

【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】	平成30年8月17日提出
【発行者名】	キャピタル・インターナショナル株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 トーマス・クワントリル
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内二丁目1番1号 明治安田生命ビル
【事務連絡者氏名】	原田 伸健
【電話番号】	03(6366)1000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	キャピタル・グローバル・ボンド・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(平成30年2月16日から平成31年2月14日まで) 3,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、平成30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 >

(前略)

委託会社の概況 (2017年12月29日現在)

(以下略)

< 訂正後 >

(前略)

委託会社の概況 (2018年6月29日現在)

(以下略)

2【投資方針】

(2)【投資対象】

< 訂正前 >

(前略)

< 参考情報 2 > 投資対象ファンドの概要等

(中略)

上記は、2017年12月29日現在のものであり、今後、投資顧問会社等の判断その他理由により変更される場合があります。

(中略)

上記は、2017年12月29日現在のものであり、今後、委託会社の判断その他理由により変更される場合があります。

< 訂正後 >

(前略)

< 参考情報 2 > 投資対象ファンドの概要等

(中略)

上記は、2018年6月29日現在のものであり、今後、投資顧問会社等の判断その他理由により変更される場合があります。

(中略)

上記は、2018年6月29日現在のものであり、今後、委託会社の判断その他理由により変更される場合があります。

(3)【運用体制】

< 訂正前 >

（前略）

（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（2017年12月29日現在）

運用部（3名）／法務コンプライアンス部（2名）／オペレーション部（8名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

< 参考情報 >

投資対象ファンドにおける運用体制は、次のとおりです。

（中略）

2. 「日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」

運用は、三菱UFJ国際投信株式会社が行ないます。同社の運用体制は、次のとおりです。

投資環境会議において国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づく投資環境の見通しを策定し、運用戦略委員会にて運用戦略を決定します。各運用部は運用戦略に基づいて運用計画を決定し、担当ファンドマネジャーは運用部門から独立したトレーディング部に売買実行の指図を行ない、トレーディング部は事前チェックを行なったうえで最良執行を目指して売買を行ないます。運用部門は投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているか自律的なチェックを行ない、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また運用部門から独立した管理担当部署による各種モニタリング結果が運用管理委員会等を通じてフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

（中略）

上記は2017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）

（参考情報）

キャピタル・インターナショナル株式会社の運用部門等の人員体制（2018年6月29日現在）

運用部（3名）／法務コンプライアンス部（2名）／オペレーション部（8名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

< 参考情報 >

投資対象ファンドにおける運用体制は、次のとおりです。

（中略）

2. 「日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」

運用は、三菱UFJ国際投信株式会社が行ないます。同社の運用体制は、次のとおりです。

投資環境会議において国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づく投資環境の見通しを策定し、運用戦略委員会にて運用戦略を決定します。各運用部は運用戦略に基づいて運用計画を決定し、担当ファンドマネジャーは運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指図を行ない、トレーディング部は事前チェックを行なったうえで最良執行を目指して売買を行ないます。運用部門は投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているか自律的なチェックを行ない、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また運用部から独立した管理担当部署による各種モニタリング結果が運用管理委員会等を通じてフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

（中略）

上記は2018年6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。

3【投資リスク】

< 訂正前 >

(前略)

<参考情報> 投資対象ファンドにおけるリスク管理体制

1. キャピタル・グループのリスク管理体制

(中略)

2. 三菱UFJ国際投信株式会社の投資リスクに対する管理体制

三菱UFJ国際投信株式会社では、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門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っています。

(中略)

<流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立した管理担当部署であるトレーディング担当部署およびリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行ない、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

上記は2017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)

<参考情報> 投資対象ファンドにおけるリスク管理体制

1. キャピタル・グループのリスク管理体制

(中略)

2. 三菱UFJ国際投信株式会社の投資リスクに対する管理体制

三菱UFJ国際投信株式会社では、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っています。

(中略)

<流動性リスクに対する管理体制>

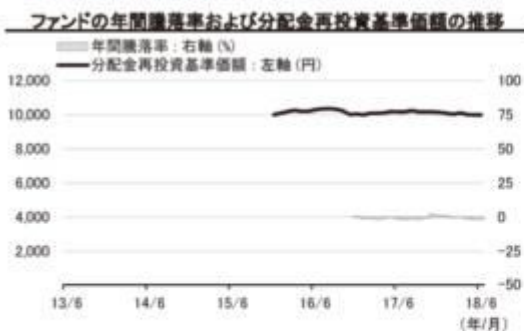
流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立したリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行ない、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

上記は2018年6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。

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

<更新・訂正後>

リスクの定量的比較



(注1) 年間騰落率は、2016年12月から2018年6月までの各月末における1年間の騰落率を表示したもので、分配金再投資基準価額を基に算出しています。
(注2) 分配金再投資基準価額は、設定日(2015年12月30日)を10,000として指数化しています。
(注3) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株・・・TOPIX(配当込み)

先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)

新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)

日本国債・・・NOMURA-BPI国債

先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本/円ベース)

新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

※ 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

「ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数について

「日本株」の資産クラスはTOPIX(配当込み)を表示しております。

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

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

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

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

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

「日本国債」の資産クラスはNOMURA-BPI国債を表示しております。

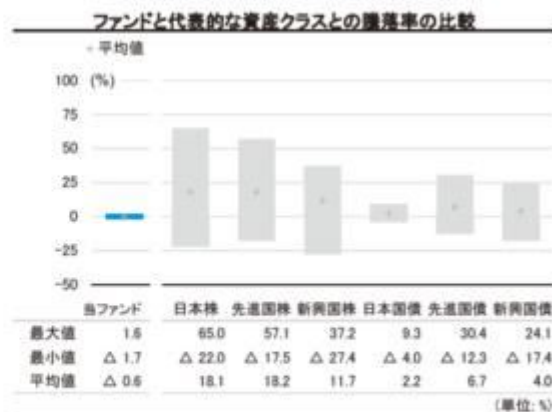
NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスを用いて行なわれる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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

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

「新興国債」の資産クラスはJPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(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。



(注1) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
(注2) 代表的な資産クラスの騰落率は、2013年7月から2018年6月までの5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
(注3) ファンドの騰落率は、2016年12月から2018年6月までの各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

課税上は、株式投資信託として取扱われ、個人受益者、法人受益者毎に以下の取扱いとなります。以下の取扱い内容は、2017年12月29日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご留意ください。

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

（以下略）

<訂正後>

課税上は、株式投資信託として取扱われ、個人受益者、法人受益者毎に以下の取扱いとなります。以下の取扱内容は、2018年6月29日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご注意ください。

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

（以下略）

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

（1）【投資状況】

キャピタル・グローバル・ボンド・ファンドF（限定為替ヘッジ）

平成30年 6月29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	28,112,948,826	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,708,904	0.04
合計(純資産総額)		28,101,239,922	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・ボンド・マザーファンド（限定為替ヘッジ）

平成30年 6月29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	22,873,993	0.08
投資証券	ルクセンブルク	28,089,704,323	99.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0	0.00
合計(純資産総額)		28,112,578,316	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・ボンド・ファンド（LUX）

平成30年6月29日現在

資産の種類	国/地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
	米国	18,066,242,957	40.46
	日本	5,332,495,963	11.94
	ポーランド	1,881,424,885	4.21

債券			
	ドイツ	1,851,949,612	4.15
	メキシコ	1,548,693,058	3.47
	英国	1,455,522,118	3.26
	インド	1,197,908,728	2.68
	スペイン	1,105,207,856	2.47
	マレーシア	903,012,032	2.02
	フランス	869,810,158	1.95
	イタリア	831,465,436	1.86
	ポルトガル	749,096,706	1.68
	ベルギー	697,575,619	1.56
	ルーマニア	692,791,228	1.55
	タイ	617,206,265	1.38
	韓国	588,231,679	1.32
	デンマーク	536,131,874	1.20
	中国	488,817,953	1.09
	カナダ	447,481,032	1.00
	オーストラリア	401,767,523	0.90
	イスラエル	347,247,146	0.78
	オランダ	334,193,719	0.75
	アイルランド	274,553,952	0.61
	国際機関	240,324,004	0.54
	チリ	231,793,474	0.52
	ペルー	211,168,640	0.47
	南アフリカ	204,379,109	0.46
	アラブ首長国連邦	162,184,973	0.36
	インドネシア	142,333,620	0.32
	ロシア	132,355,939	0.30
	スイス	132,289,387	0.30
	ウルグアイ	129,670,903	0.29
	ハンガリー	119,784,375	0.27
	コロンビア	104,628,155	0.23
	ノルウェー	98,146,684	0.22
	カタール	78,178,918	0.18
	チェコ共和国	73,905,799	0.17
	トルコ	72,320,958	0.16
	パナマ	71,890,208	0.16
	モロッコ	71,824,892	0.16
	サウジアラビア	70,676,679	0.16
	クウェート	70,002,455	0.16
	ブラジル	40,130,601	0.09
	スウェーデン	28,216,764	0.06
	銀行預金、その他資産（負債控除後）	950,587,237	2.13
	純資産総額	44,655,621,273	100.00

