	1,603,278	19/01/2024	J.P. Morgan	(21,671)	-
JPY Hedged Share Class							
CAD	13,693	JPY	1,460,710	19/01/2024	J.P. Morgan	(50)	-
EUR	17,608	JPY	2,750,322	19/01/2024	J.P. Morgan	(104)	-
GBP	4,828	JPY	867,295	19/01/2024	J.P. Morgan	(13)	-
JPY	2,629,279	CAD	24,833	19/01/2024	J.P. Morgan	(50)	-
JPY	1,475,937,348	CHF	8,887,381	19/01/2024	J.P. Morgan	(90,850)	(0.01)
JPY	3,575,418	EUR	23,166	19/01/2024	J.P. Morgan	(169)	-
JPY	523,161,306	USD	3,725,373	19/01/2024	J.P. Morgan	(5,436)	-
USD	78,887	JPY	11,125,054	19/01/2024	J.P. Morgan	(218)	-
Unrealised Loss on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts						(489,520)	(0.04)
Total Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts						(1,340,486)	(0.11)
Net Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts						11,545,632	0.91

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

キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド（LUX）

損益および純資産変動計算書

2023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）	13,219,933
受取配当金（源泉徴収税額控除後）	20,316,719
その他収益	29,251
証券貸付収益	142,091
銀行預金利息	4,998,463
スワップ取引	220,741

収益小計	38,927,198
費用	
運用報酬	12,285,121
管理手数料	515,767
年次税	491,286
専門家サービス	438,211
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	280,416
スワップ取引	1,763,452
その他費用	124,230
印刷費用	93,913
当座貸越利息*	13,391
費用小計	16,005,787
費用の払戻し	57,980
投資純利益 / (損失) (a)	22,979,391
実現純利益 / (損失)	
投資有価証券の売却取引	1,393,607
金融先物取引	-693,575
為替取引	-46,671,622
スワップ取引	-1,008,153
当期実現純利益 / (損失) (b)	-46,979,743
未実現評価利益 / (損失)の増減	
投資有価証券	87,023,519
キャピタルゲイン税	-
金融先物取引	3,029,870
スワップ取引	2,325,483
為替取引	-1,147,025
当期末実現評価利益 / (損失)の増減 (c)	91,231,847
当期損益 (a+b+c)	67,231,495
配当金の分配	-1,248,070
当期投資証券の差引増減額	-385,881,885
期首純資産総額	1,583,151,317
期末純資産総額	1,263,252,857

*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アセットマネジメント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アセットマネジメント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2023年7月25日から2024年1月24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）

（2024年1月24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449回 利付国債 (2)	0.005	2025/6/1	国債	1,100,000	100.0061	1,100,066,000
日本	第452回 利付国債 (2)	0.005	2025/9/1	国債	200,000	99.976	199,952,000