（注）投資比率は、キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・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

平成30年1月24日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
特殊債券	日本	99,978,000	4.15
社債券	日本	2,217,201,000	92.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		90,777,420	3.77
合計(純資産総額)		2,407,956,420	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（平成30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・ボンド・ファンドF（限定為替ヘッジ）

a. 上位30銘柄

平成30年 6月29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・ボ ンド・マザーファンド（限定為替 ヘッジ）	27,618,576,311	1.0279	28,390,985,900	1.0179	28,112,948,826	100.04

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

b. 種類別投資比率

平成30年 6月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

（参考）キャピタル・グローバル・ボンド・マザーファンド（限定為替ヘッジ）

a. 上位30銘柄

平成30年 6月29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・ボンド・ファンド（LUX） （クラスCh-JPY）	10,376,691.66	2,734.13	28,371,248,965	2,707	28,089,704,323	99.91
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）	21,689,734	1.0545	22,871,824	1.0546	22,873,993	0.08

(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

平成30年 6月29日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	0.08
投資証券	99.91
合計	100.00

（参考）キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド（LUX）

上位30銘柄

平成30年6月29日現在

順位	銘柄	利率(%) (上段) 償還日 (下段)	国/地域(上 段) 資産(中段) 業種/種類(下 段)	数量	評価単価(上 段) 通貨(下段)	評価金額(円)	投資 比率 (%)
1	US TREASURY NOTE	2.75 2028/2/15	米国 債券 国債証券	13,450,000	99.217 米ドル	1,474,721,305	3.30
2	JAPAN GVT 346 JPY BD	0.1 2027/3/20	日本 債券 国債証券	1,245,000,000	100.9419 日本円	1,256,726,655	2.81
3	US TREASURY NOTE	1.875 2022/9/30	米国 債券 国債証券	11,370,000	96.71575 米ドル	1,215,232,142	2.72
4	US TREASURY NOTE	2.375 2023/1/31	米国 債券 国債証券	8,800,000	98.55701 米ドル	958,455,095	2.15
5	US TREASURY NOTE	2.75 2023/4/30	米国 債券 国債証券	8,450,000	100.140115 米ドル	935,117,907	2.09
6	US TREASURY NOTE	2.25 2027/11/15	米国 債券 国債証券	7,900,000	95.130505 米ドル	830,516,897	1.86
7	POLAND GOVT BOND PLN	5.75 2021/10/25	ポーランド 債券 国債証券	24,945,000	111.965 ポーランド・ズ ロチ	817,693,760	1.83
8	US TREASURY NOTE	2.875 2028/5/15	米国 債券 国債証券	5,800,000	100.3125 米ドル	642,960,994	1.44
9	JAPAN GVT 57 JPY BD	0.8 2047/12/20	日本 債券 国債証券	612,300,000	102.4024 日本円	627,009,895	1.40
10	US TREASURY NOTE	2.125 2022/12/31	米国 債券 国債証券	5,555,000	97.52924 米ドル	598,715,473	1.34
11	US TREASURY NOTE	2.0 2022/10/31	米国 債券 国債証券	5,500,000	97.141875 米ドル	590,433,174	1.32
12	JAPAN GVT 337 JPY BD	0.3 2024/12/20	日本 債券 国債証券	520,000,000	102.4238 日本円	532,603,760	1.19
13	BONOS MEXICAN MXN	5.75 2026/3/5	メキシコ 債券 国債証券	106,100,000	89.115 メキシコ・ペソ	529,322,830	1.19
14	US TREASURY NOTE	1.125 2021/2/28	米国 債券 国債証券	4,925,000	96.24819 米ドル	523,842,084	1.17
15	US TREASURY NOTE	2.75 2023/5/31	米国 債券 国債証券	4,700,000	100.167775 米ドル	520,268,419	1.17
16	SPAIN GOVT EUR 144A LIFE/REG S	1.45 2027/10/31	スペイン 債券 国債証券	3,875,000	101.417 ユーロ	502,304,689	1.12
17	BONOS MEXICAN MXN	6.5 2021/6/10	メキシコ 債券 国債証券	92,400,000	96.753 メキシコ・ペソ	500,484,742	1.12
18	US TREASURY I/L	0.375 2027/1/15	米国 債券 国債証券	4,300,000	100.834827 米ドル	479,160,039	1.07
19	US TREASURY NOTE	1.875 2022/7/31	米国 債券 国債証券	4,450,000	96.84797 米ドル	476,268,778	1.07
20	DEUTSCHLAND REP EUR REG S (B)	1.25 2048/8/15	ドイツ 債券 国債証券	3,150,000	105.2003 ユーロ	423,557,424	0.95
21	FNCL 4.0 TBA 08/18	4.0 2046/8/1	米国 債券 その他債券	3,679,734	101.826168 米ドル	414,073,469	0.93

22	US TREASURY NOTE	2.375 2027/5/15	米国 債券 国債証券	3,875,000	96.37989 米ドル	412,723,989	0.92
23	MALAYSIA GVT MYR	3.9 2026/11/30	マレーシア 債券 国債証券	14,972,000	96.7527 マレーシア・リ ンギット	395,754,594	0.89
24	JAPAN GVT 145 JPY BD	1.7 2033/6/20	日本 債券 国債証券	325,000,000	120.9483 日本円	393,081,975	0.88
25	US TREASURY I/L FRN	0.625 2024/1/15	米国 債券 国債証券	3,280,000	107.279739 米ドル	388,859,875	0.87
26	JAPAN GVT I/L 18 JPY	0.1 2024/3/10	日本 債券 国債証券	360,000,000	107.72212 日本円	387,799,632	0.87
27	PORTUGAL GOVT EUR 144A LIFE/REG S	4.125 2027/4/14	ポルトガル 債券 国債証券	2,475,000	120.132 ユーロ	380,030,695	0.85
28	PORTUGAL GOVT EUR 144A LIFE/REG S	2.875 2025/10/15	ポルトガル 債券 国債証券	2,600,000	111.057 ユーロ	369,066,011	0.83
29	POLAND GOVT BOND PLN	1.5 2020/4/25	ポーランド 債券 国債証券	12,100,000	99.95 ポーランド・ズ ロチ	354,073,202	0.79
30	JAPAN GVT 325 JPY BD	0.8 2022/9/20	日本 債券 国債証券	340,000,000	103.8746 日本円	353,173,640	0.79

(注) 投資比率は、キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・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

平成30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41回東日本高速 道路	0.005	2019/6/20	特殊債券	100,000	99.978	99,978,000	4.15
日本	第16回フランス相 互信用連合銀行円 貨社債(2015)	0.269	2018/10/15	社債券	100,000	100.099	100,099,000	4.16
日本	第1回バンコ・サ ンタンデール・エ セ・アー非上位円 貨社債(2017)	0.568	2023/1/11	社債券	100,000	100.063	100,063,000	4.16
日本	第9回モルガン・ スタンレー円貨社 債(2014)	0.557	2018/5/22	社債券	100,000	100.139	100,139,000	4.16
日本	第19回ルノー円貨 社債(2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	100.232	100,232,000	4.16
日本	第1回ソシエテ・ ジェネラル非上位 円貨社債(2017)	0.448	2022/5/26	社債券	100,000	100.442	100,442,000	4.17
日本	第237回四国電力 社債(一般担保 付)	2.05	2018/11/22	社債券	100,000	101.654	101,654,000	4.22

日本	第316回北海道電力	1.164	2020/6/25	社債券	100,000	102.503	102,503,000	4.26
日本	第5回ヤフー(社債間限定同順位特約付)	0.2	2022/12/7	社債券	100,000	99.837	99,837,000	4.15
日本	第4回富士フイルムホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.005	2020/3/3	社債券	100,000	99.808	99,808,000	4.14
日本	第50回日本電気(社債間限定同順位特約付)	0.29	2022/6/15	社債券	100,000	100.043	100,043,000	4.15
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	100.072	100,072,000	4.16
日本	第1回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.12	2020/10/30	社債券	100,000	99.993	99,993,000	4.15
日本	第66回クレディセゾン(社債間限定同順位特約付)	0.09	2020/12/22	社債券	100,000	99.904	99,904,000	4.15
日本	第7回あおぞら銀行(社債間限定同順位特約付)	0.08	2019/9/9	社債券	100,000	99.941	99,941,000	4.15
日本	第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	104.01	104,010,000	4.32
日本	第6回りそな銀行(劣後特約付)	2.084	2020/3/4	社債券	100,000	103.917	103,917,000	4.32
日本	第8回三井住友信託銀行(社債間限定同順位特約付)	0.234	2019/7/22	社債券	100,000	100.279	100,279,000	4.16
日本	第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	104.036	104,036,000	4.32
日本	第38回日産フィナンシャルサービス(社債間限定同順位特約付)	0.001	2019/6/20	社債券	100,000	99.726	99,726,000	4.14
日本	第67回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.5	2019/6/6	社債券	100,000	100.221	100,221,000	4.16
日本	第69回日立キャピタル(社債間限定同順位特約付)	0.08	2020/12/18	社債券	100,000	99.905	99,905,000	4.15
日本	第43回野村ホールディングス	0.454	2019/2/25	社債券	100,000	100.377	100,377,000	4.17

(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(平成30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・ボンド・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・ボンド・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・ボンド・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・ボンド・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・ボンド・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 （平成28年11月21日）	3,184,794,066	3,184,794,066	0.9994	0.9994
第2期 （平成29年11月20日）	19,110,060,395	19,110,060,395	1.0153	1.0153
平成29年 6月末日	10,599,060,202		1.0164	
7月末日	11,677,515,012		1.0168	
8月末日	14,972,476,366		1.0238	
9月末日	16,354,539,189		1.0165	
10月末日	17,711,185,901		1.0163	
11月末日	20,573,295,501		1.0167	
12月末日	18,067,994,027		1.0129	
平成30年 1月末日	20,271,397,603		1.0084	
2月末日	24,333,826,159		1.0032	
3月末日	27,004,655,364		1.0108	
4月末日	27,730,901,114		1.0005	
5月末日	27,470,671,251		1.0001	
6月末日	28,101,239,922		0.9997	

（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・ボンド・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	平成27年12月30日～平成28年11月21日	0
第2期	平成28年11月22日～平成29年11月20日	0

【収益率の推移】

キャピタル・グローバル・ボンド・ファンドF（限定為替ヘッジ）

期	計算期間	収益率（％）
第1期	平成27年12月30日～平成28年11月21日	0.1
第2期	平成28年11月22日～平成29年11月20日	1.6
第3中間計算期間末	平成29年11月21日～平成30年 5月20日	2.2

(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・ボンド・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	平成27年12月30日～平成28年11月21日	3,231,682,126	44,994,811	3,186,687,315
第2期	平成28年11月22日～平成29年11月20日	16,726,579,299	1,091,922,289	18,821,344,325
第3中間計算期間末	平成29年11月21日～平成30年 5月20日	15,861,510,535	7,938,100,465	26,744,754,395

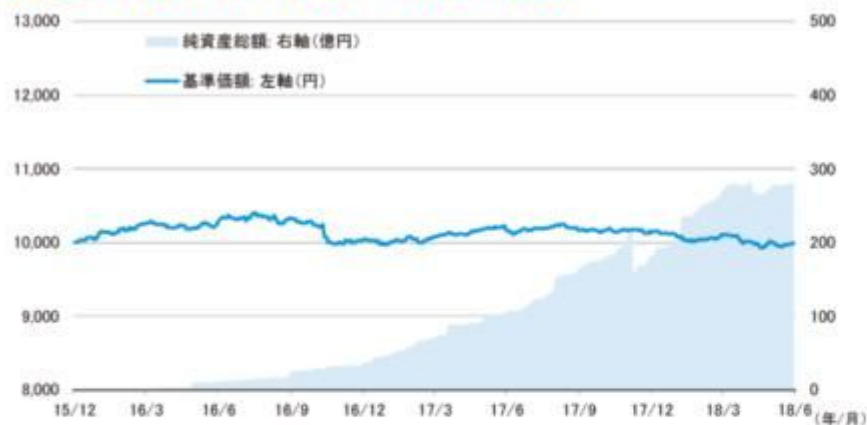
(注)第1期の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(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

2018年6月29日現在

基準価額・純資産の推移(設定～2018年6月29日)



分配金の推移

第1期	2016年11月	0円
第2期	2017年11月	0円
	設定来累計	0円
分配金は1万円当たり、税引前		

主要な資産の状況(2018年6月29日現在)

<キャピタル・グローバル・ボンド・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・ボンド・ファンド(LUX)(クラスOf-JPY)	99.91
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.08

<キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド(LUX)の主要な資産の状況等>

(2018年6月29日現在)

上位10銘柄

順位	銘柄名	国名/地域名	証券種別	投資比率(%)
1	US TREASURY NOTE 2.75% 02-15-28	米国	国債証券	3.30
2	JAPAN GVT 346 JPY BD 0.1% 03-20-27	日本	国債証券	2.81
3	US TREASURY NOTE 1.875% 09-30-22	米国	国債証券	2.72
4	US TREASURY NOTE 2.375% 01-31-23	米国	国債証券	2.15
5	US TREASURY NOTE 2.75% 04-30-23	米国	国債証券	2.09
6	US TREASURY NOTE 2.25% 11-15-27	米国	国債証券	1.86
7	POLAND GOVT BOND PLN 5.75% 10-25-21	ポーランド	国債証券	1.83
8	US TREASURY NOTE 2.875% 05-15-28	米国	国債証券	1.44
9	JAPAN GVT 57 JPY BD 0.8% 12-20-47	日本	国債証券	1.40
10	US TREASURY NOTE 2.125% 12-31-22	米国	国債証券	1.34

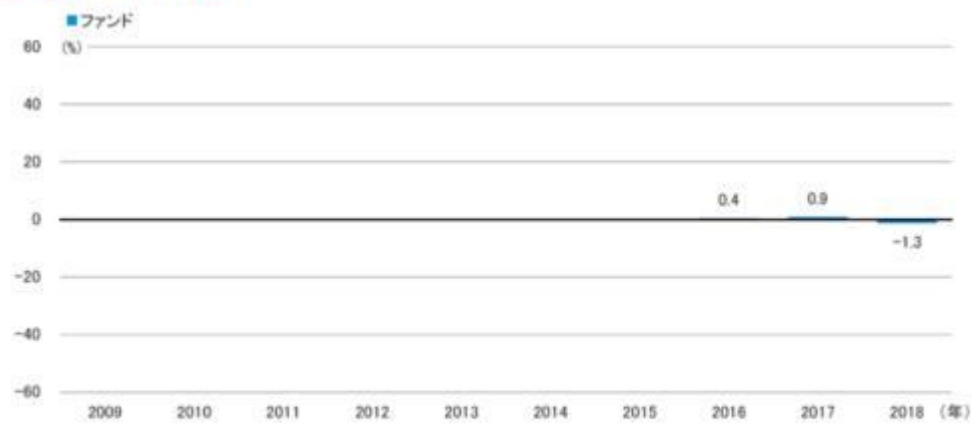
証券種別構成比率

証券種別	投資比率(%)
国債証券	81.32
社債券	12.69
その他証券	3.86
現金・その他	2.13

国別構成比率

国名	投資比率(%)
米国	40.46
日本	11.94
ポーランド	4.21
ドイツ	4.15
メキシコ	3.47
その他国	33.84
現金・その他	2.13

年間収益率の推移



ファンドにはベンチマークはありません。

ファンドの年間収益率は、税引前分配金を再投資したものとして算出。

2018年は6月末までの収益率を表示。

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

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

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間（平成29年11月21日から平成30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・ボンド・ファンドF（限定為替ヘッジ）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 平成29年11月20日現在	第3期中間計算期間 平成30年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	4,359,188
コール・ローン	737,325,403	111,902,242
親投資信託受益証券	19,049,835,520	26,492,063,831
流動資産合計	19,787,160,923	26,608,325,261
資産合計		
19,787,160,923		
負債の部		
流動負債		
未払金	644,420,000	-
未払解約金	-	3,365
未払受託者報酬	1,476,484	2,460,126
未払委託者報酬	30,267,811	50,432,427
未払利息	2,020	919
その他未払費用	934,213	937,761
流動負債合計	677,100,528	53,834,598
負債合計		
677,100,528		
純資産の部		
元本等		
元本	18,821,344,325	26,744,754,395
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	288,716,070	190,263,732
元本等合計	19,110,060,395	26,554,490,663
純資産合計		
19,110,060,395		
負債純資産合計		
19,787,160,923		
26,608,325,261		