日本	第年)	452	回	利	付	国	債	(2	0.005	2025/9/1	国債	500,000	99.976	499,880,000
日本	第年)	452	回	利	付	国	債	(2	0.005	2025/9/1	国債	1,000,000	99.976	999,760,000
日本	第年)	452	回	利	付	国	債	(2	0.005	2025/9/1	国債	1,000,000	99.976	999,760,000
日本	第年)	453	回	利	付	国	債	(2	0.005	2025/10/1	国債	500,000	99.957	499,785,000
日本	第年)	453	回	利	付	国	債	(2	0.005	2025/10/1	国債	1,500,000	99.957	1,499,355,000
日本	第年)	454	回	利	付	国	債	(2	0.100	2025/11/1	国債	400,000	100.123	400,492,000
日本	第年)	455	回	利	付	国	債	(2	0.005	2025/12/1	国債	900,000	99.926	899,334,000
日本	第年)	455	回	利	付	国	債	(2	0.005	2025/12/1	国債	500,000	99.926	499,630,000
日本	第年)	456	回	利	付	国	債	(2	0.100	2026/1/1	国債	1,500,000	100.067	1,501,005,000
日本	第年)	150	回	利	付	国	債	(5	0.005	2026/12/20	国債	1,000,000	99.811	998,110,000
日本	第年)	151	回	利	付	国	債	(5	0.005	2027/3/20	国債	500,000	99.733	498,665,000
日本	第年)	153	回	利	付	国	債	(5	0.005	2027/6/20	国債	500,000	99.627	498,135,000
日本	第81回神奈川県公募公債(5年)									0.020	2025/3/19	地方債	100,000	99.919	99,919,000
日本	第287回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)									0.091	2026/9/11	特殊債	200,000	99.687	199,374,000
日本	第68回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)									0.355	2025/1/28	特殊債	100,000	100.245	100,245,000
日本	第72回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)									0.529	2025/5/28	特殊債	200,000	100.514	201,028,000
日本	第99回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)									0.225	2027/8/27	特殊債	200,000	99.719	199,438,000
日本	第35回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2021)									0.279	2026/10/21	社債券	100,000	98.314	98,314,000
日本	第6回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー(非上位円貨社債)(2019)									1.258	2024/1/25	社債券	100,000	99.997	99,997,000
日本	第15回クレディ・アグリコル・エス・エー期限前償還条項付非上位円貨社債(2024)									0.000	2028/1/26	社債券	200,000	100.001	200,002,000
日本	第12回ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー期限前償還条項付円貨社債(2023)									1.377	2027/12/1	社債券	200,000	99.9	199,800,000
日本	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債(2019)									0.463	2024/12/5	社債券	200,000	99.742	199,484,000
日本	第24回ルノー円貨社債(2021)									1.540	2024/7/5	社債券	200,000	100.327	200,654,000
日本	第508回関西電力(一般担保付)									0.455	2027/4/23	社債券	105,000	99.977	104,975,850
日本	第509回関西電力(一般担保付)									0.470	2027/5/25	社債券	100,000	100.003	100,003,000
日本	第477回東北電力(一般担保付)									0.741	2025/2/25	社債券	100,000	100.55	100,550,000
日本	第483回東北電力(一般担保付)									0.300	2026/5/25	社債券	200,000	99.849	199,698,000
日本	第503回九州電力(一般担保付)									0.360	2027/4/23	社債券	200,000	99.737	199,474,000
日本	第18回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)									0.340	2025/4/30	社債券	100,000	100.163	100,163,000
日本	第22回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)									0.130	2025/9/12	社債券	200,000	99.821	199,642,000
日本	第29回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)									0.210	2025/10/27	社債券	100,000	99.979	99,979,000

日本	第12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)	0.330	2027/6/11	社債券	200,000	99.656	199,312,000
日本	第12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)	0.330	2027/6/11	社債券	200,000	99.656	199,312,000
日本	第14回森ビル(社債間限定同順位特約付)	0.861	2024/8/14	社債券	100,000	100.345	100,345,000
日本	第12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)	0.781	2025/6/20	社債券	100,000	100.754	100,754,000
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)	0.190	2025/12/19	社債券	100,000	99.774	99,774,000
日本	第15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)	0.280	2027/12/20	社債券	200,000	99.184	198,368,000
日本	第63回神戸製鋼所(社債間限定同順位特約付)	0.924	2025/5/21	社債券	100,000	100.654	100,654,000
日本	第67回神戸製鋼所(社債間限定同順位特約付)	0.200	2026/6/10	社債券	100,000	99.245	99,245,000
日本	第19回日立製作所(社債間限定同順位特約付)	0.160	2027/3/12	社債券	200,000	99.183	198,366,000
日本	第18回デンソー(社債間限定同順位特約付)	0.315	2028/3/17	社債券	200,000	99.27	198,540,000
日本	第43回IHI(社債間限定同順位特約付)	0.200	2024/10/17	社債券	100,000	99.875	99,875,000
日本	第49回IHI(社債間限定同順位特約付)(トランジションボ)	0.390	2027/6/4	社債券	100,000	99.166	99,166,000
日本	第8回JA三井リース(社債間限定同順位特約付)	0.310	2024/9/13	社債券	100,000	100.062	100,062,000
日本	第25回JA三井リース(社債間限定同順位特約付)	0.390	2026/9/1	社債券	100,000	99.808	99,808,000
日本	第27回JA三井リース(社債間限定同順位特約付)	0.430	2027/1/25	社債券	100,000	99.822	99,822,000
日本	第78回伊藤忠商事(社債間限定同順位特約付)	0.785	2024/5/30	社債券	100,000	100.245	100,245,000
日本	第19回三井住友信託銀行(社債間限定同順位特約付)	0.140	2026/4/28	社債券	200,000	99.385	198,770,000
日本	第2回NTTファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.260	2026/12/18	社債券	200,000	99.588	199,176,000
日本	第16回NTTファイナンス(日本電信電話株式会社保証付)	0.180	2025/12/19	社債券	200,000	99.661	199,322,000
日本	第80回ホンダファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.260	2026/6/19	社債券	100,000	99.758	99,758,000
日本	第81回ホンダファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.389	2028/6/20	社債券	200,000	99.238	198,476,000
日本	第18回SBIホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.690	2024/5/30	社債券	100,000	100.011	100,011,000
日本	第25回SBIホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.600	2024/7/26	社債券	100,000	99.925	99,925,000
日本	第29回SBIホールディングス(社債間限定同順位特約付)	1.000	2025/7/22	社債券	100,000	99.995	99,995,000
日本	第96回トヨタファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.060	2026/4/15	社債券	100,000	99.436	99,436,000
日本	第100回トヨタファイナンス(社債間限定同等特約付)	0.370	2026/10/13	社債券	100,000	100.131	100,131,000
日本	第42回リコーリース(社債間限定同順位特約付)	0.390	2027/6/1	社債券	100,000	99.463	99,463,000
日本	第17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)	0.340	2026/7/31	社債券	200,000	99.371	198,742,000

日本	第20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)	0.590	2026/2/24	社債券	100,000	100.026	100,026,000
日本	第69回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	1.210	2024/9/26	社債券	100,000	100.62	100,620,000
日本	第79回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.290	2025/2/28	社債券	100,000	99.939	99,939,000
日本	第80回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.280	2026/2/26	社債券	100,000	99.55	99,550,000
日本	第84回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.550	2026/12/18	社債券	100,000	99.903	99,903,000
日本	第57回日立キャピタル(社債間限定同順位特約付)	0.616	2024/12/20	社債券	100,000	100.339	100,339,000
日本	第219回オリックス(社債間限定同順位特約付)	0.430	2026/11/27	社債券	100,000	99.977	99,977,000
日本	第1回三井住友ファイナンス&リース(社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)	0.170	2025/3/12	社債券	100,000	99.869	99,869,000
日本	第35回三井住友ファイナンス&リース(社債間限定同順位特約付)	0.709	2028/2/2	社債券	100,000	100.276	100,276,000
日本	第32回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付)	0.695	2024/10/25	社債券	100,000	100.36	100,360,000
日本	第75回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付)	0.220	2025/1/23	社債券	100,000	99.947	99,947,000
日本	第18回大和証券グループ本社(社債間限定同順位特約付)	0.871	2024/8/28	社債券	100,000	100.335	100,335,000
日本	第40回大和証券グループ本社(社債間限定同順位特約付)	0.575	2026/11/27	社債券	100,000	100.047	100,047,000
日本	第3回野村ホールディングス(担保提供制限等財務上特約無)	0.280	2026/9/4	社債券	100,000	98.948	98,948,000
日本	第27回野村ホールディングス	2.107	2025/9/24	社債券	100,000	102.451	102,451,000
日本	第37回イオンモール(社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)	1.107	2028/12/14	社債券	100,000	100.406	100,406,000
日本	第184回東日本旅客鉄道(社債間限定同順位特約付)	0.210	2025/10/14	社債券	100,000	99.922	99,922,000
日本	第184回東日本旅客鉄道(社債間限定同順位特約付)	0.210	2025/10/14	社債券	100,000	99.922	99,922,000
日本	第6回ファーストリテイリング(特定社債間限定同順位特約付)	0.220	2025/6/6	社債券	100,000	99.93	99,930,000
合 計					19,705,000		19,686,288,850

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)

2024年6月28日現在

資産総額	36,173,745,465円
負債総額	335,858,943円
純資産総額(-)	35,837,886,522円

発行済口数	23,555,694,114口
1口当たり純資産額(/)	1.5214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)

2024年6月28日現在

資産総額	35,948,250,747円
負債総額	270,000,000円
純資産総額(-)	35,678,250,747円
発行済口数	21,642,942,501口
1口当たり純資産額(/)	1.6485円

(参考) 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

2024年1月24日現在

資産総額	116,057,304円
負債総額	85,297円
純資産総額(-)	115,972,007円
発行済口数	110,668,573口
1口当たり純資産額(/)	1.0479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（2023年12月29日現在）