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	第2期中間計算期間 自 平成28年11月22日 至 平成29年 5月21日	第3期中間計算期間 自 平成29年11月21日 至 平成30年 5月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	109,149,481	487,996,689
営業収益合計	109,149,481	487,996,689
営業費用		
支払利息	76,017	254,874
受託者報酬	615,462	2,460,126
委託者報酬	12,617,030	50,432,427
その他費用	978,299	942,645
営業費用合計	14,286,808	54,090,072
営業利益又は営業損失（ ）	94,862,673	542,086,761
経常利益又は経常損失（ ）	94,862,673	542,086,761
中間純利益又は中間純損失（ ）	94,862,673	542,086,761
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（ ）	403,645	18,982,947
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,893,249	288,716,070
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,554,167	161,435,017
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	35,554,167	161,435,017
剰余金減少額又は欠損金増加額	38,694	117,311,005
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	38,694	117,311,005
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（ ）	128,081,252	190,263,732

(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2期 平成29年11月20日現在	第3期中間計算期間 平成30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 18,821,344,325口	1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数 26,744,754,395口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損 - 円	2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損 190,263,732円
3. 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 1.0153円 (1万口当たり純資産額) (10,153円)	3. 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 0.9929円 (1万口当たり純資産額) (9,929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2期 自 平成28年11月22日 至 平成29年11月20日	第3期中間計算期間 自 平成29年11月21日 至 平成30年 5月20日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

当ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第2期	第3期中間計算期間
	自 平成28年11月22日 至 平成29年11月20日	自 平成29年11月21日 至 平成30年 5月20日
期首元本額	3,186,687,315円	18,821,344,325円
期中追加設定元本額	16,726,579,299円	15,861,510,535円
期中一部解約元本額	1,091,922,289円	7,938,100,465円

(参考)

キャピタル・グローバル・ボンド・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・ボンド・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)

平成30年 5月20日現在

資産の部	
流動資産	
投資信託受益証券	22,889,176
投資証券	26,468,466,811
流動資産合計	26,491,355,987
資産合計	26,491,355,987
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	26,219,382,256
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	271,973,731
元本等合計	26,491,355,987
純資産合計	26,491,355,987
負債純資産合計	26,491,355,987

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年 5月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数		26,219,382,256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	1.0104円
	(1万口当たり純資産額)	(10,104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 平成29年11月21日 至 平成30年 5月20日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) 投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	平成30年 5月20日現在
同計算期間の期首元本額	18,482,425,071円
同計算期間の追加設定元本額	14,537,215,330円
同計算期間の一部解約元本額	6,800,258,145円
計算日の元本額	26,219,382,256円
元本額の内訳	
キャピタル・グローバル・ボンド・ファンド（限定為替ヘッジ）	26,219,382,256円

キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド（LUX）

「キャピタル・グローバル・ボンド・マザーファンド（限定為替ヘッジ）」は、円建ての「キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド（LUX）（クラスC h J P Y）」（ルクセンブルク籍外国投資法人（以下、当外国投資法人といいます。）の発行する外国投資証券）を主な投資対象としております。

当外国投資法人を含むアンブレラファンド（CIF）については、2017年12月31日付けで、ルクセンブルクにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務書類が作成されております。この財務書類は独立監査人であるプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コオペラティブの監査を受けております。以下の「投資明細表」「純資産価額計算書」「損益および純資産変動計算書」および「投資証券口数変動計算書」等は、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・ボンド・ファンド（LUX）

投資明細表

2017年12月31日現在

投資銘柄	通貨	数量/額面	評価額 (USD)	投資比率 (%)
公的な市場に上場している譲渡可能な有価証券と短期金融商品				
債券				
オーストラリア				
Australia Government Bond, Reg. S 5.75% 15/05/2021	AUD	1,510,000	1,314,077	0.49
Australia Government Bond, Reg. S 5.75% 15/07/2022	AUD	3,300,000	2,955,706	1.10
			4,269,783	1.59
ベルギー				
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. 3.65% 01/02/2026	USD	260,000	268,703	0.10
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. 4.9% 01/02/2046	USD	60,000	69,756	0.03
Belgium Government Bond, Reg. S, 144A 1% 22/06/2026	EUR	995,000	1,247,497	0.46
Belgium Government Bond, Reg. S 2.25% 22/06/2023	EUR	170,000	229,496	0.09
			1,815,452	0.68
ブラジル				
Vale Overseas Ltd. 6.25% 10/08/2026	USD	335,000	388,935	0.14
			388,935	0.14
カナダ				
Canada Government Bond 2.25% 01/06/2025	CAD	2,840,000	2,299,315	0.86
Enbridge, Inc. 4.25% 01/12/2026	USD	55,000	57,599	0.02
Province of Quebec Canada 2.375% 31/01/2022	USD	289,000	287,994	0.11

TransCanada PipeLines Ltd. 6.5% 15/08/2018	USD	90,000	92,440	0.03
			2,737,348	1.02
チリ				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4.5% 01/03/2021	CLP	1,365,000,000	2,272,603	0.84
Chile Government Bond 3.86% 21/06/2047	USD	200,000	205,900	0.08
Enel Americas SA 4% 25/10/2026	USD	75,000	76,520	0.03
			2,555,023	0.95
中国				
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd., 144A 3.5% 04/05/2027	USD	700,000	703,939	0.26
			703,939	0.26
コロンビア				
Colombian TES 7.5% 26/08/2026	COP	2,820,000,000	1,011,257	0.38
			1,011,257	0.38
デンマーク				
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 2% 01/10/2037	DKK	1,943,600	326,403	0.12
Nykredit Realkredit A/S 2% 01/10/2037	DKK	7,667,732	1,288,006	0.48
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 2.5% 01/10/2047	DKK	3,166,980	531,726	0.20
Realkredit Danmark A/S 2% 01/10/2037	DKK	8,344,317	1,402,330	0.52
			3,548,465	1.32
フランス				
AXA SA, Reg. S, FRN 5.453% Perpetual	GBP	380,000	587,861	0.22
BPCE SA, 144A 5.15% 21/07/2024	USD	632,000	686,097	0.26
France Government Bond OAT, Reg. S, 144A 2% 25/05/2048	EUR	300,000	380,387	0.14
France Government Bond OAT, Reg. S 2.25% 25/05/2024	EUR	220,000	299,843	0.11
France Government Bond OAT, Reg. S 0.5% 25/05/2026	EUR	1,100,000	1,326,056	0.49
France Government Bond OAT, Reg. S 2.011% 25/07/2027	EUR	825,000	1,370,155	0.51
Orange SA, Reg. S, FRN 5% Perpetual	EUR	270,000	384,844	0.14
			5,035,243	1.87
ドイツ				
Allianz SE, Reg. S, FRN 4.75% Perpetual	EUR	500,000	714,401	0.27
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 2% 04/01/2022	EUR	1,550,000	2,036,094	0.76
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.5% 15/02/2026	EUR	825,000	1,012,863	0.38
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 2.5% 15/08/2046	EUR	1,400,000	2,206,162	0.82
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 1.25% 15/08/2048	EUR	550,000	658,550	0.24
Daimler Finance North America LLC, Reg. S 2.2% 30/10/2021	USD	300,000	294,778	0.11
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Reg. S 0.1% 15/04/2023	EUR	250,000	341,417	0.13
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Reg. S 0.1% 15/04/2026	EUR	3,350,000	4,560,223	1.70
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.125% 07/03/2022	USD	383,000	380,639	0.14
Volkswagen International Finance NV, Reg. S 1.125% 02/10/2023	EUR	200,000	245,247	0.09
			12,450,374	4.64
ハンガリー				
Hungary Government Bond 5.375% 25/03/2024	USD	1,020,000	1,155,849	0.43
			1,155,849	0.43
インド				
India Government Bond 7.8% 11/04/2021	INR	225,500,000	3,619,193	1.35
India Government Bond 7.35% 22/06/2024	INR	20,000,000	313,544	0.12
India Government Bond 6.97% 06/09/2026	INR	167,000,000	2,566,668	0.95
State of Maharashtra India 9.63% 12/02/2024	INR	11,500,000	197,220	0.07
State of Maharashtra India 8.21% 09/12/2025	INR	20,000,000	320,592	0.12

State of Maharashtra India 8.51% 09/03/2026	INR	24,300,000	396,719	0.15
			7,413,936	2.76
インドネシア				
Indonesia Government Bond, Reg. S 4.75% 08/01/2026	USD	1,270,000	1,382,829	0.51
			1,382,829	0.51
アイルランド				
Ireland Government Bond 5.4% 13/03/2025	EUR	330,000	535,201	0.20
Ireland Government Bond, Reg. S 3.9% 20/03/2023	EUR	915,000	1,316,313	0.49
Ireland Government Bond, Reg. S 3.4% 18/03/2024	EUR	30,000	42,998	0.01
Ireland Government Bond, Reg. S 2.4% 15/05/2030	EUR	140,000	193,647	0.07
Ireland Government Bond, Reg. S 2% 18/02/2045	EUR	165,000	208,132	0.08
			2,296,291	0.85
イスラエル				
Israel Government Bond 2% 31/03/2027	ILS	4,625,000	1,369,672	0.51
Israel Government Bond 5.5% 31/01/2042	ILS	1,300,000	555,141	0.21
			1,924,813	0.72
イタリア				
Assicurazioni Generali SpA, Reg. S, FRN 7.75% 12/12/2042	EUR	200,000	310,031	0.12
Intesa Sanpaolo SpA, Reg. S 6.625% 13/09/2023	EUR	325,000	490,236	0.18
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.9% 01/08/2022	EUR	1,900,000	2,297,384	0.86
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 15/09/2022	EUR	510,000	631,755	0.23
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 15/03/2023	EUR	3,830,000	4,604,547	1.71
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.5% 01/03/2024	EUR	1,750,000	2,505,800	0.93
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.5% 01/06/2025	EUR	400,000	478,441	0.18
			11,318,194	4.21
日本				
Japan Government Ten Year Bond 1.2% 20/06/2021	JPY	90,000,000	835,243	0.31
Japan Government Ten Year Bond 0.8% 20/09/2022	JPY	340,000,000	3,146,531	1.17
Japan Government Ten Year Bond 0.8% 20/06/2023	JPY	65,000,000	605,246	0.23
Japan Government Ten Year Bond 0.3% 20/12/2024	JPY	120,000,000	1,091,596	0.41
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/09/2026	JPY	130,000,000	1,163,276	0.43
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/03/2027	JPY	235,000,000	2,101,122	0.78
Japan Government Thirty Year Bond 1.7% 20/03/2044	JPY	15,000,000	163,942	0.06
Japan Government Thirty Year Bond 0.6% 20/12/2046	JPY	265,000,000	2,236,835	0.83
Japan Government Twenty Year Bond 2.2% 20/03/2030	JPY	125,000,000	1,382,607	0.52
Japan Government Twenty Year Bond 1.7% 20/06/2033	JPY	260,000,000	2,785,883	1.04
			15,512,281	5.78
クウェート				
Kuwait Government Bond, 144A 2.75% 20/03/2022	USD	650,000	648,603	0.24
			648,603	0.24
メキシコ				
Mexican Bonos 6.5% 10/06/2021	MXN	83,600,000	4,110,803	1.53
Mexican Bonos 6.5% 09/06/2022	MXN	5,000,000	243,664	0.09
Mexican Bonos 10% 05/12/2024	MXN	34,800,000	1,996,728	0.74
Mexican Bonos 5.75% 05/03/2026	MXN	79,000,000	3,555,593	1.33
Mexican Bonos 10% 20/11/2036	MXN	5,200,000	323,020	0.12
Mexican Udibonos 4% 15/11/2040	MXN	1,100,000	349,236	0.13
Mexico Government Bond 4.125% 21/01/2026	USD	470,000	490,563	0.18
			11,069,607	4.12
モロッコ				
Morocco Government Bond, Reg. S 4.25% 11/12/2022	USD	650,000	686,894	0.26
			686,894	0.26
オランダ				

Cooperatieve Rabobank UA, Reg. S 3.875% 25/07/2023	EUR	250,000	349,830	0.13
NN Group NV, Reg. S, FRN 4.5% Perpetual	EUR	360,000	488,168	0.18
			837,998	0.31
ノルウェー				
Norway Government Bond, Reg. S, 144A 3.75% 25/05/2021	NOK	38,310,000	5,110,787	1.90
Norway Government Bond, Reg. S, 144A 3% 14/03/2024	NOK	1,450,000	194,565	0.07
Statoil ASA 3.7% 01/03/2024	USD	100,000	105,126	0.04
			5,410,478	2.01
ポーランド				
Poland Government Bond 1.5% 25/04/2020	PLN	12,275,000	3,499,183	1.30
Poland Government Bond 5.25% 25/10/2020	PLN	4,930,000	1,542,471	0.57
Poland Government Bond 5.75% 25/10/2021	PLN	15,720,000	5,090,896	1.90
Poland Government Bond 5.75% 23/09/2022	PLN	3,000,000	984,645	0.37
Poland Government Bond 4% 25/10/2023	PLN	3,140,000	962,084	0.36
Poland Government Bond 3.25% 25/07/2025	PLN	3,000,000	869,720	0.32
Poland Government Bond 3.25% 06/04/2026	USD	700,000	716,261	0.27
			13,665,260	5.09
ポルトガル				
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, Reg. S, 144A 2.875% 15/10/2025	EUR	1,800,000	2,384,137	0.89
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, Reg. S, 144A 4.125% 14/04/2027	EUR	2,775,000	3,955,305	1.47
			6,339,442	2.36
南アフリカ				
South Africa Government Bond 6.5% 28/02/2041	ZAR	23,900,000	1,365,231	0.51
			1,365,231	0.51
韓国				
Korea Housing Finance Corp., Reg. S 2% 11/10/2021	USD	590,000	568,076	0.21
Korea Treasury 2% 10/09/2022	KRW	1,420,900,000	1,308,040	0.49
			1,876,116	0.70
スペイン				
BBVA Subordinated Capital SAU, Reg. S, FRN 3.5% 11/04/2024	EUR	200,000	249,926	0.09
CaixaBank SA, Reg. S, FRN 5% 14/11/2023	EUR	100,000	124,729	0.05
Spain Government Bond, Reg. S, 144A 3.8% 30/04/2024	EUR	325,000	464,239	0.17
Spain Government Bond, Reg. S, 144A 1.3% 31/10/2026	EUR	2,005,000	2,403,197	0.90
			3,242,091	1.21
国際機関				
European Investment Bank 2.25% 15/03/2022	USD	413,000	411,497	0.15
			411,497	0.15
スウェーデン				
Sweden Government Bond, Reg. S 1.125% 21/10/2019	USD	260,000	255,935	0.10
			255,935	0.10
スイス				
Credit Suisse Group AG, Reg. S, FRN 2.125% 12/09/2025	GBP	360,000	483,400	0.18
			483,400	0.18
タイ				
Bank of Thailand 1.49% 28/08/2019	THB	49,400,000	1,516,210	0.57
Thailand Government Bond 1.875% 17/06/2022	THB	12,500,000	385,469	0.14
Thailand Government Bond 3.85% 12/12/2025	THB	21,400,000	733,969	0.27
Thailand Government Bond 2.125% 17/12/2026	THB	15,000,000	453,277	0.17
			3,088,925	1.15
トルコ				
Turkey Government Bond 9.2% 22/09/2021	TRY	2,430,000	584,501	0.22
Turkey Government Bond 3.178% 08/05/2024	TRY	750,000	263,510	0.10
			848,011	0.32
アラブ首長国連邦				