（中略）

(2) 会社の機構（2023年12月29日現在）

（以下略）

<訂正後>

(1) 資本金の額（2024年6月28日現在）

（中略）

(2) 会社の機構（2024年6月28日現在）

（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2023年12月29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	<u>51</u>	<u>1,560,457</u>
合計	<u>51</u>	<u>1,560,457</u>

<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2024年6月28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	<u>52</u>	<u>2,140,780</u>
合計	<u>52</u>	<u>2,140,780</u>

3【委託会社等の経理状況】

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

<訂正前>

1．財務諸表の作成方法について

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

財務諸表に記載している金額は、千円未満の端数を切捨てて表示しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自2022年7月1日 至2023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。中間財務諸表に記載している金額は、従来、千円未満の端数を切捨てて表示しておりましたが、当中間会計期間より百万円未満の端数を切捨てて表示することに変更いたしました。

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、第39期事業年度（自2022年7月1日 至2023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、第40期中間会計期間（自2023年7月1日 至2023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

(2023年12月31日現在)

科目	注記 番号	内訳 (百万円)	金額 (百万円)
(資産の部)			
・流動資産			
1.現金・預金			2,732
2.前払費用			73
3.未収入金			1,448

4.未収委託者報酬			5,291
5.未収運用受託報酬			658
6.立替金			16
7.未収消費税等	*2		48
流動資産計			10,268
.固定資産			
1.有形固定資産			2,470
建物	*1	1,753	
器具備品	*1	716	
2.投資その他の資産			720
(1)投資有価証券		1	
(2)保険積立金		14	
(3)長期差入保証金		411	
(4)繰延税金資産		294	
固定資産計			3,191
資産合計			13,459
(負債の部)			
.流動負債			
1.預り金			23
2.未払金			4,658
(1)未払手数料		3,227	
(2)その他未払金		1,430	
3.未払費用			224
4.未払法人税等			152
5.賞与引当金			496
6.役員賞与引当金			96
流動負債計			5,652
.固定負債			
1.長期未払費用			45
2.退職給付引当金			1,979
3.役員退職慰労引当金			21
4.資産除去債務			411
固定負債計			2,458
負債合計			8,110
(純資産の部)			
.株主資本			
1.資本金			450
2.資本剰余金			582
資本準備金		582	
3.利益剰余金			4,316
その他利益剰余金		4,316	
繰越利益剰余金		4,316	
株主資本計			5,349
純資産合計			5,349
負債・純資産合計			13,459

(2) 中間損益計算書

当中間会計期間

(自 2023年 7月 1日 至 2023年 12月31日)

科 目	注記 番号	内訳 (百万円)	金額 (百万円)
.営業収益			
1.委託者報酬			7,819
2.運用受託報酬			779
3.その他営業収益	*2		6,911
営業収益計			15,510
.営業費用			
1.支払手数料	*2		11,858
2.広告宣伝費			41
3.調査費			308
4.営業雑経費			49
(1)通信費		10	
(2)印刷費		29	
(3)協会費		9	
営業費用計			12,257
.一般管理費			
1.給料			1,522
(1)役員報酬		21	
(2)給料・手当		703	
(3)賞与		443	
(4)賞与引当金繰入額		306	
(5)役員賞与引当金繰入額		48	
2.交際費			24
3.旅費交通費			51
4.租税公課			29
5.不動産賃借料			302
6.退職給付費用			122
7.役員退職慰労引当金繰入額			3
8.固定資産減価償却費	*1		87
9.器具備品賃借料			5
10.消耗品費			33
11.事務委託費			65
12.採用費			12
13.福利厚生費			169
14.共通発生経費負担額	*3		226
15.諸経費			6
一般管理費計			2,661
営業利益			592
.営業外収益			
1.受取利息及び配当金			4
2.為替差益			13
営業外収益計			17
.営業外費用			
1.有価証券売却損			0
営業外費用計			0
経常利益			609
VI.特別利益			
1.固定資産売却益			5
特別利益計			5

税引前中間純利益			615
法人税、住民税及び事業税			127
法人税等調整額			100
中間純利益			387

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自2023年7月1日 至2023年12月31日）

(単位：百万円)

	株主資本						純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計	
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	450	582	582	3,928	3,928	4,961	4,961
当中間期変動額							
中間純利益				387	387	387	387
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	-	-	-	387	387	387	387
当中間期末残高	450	582	582	4,316	4,316	5,349	5,349