Abu Dhabi National Energy Co. PJSC, Reg. S 3.625% 12/01/2023	USD	810,000	821,424	0.31
			821,424	0.31
英国				
Aviva plc, Reg. S, FRN 6.125% 05/07/2043	EUR	325,000	485,515	0.18
Barclays Bank plc, Reg. S 10% 21/05/2021	GBP	225,000	381,687	0.14
HSBC Holdings plc, FRN 3.033% 22/11/2023	USD	500,000	501,276	0.19
Lloyds Bank plc, Reg. S 6.5% 24/03/2020	EUR	150,000	205,291	0.08
Shell International Finance BV 1.375% 12/09/2019	USD	340,000	335,877	0.12
Shell International Finance BV 2.5% 12/09/2026	USD	400,000	387,795	0.14
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/09/2021	USD	350,000	344,758	0.13
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.2% 23/09/2026	USD	105,000	102,829	0.04
UK Treasury, Reg. S 1.75% 07/09/2022	GBP	200,000	282,870	0.11
UK Treasury, Reg. S 4.25% 07/12/2027	GBP	800,000	1,389,013	0.52
UK Treasury, Reg. S 3.25% 22/01/2044	GBP	160,000	281,393	0.10
UK Treasury, Reg. S 3.5% 22/01/2045	GBP	485,000	894,737	0.33
UK Treasury, Reg. S 4.25% 07/12/2046	GBP	230,000	483,782	0.18
			6,076,823	2.26
アメリカ合衆国				
Abbott Laboratories 3.75% 30/11/2026	USD	500,000	514,240	0.19
AbbVie, Inc. 2.5% 14/05/2020	USD	190,000	190,679	0.07
AbbVie, Inc. 3.6% 14/05/2025	USD	200,000	205,890	0.08
AbbVie, Inc. 3.2% 14/05/2026	USD	300,000	299,578	0.11
Allergan Funding SCS 3.45% 15/03/2022	USD	125,000	127,111	0.05
Allergan Funding SCS 3.8% 15/03/2025	USD	700,000	713,557	0.27
Allergan Funding SCS 4.55% 15/03/2035	USD	68,000	72,120	0.03
Allergan Funding SCS 4.75% 15/03/2045	USD	15,000	16,016	0.01
Altria Group, Inc. 2.625% 14/01/2020	USD	350,000	352,338	0.13
American Campus Communities Operating Partnership LP, REIT 3.75% 15/04/2023	USD	600,000	615,991	0.23
AT&T, Inc. 3.9% 14/08/2027	USD	615,000	620,139	0.23
AT&T, Inc. 4.9% 14/08/2037	USD	510,000	518,732	0.19
Bank of America Corp. 2.625% 19/10/2020	USD	120,000	121,047	0.04
Bank of America Corp. 3.875% 01/08/2025	USD	330,000	348,353	0.13
Becton Dickinson and Co. 3.734% 15/12/2024	USD	81,000	83,064	0.03
Berkshire Hathaway Finance Corp. 3% 15/05/2022	USD	125,000	127,944	0.05
Chevron Corp. 2.954% 16/05/2026	USD	175,000	175,089	0.07
Chubb INA Holdings, Inc. 2.875% 03/11/2022	USD	20,000	20,283	0.01
Chubb INA Holdings, Inc. 3.35% 03/05/2026	USD	20,000	20,427	0.01
Citigroup, Inc. 2.75% 25/04/2022	USD	700,000	699,203	0.26
Citigroup, Inc. 3.3% 27/04/2025	USD	100,000	101,072	0.04
CMS Energy Corp. 3.6% 15/11/2025	USD	175,000	179,414	0.07
Duke Energy Corp. 3.75% 15/04/2024	USD	155,000	162,069	0.06
Duke Energy Corp. 2.65% 01/09/2026	USD	470,000	451,074	0.17
Enbridge Energy Partners LP 5.875% 15/10/2025	USD	155,000	175,788	0.07
Energy Transfer LP 4.2% 15/04/2027	USD	30,000	29,893	0.01
Essex Portfolio LP, REIT 3.5% 01/04/2025	USD	120,000	121,188	0.04
Exelon Corp. 3.497% 01/06/2022	USD	610,000	622,196	0.23
Exelon Corp. 3.4% 15/04/2026	USD	60,000	60,112	0.02
FirstEnergy Corp. 3.9% 15/07/2027	USD	390,000	400,274	0.15
FirstEnergy Corp. 4.85% 15/07/2047	USD	210,000	235,099	0.09
Ford Motor Credit Co. LLC 3.2% 15/01/2021	USD	200,000	202,927	0.08
Ford Motor Credit Co. LLC 3.339% 28/03/2022	USD	500,000	506,218	0.19
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 2.875% 25/02/2021	USD	100,000	100,804	0.04
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.85% 08/07/2024	USD	200,000	207,584	0.08
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.75% 25/02/2026	USD	15,000	15,414	0.01
Halliburton Co. 3.8% 15/11/2025	USD	50,000	52,037	0.02
Honeywell International, Inc. 1.85% 01/11/2021	USD	450,000	442,025	0.16
JPMorgan Chase & Co. 2.55% 01/03/2021	USD	440,000	440,387	0.16
Kimco Realty Corp., REIT 3.4% 01/11/2022	USD	5,000	5,104	-
Kimco Realty Corp., REIT 2.7% 01/03/2024	USD	75,000	72,704	0.03
Kinder Morgan, Inc. 3.05% 01/12/2019	USD	450,000	454,091	0.17
Kinder Morgan, Inc. 4.3% 01/06/2025	USD	240,000	250,319	0.09
McDonald's Corp. 3.7% 30/01/2026	USD	30,000	31,317	0.01

Medtronic, Inc. 3.5% 15/03/2025	USD	470,000	487,904	0.18
Morgan Stanley 4% 23/07/2025	USD	70,000	73,348	0.03
Morgan Stanley 3.125% 27/07/2026	USD	260,000	256,662	0.10
Newell Brands, Inc. 3.85% 01/04/2023	USD	5,000	5,179	-
Newell Brands, Inc. 4.2% 01/04/2026	USD	515,000	538,283	0.20
Oracle Corp. 3.25% 15/11/2027	USD	430,000	437,702	0.16
Pacific Gas & Electric Co. 3.85% 15/11/2023	USD	110,000	114,784	0.04
Philip Morris International, Inc. 2% 21/02/2020	USD	280,000	278,328	0.10
PNC Financial Services Group, Inc. (The) 3.3% 08/03/2022	USD	70,000	71,905	0.03
Prologis LP, REIT 3.75% 01/11/2025	USD	70,000	73,493	0.03
Public Service Enterprise Group, Inc. 2% 15/11/2021	USD	500,000	488,518	0.18
Sunoco Logistics Partners Operations LP 4% 01/10/2027	USD	409,000	401,728	0.15
Thermo Fisher Scientific, Inc. 4.15% 01/02/2024	USD	100,000	106,193	0.04
US Treasury 1.125% 28/02/2019	USD	4,050,000	4,017,050	1.50
US Treasury 1.25% 31/03/2019	USD	3,275,000	3,251,047	1.21
US Treasury 1.625% 30/06/2019	USD	2,050,000	2,043,000	0.76
US Treasury 0.75% 15/08/2019	USD	600,000	589,413	0.22
US Treasury 1.625% 31/12/2019	USD	900,000	895,296	0.33
US Treasury 1.25% 31/01/2020	USD	1,550,000	1,529,490	0.57
US Treasury 1.375% 31/08/2020	USD	440,000	433,588	0.16
US Treasury 1.625% 15/10/2020	USD	3,050,000	3,023,338	1.13
US Treasury 1.875% 15/12/2020	USD	2,000,000	1,994,260	0.74
US Treasury 1.375% 31/01/2021	USD	890,000	873,109	0.32
US Treasury 1.125% 28/02/2021	USD	3,050,000	2,966,204	1.10
US Treasury 1.375% 31/05/2021	USD	1,010,000	987,363	0.37
US Treasury 2% 31/08/2021	USD	800,000	797,431	0.30
US Treasury 2% 31/12/2021	USD	1,700,000	1,691,497	0.63
US Treasury 1.875% 31/01/2022	USD	1,600,000	1,583,488	0.59
US Treasury 0.125% 15/04/2022	USD	12,525,000	12,615,634	4.70
US Treasury 1.75% 31/05/2022	USD	2,200,000	2,161,729	0.80
US Treasury 1.875% 31/07/2022	USD	1,650,000	1,627,686	0.61
US Treasury 1.875% 30/09/2022	USD	2,700,000	2,661,082	0.99
US Treasury 2% 31/10/2022	USD	5,500,000	5,452,135	2.03
US Treasury 1.375% 31/08/2023	USD	1,300,000	1,239,128	0.46
US Treasury 2.25% 31/01/2024	USD	1,600,000	1,596,436	0.59
US Treasury 2.125% 30/09/2024	USD	1,400,000	1,382,280	0.51
US Treasury 0.125% 15/07/2026	USD	410,000	412,313	0.15
US Treasury 2.25% 15/02/2027	USD	500,000	493,377	0.18
US Treasury 2.375% 15/05/2027	USD	3,525,000	3,517,630	1.31
US Treasury 2.25% 15/08/2027	USD	250,000	246,655	0.09
US Treasury 2.25% 15/11/2027	USD	2,900,000	2,860,578	1.07
US Treasury 3% 15/05/2047	USD	1,700,000	1,787,656	0.67
US Treasury Inflation Indexed 0.125% 15/07/2024	USD	750,000	769,887	0.29
US Treasury Inflation Indexed 0.258% 15/01/2025	USD	480,000	495,432	0.18
US Treasury Inflation Indexed 0.375% 15/01/2027	USD	2,500,000	2,534,719	0.94
US Treasury Inflation Indexed 1.033% 15/02/2046	USD	3,140,000	3,491,554	1.30
Verizon Communications, Inc. 4.5% 10/08/2033	USD	350,000	367,895	0.14
Williams Partners LP 5.25% 15/03/2020	USD	140,000	147,954	0.05
			87,032,272	32.41
ウルグアイ				
Uruguay Government Bond, 144A 8.5% 15/03/2028	UYU	5,950,000	207,027	0.08
Uruguay Government Bond, Reg. S 9.875% 20/06/2022	UYU	14,490,000	534,543	0.20
			741,570	0.28
債券合計			220,421,589	82.08
公的な市場に上場している譲渡可能な有価証券と短期金融商品の合計			220,421,589	82.08
その他の規制のある市場で取引されている譲渡可能な有価証券と短期金融商品				
債券				
オーストラリア				
WEA Finance LLC, REIT, 144A 3.75% 17/09/2024	USD	200,000	206,534	0.08
			206,534	0.08
カナダ				

Canada Government Bond 0.75% 01/03/2021	CAD	1,200,000	924,792	0.34
Canada Government Bond 1% 01/09/2022	CAD	600,000	459,021	0.17
Enbridge, Inc. 3.7% 15/07/2027	USD	237,000	238,396	0.09
			1,622,209	0.60
フランス				
Pernod Ricard SA, 144A 4.45% 15/01/2022	USD	400,000	425,236	0.16
			425,236	0.16
ドイツ				
Daimler Finance North America LLC, Reg. S 2% 06/07/2021	USD	460,000	450,188	0.16
EMD Finance LLC, 144A 3.25% 19/03/2025	USD	75,000	75,527	0.03
			525,715	0.19
イタリア				
Intesa Sanpaolo SpA, 144A 5.017% 26/06/2024	USD	1,000,000	1,025,124	0.38
			1,025,124	0.38
日本				
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2024	JPY	40,000,000	384,498	0.14
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/09/2024	JPY	105,000,000	985,199	0.37
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2025	JPY	50,000,000	471,193	0.17
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2026	JPY	90,000,000	850,507	0.32
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2027	JPY	570,000,000	5,417,542	2.02
			8,108,939	3.02
マレーシア				
Malaysia Government Bond 3.58% 28/09/2018	MYR	1,005,000	249,770	0.09
Malaysia Government Bond 3.659% 15/10/2020	MYR	3,750,000	935,094	0.35
Malaysia Government Bond 3.882% 10/03/2022	MYR	6,650,000	1,665,456	0.62
Malaysia Government Bond 3.8% 17/08/2023	MYR	3,525,000	871,999	0.32
Malaysia Government Bond 3.955% 15/09/2025	MYR	3,400,000	835,088	0.31
Malaysia Government Bond 3.9% 30/11/2026	MYR	7,980,000	1,947,921	0.73
Malaysia Government Bond 4.498% 15/04/2030	MYR	2,500,000	618,976	0.23
			7,124,304	2.65
メキシコ				
Petroleos Mexicanos 5.625% 23/01/2046	USD	480,000	445,440	0.17
			445,440	0.17
スイス				
Roche Holdings, Inc., 144A 2.25% 30/09/2019	USD	200,000	200,392	0.08
Roche Holdings, Inc., 144A 3.35% 30/09/2024	USD	550,000	569,132	0.21
			769,524	0.29
英国				
Baxalta, Inc. 4% 23/06/2025	USD	40,000	41,398	0.02
HSBC Holdings plc 4.3% 08/03/2026	USD	510,000	542,646	0.20
			584,044	0.22
アメリカ合衆国				
Amgen, Inc. 2.25% 19/08/2023	USD	580,000	563,172	0.21
Apple, Inc. 2.5% 09/02/2022	USD	170,000	170,228	0.06
Apple, Inc. 3.35% 09/02/2027	USD	145,000	148,663	0.05
Apple, Inc. 2.9% 12/09/2027	USD	570,000	563,783	0.21
Citibank Credit Card Issuance Trust, FRN, Series 2008-A2 'A2' 2.702% 23/01/2020	USD	160,000	160,120	0.06
GNMA MA3036 4.5% 20/08/2045	USD	69,609	73,504	0.03
GNMA MA3175 4.5% 20/10/2045	USD	117,340	124,027	0.05
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN 2.905% 24/07/2023	USD	900,000	894,546	0.33
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN 3.691% 05/06/2028	USD	600,000	609,221	0.23
JPMorgan Chase & Co., FRN 3.54% 01/05/2028	USD	700,000	712,781	0.27
Kraft Heinz Foods Co. 3% 01/06/2026	USD	200,000	192,758	0.07
Microsoft Corp. 2.4% 06/02/2022	USD	300,000	300,245	0.11
Microsoft Corp. 2.4% 08/08/2026	USD	190,000	183,389	0.07
Microsoft Corp. 3.3% 06/02/2027	USD	435,000	449,092	0.17
Schlumberger Holdings Corp., Reg. S 4% 21/12/2025	USD	80,000	84,186	0.03
US Treasury 0.644% 15/01/2026	USD	880,000	928,076	0.35
US Treasury Inflation Indexed 0.655% 15/01/2024	USD	2,280,000	2,452,121	0.91
US Treasury Inflation Indexed 0.387% 15/07/2025	USD	420,000	437,566	0.16

Wells Fargo & Co., FRN 3.584% 22/05/2028	USD	550,000	561,206	0.21
			9,608,684	3.58
債券合計			30,445,753	11.34
その他の規制のある市場で取引されている譲渡可能な有価証券と短期金融商品の合計			30,445,753	11.34
新規発行証券				
債券				
オーストラリア				
WEA Finance LLC, REIT, Reg. S 3.15% 05/04/2022	USD	260,000	262,632	0.10
			262,632	0.10
チリ				
Colbun SA, Reg. S 3.95% 11/10/2027	USD	400,000	399,750	0.15
			399,750	0.15
ドイツ				
Deutsche Telekom International Finance BV, 144A 3.6% 19/01/2027	USD	450,000	452,906	0.17
			452,906	0.17
イタリア				
Enel Finance International NV, 144A 2.75% 06/04/2023	USD	600,000	591,843	0.22
Enel Finance International NV, 144A 3.625% 25/05/2027	USD	350,000	348,330	0.13
Enel Finance International NV, 144A 3.5% 06/04/2028	USD	200,000	195,982	0.07
UniCredit SpA, 144A 4.625% 12/04/2027	USD	450,000	475,560	0.18
			1,611,715	0.60
日本				
Nissan Motor Acceptance Corp., 144A 2.6% 28/09/2022	USD	1,175,000	1,160,917	0.43
			1,160,917	0.43
韓国				
Hyundai Capital America, 144A 3.25% 20/09/2022	USD	25,000	24,995	0.01
Hyundai Capital America, Reg. S 2.55% 03/04/2020	USD	365,000	362,196	0.13
			387,191	0.14
英国				
Anglo American Capital plc, 144A 4% 11/09/2027	USD	720,000	716,120	0.27
BAT Capital Corp., 144A 3.557% 15/08/2027	USD	550,000	551,664	0.20
			1,267,784	0.47
アメリカ合衆国				
Amazon.com, Inc., 144A 2.8% 22/08/2024	USD	400,000	399,293	0.15
Cleveland Electric Illuminating Co. (The), 144A 3.5% 01/04/2028	USD	60,000	60,175	0.02
Pacific Gas & Electric Co., 144A 3.3% 01/12/2027	USD	590,000	585,542	0.22
Pacific Gas & Electric Co., 144A 3.95% 01/12/2047	USD	140,000	139,374	0.05
			1,184,384	0.44
債券合計			6,727,279	2.50
新規発行証券合計			6,727,279	2.50
UCITS準拠ファンド、もしくは他の譲渡可能証券への集合投資事業				
集団投資スキーム- UCITS				
ルクセンブルク				
JPMorgan US Dollar Treasury Liquidity - Institutional (dist.)	USD	1,250,745	1,250,745	0.47
			1,250,745	0.47
集団投資スキーム合計- UCITS			1,250,745	0.47
UCITS準拠ファンド、もしくは他の譲渡可能証券への集合投資事業合計			1,250,745	0.47
投資総額			258,845,366	96.39
銀行預金			4,926,626	1.83
その他の純資産 / (負債)			4,777,793	1.78