[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

市場価格のない株式等以外のもの

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。

(4)役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づき、当中間会計期間末における要支給額を計上しております。

5. 収益及び費用の計上基準

(1)委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識しています。当該報酬は時の経過と共に履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。当該報酬は毎月、年6回、年2回もしくは年1回受け取ります。

(2)運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、契約期間の純資産総額に対する一定割合として認識しています。当該報酬は時の経過と共に履行義務が充足されるという前提に基づき、投資顧問契約期間にわたり収益として認識しております。当該報酬は年4回、年2回もしくは年1回受け取ります。

なお、運用受託報酬には成功報酬が含まれる場合があります。成功報酬は、対象となる投資顧問契約の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益が発生した場合、超過運用益に対する一定割合として認識しています。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識し、年1回受け取ります。

(3)その他営業収益

その他営業収益は、当社がキャピタル・グループ各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）に対する対価であり、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、認識しております。当該収益は時の経過と共に履行義務が充足されるという前提に基づき、月次で収益として認識し、毎月受け取ります。

[表示方法の変更]

（表示単位の変更）

当中間会計期間より、金額の表示単位を千円単位から百万円単位へ変更しております。

[注記事項]

（中間貸借対照表関係）

当中間会計期間 （2023年12月31日現在）	
*1.有形固定資産の減価償却累計額	140百万円
*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、未収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2023年7月1日 至2023年12月31日）	
*1.減価償却実施額	
有形固定資産	87百万円
無形固定資産	0百万円
*2. 当社はキャピタル・グループの日本拠点として、キャピタル・リサーチ・アンド・マネージメント・カンパニー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。	
当社が各グループ会社に提供をしている各種投資運用サービスは、重要な会計方針の5(3)に記載の通りです。	
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2023年7月1日 至2023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2023年7月1日 至2023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 468 百万円

1年超 312 百万円

合計 781 百万円

[金融商品関係]

当中間会計期間

(2023年12月31日現在)

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 (百万円)	時価(百万円)	差額(百万円)
長期差入保証金	411	356	55

(注1)短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似する金融商品は注記を省略しております。

(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る場合、当該価額が異なることもあります。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場における相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

該当事項はありません。

(2)時価をもって中間貸借対照表価額としない金融商品

区分	時価(百万円)		
	レベル1	レベル2	レベル3
長期差入保証金	-	356	-

(注1)時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

主に本社事務所の貸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り算定する方法によっております。

[有価証券関係]

当中間会計期間
(2023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 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
その他有価証券 (証券投資信託)	1	1	-

[デリバティブ取引関係]

当中間会計期間
（自2023年7月1日 至2023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
（2023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	768百万円
時の経過による調整額	1百万円
資産除去債務の履行による減少額	359百万円
当中間会計期間末残高	411百万円

[収益認識関係]

当中間会計期間
（自2023年7月1日 至2023年12月31日）

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

委託者報酬	7,819百万円
運用受託報酬	779百万円
その他営業収益	6,911百万円
合計	15,510百万円

2. 収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は「重要な会計方針 5. 収益及び費用の計上基準」に記載しております。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュフローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

[セグメント情報等]

当中間会計期間
（自2023年7月1日 至2023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
8,582百万円	6,911百万円	16百万円	15,510百万円

(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	6,911百万円

[1株当たり情報]

当中間会計期間

(自2023年7月1日 至2023年12月31日)

1株当たり純資産額 94,843.44円

1株当たり中間純利益金額 6,870.91円

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

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

中間純利益 387百万円

普通株主に帰属しない金額 -百万円

普通株式に係る中間純利益 387百万円

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(2023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(2023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(2023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(2024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(2024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(2024年3月31日現在)
(以下略)

独立監査人の中間監査報告書

2024年7月24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 公認会計士 山田信之
行社員

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2023年11月21日から2024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2024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（2023年11月21日から2024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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2024年3月18日

キャピタル・インターナショナル株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之
業務執行社員

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、「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2023年7月1日から2024年6月30日までの第40期事業年度の中間会計期間（2023年7月1日から2023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。

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2023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（2023年7月1日から2023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。

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、会社から独立しており、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及び監査役の責任

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。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

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に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、企業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、監査役に対して、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

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．XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。