純資産総額	268,549,785	100.00
-------	-------------	--------

TBA							
国	銘柄	通貨	額面	評価額 (USD)	未実現利益 /(損失) (USD)	投資比率 (%)	
アメリカ合衆国	FNMA, 3.50%, 25/02/2043	USD	2,300,000	2,357,949	4,403	0.88	
アメリカ合衆国	FNMA, 4.00%, 25/02/2047	USD	1,550,000	1,619,707	2,581	0.60	
TBA ロングポジションの合計				3,977,656	6,984	1.48	
TBA 総額				3,977,656	6,984	1.48	

金利スワップ

額面	通貨	カウンター・ パーティ	銘柄	決済日	評価額 (USD)	未実現利 益/(損 失) (USD)	投資比率 (%)
790,000	EUR	Citigroup	Pay fixed 0.815% Receive floating EURIBOR 6 month	21/12/2027	5,575	5,575	-
1,000,000	USD	Citigroup	Pay fixed 2.521% Receive floating LIBOR 3 month	03/08/2047	3,118	3,118	-
5,000,000	USD	Citigroup	Pay fixed 2.034% Receive floating LIBOR 3 month	19/12/2019	2,632	2,632	-
1,700,000	USD	Citigroup	Pay fixed 2.386% Receive floating LIBOR 3 month	01/12/2027	363	363	-
金利スワップの未実現益合計					11,688	11,688	-
540,000,000	MXN	Citigroup	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 7.47%	07/11/2018	(131,335)	(131,335)	(0.05)
40,000,000	MXN	Citigroup	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 6.74%	05/09/2022	(90,318)	(90,318)	(0.03)
15,000,000	SEK	Citigroup	Pay fixed 0.448% Receive floating STIBOR 3 month	21/09/2022	(1,492)	(1,492)	-
300,000	EUR	Citigroup	Pay floating EURIBOR 6 month Receive fixed 1.491%	24/11/2047	(314)	(314)	-
金利スワップの未実現損合計					(223,459)	(223,459)	(0.08)
金利スワップの未実現損益総額					(211,771)	(211,771)	(0.08)

金融先物取引

銘柄	契約口数	通貨	グローバル・エク スプージャー (USD)	未実現利益/ (損失) (USD)	投資比率 (%)
3 Month Eurodollar, 17/09/2018	(22)	USD	(5,387,800)	9,900	-
金融先物取引の未実現益合計				9,900	-
US 5 Year Note, 29/03/2018	126	USD	14,636,672	(23,884)	(0.01)
US Ultra Bond, 20/03/2018	(5)	USD	(838,281)	(4,844)	-
金融先物取引の未実現損合計				(28,728)	(0.01)
金融先物取引の未実現損益総額				(18,828)	(0.01)

先物為替予約							
買通貨	購入総額	売通貨	売却総額	決済日	カウンター ・パーティ	未実現利益 / (損失) (USD)	投資比率 (%)
EUR	921,381	USD	1,100,000	08/01/2018	J.P. Morgan	5,845	-
USD	981,080	MXN	18,450,000	08/01/2018	J.P. Morgan	43,630	0.02
CHF	789,808	USD	800,000	16/01/2018	Goldman Sachs	11,277	0.01
EUR	396,457	GBP	350,000	16/01/2018	Bank of America	3,311	-
EUR	1,459,245	USD	1,750,000	16/01/2018	Citibank	2,275	-
EUR	3,594,080	USD	4,250,000	16/01/2018	J.P. Morgan	65,805	0.03
JPY	2,435,276,370	USD	21,540,000	16/01/2018	Citibank	87,497	0.03
SEK	16,398,135	USD	1,950,000	16/01/2018	Credit Suisse	50,638	0.02
USD	1,438,733	MXN	27,610,000	16/01/2018	J.P. Morgan	38,148	0.02
NOK	8,273,400	USD	1,000,000	31/01/2018	Citibank	8,530	-
先物為替予約の未実現利益						316,956	0.13
CHF Hedged Share Class							
CHF	56,617	GBP	42,932	19/01/2018	J.P. Morgan	173	-
CHF	176,995	JPY	20,291,093	19/01/2018	J.P. Morgan	1,616	-
CHF	482,597	USD	488,471	19/01/2018	J.P. Morgan	7,357	-
EUR Hedged Share Class							
EUR	152,331	GBP	134,447	19/01/2018	J.P. Morgan	1,334	-
EUR	476,218	JPY	63,498,229	19/01/2018	J.P. Morgan	7,949	-
EUR	1,298,457	USD	1,530,033	19/01/2018	J.P. Morgan	29,468	0.01
JPY Hedged Share Class							
JPY	7,798,303,191	USD	68,895,471	19/01/2018	J.P. Morgan	371,125	0.14
USD Hedged Share Class							
USD	436,090	JPY	48,951,747	19/01/2018	J.P. Morgan	1,288	-
ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現利益						420,310	0.15
先物為替予約の未実現利益合計						737,266	0.28
USD	467,077	CAD	600,000	10/01/2018	UBS	(10,336)	(0.01)
USD	1,767,720	EUR	1,500,000	12/01/2018	Bank of America	(33,030)	(0.01)
USD	3,952,532	AUD	5,220,000	16/01/2018	UBS	(120,374)	(0.05)
USD	1,520,942	CAD	1,950,000	16/01/2018	J.P. Morgan	(30,766)	(0.01)
USD	1,557,191	ILS	5,500,000	16/01/2018	J.P. Morgan	(24,230)	(0.01)
USD	3,007,589	INR	194,200,000	16/01/2018	Citibank	(30,200)	(0.01)
USD	851,789	INR	55,000,000	16/01/2018	J.P. Morgan	(8,553)	-
USD	2,425,412	PLN	8,650,000	16/01/2018	Bank of America	(59,564)	(0.02)
USD	612,942	ZAR	8,400,000	16/01/2018	J.P. Morgan	(64,552)	(0.03)
USD	1,784,129	EUR	1,500,000	17/01/2018	Credit Suisse	(17,202)	(0.01)
先物為替予約の未実現損						(398,807)	(0.16)
CHF Hedged Share Class							
CHF	28,146	CAD	36,648	19/01/2018	J.P. Morgan	(246)	-
CHF	273,558	EUR	235,086	19/01/2018	J.P. Morgan	(1,290)	-
EUR Hedged Share Class							
EUR	75,729	CAD	114,746	19/01/2018	J.P. Morgan	(359)	-

JPY Hedged Share Class							
JPY	459,921,177	CAD	5,222,682	19/01/2018	J.P. Morgan	(70,952)	(0.03)
JPY	4,470,080,060	EUR	33,512,952	19/01/2018	J.P. Morgan	(546,010)	(0.20)
JPY	925,149,140	GBP	6,125,711	19/01/2018	J.P. Morgan	(57,730)	(0.02)
JPY	87,576,075	USD	780,480	19/01/2018	J.P. Morgan	(2,606)	-
USD Hedged Share Class							
USD	1,483,435	CAD	1,907,063	19/01/2018	J.P. Morgan	(34,164)	(0.01)
USD	14,417,846	EUR	12,232,920	19/01/2018	J.P. Morgan	(274,399)	(0.10)
USD	2,983,986	GBP	2,235,769	19/01/2018	J.P. Morgan	(36,287)	(0.01)
USD	8,892,433	JPY	1,006,778,136	19/01/2018	J.P. Morgan	(50,037)	(0.02)
ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現損						(1,074,080)	(0.39)
先物為替予約の未実現損合計						(1,472,887)	(0.55)
先物為替予約の未実現損益総額						(735,621)	(0.27)

国名はCIF Annual Report原本に基づき投資国を表示している。

キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド（LUX）

純資産価額計算書

2017年12月31日現在

（USD）

資産		
投資有価証券（時価）(注記2b)		258,845,366
TBA取引に係る投資有価証券（時価）（注記2f）		3,977,656
銀行預金		5,002,833
未収配当金および未収利息（源泉徴収税額控除後）（注記2d,5b）		1,968,049
投資証券引受に係る未収入金		5,316,218
TBA取引に係る未収入金（注記2f）		6,910,546
ヘッジ・エクイバレント・クラスの為替予約取引に係る未実現益（注記7）		420,310
前払費用およびその他未収入金		231,747
投資有価証券売却に係る未収入金		
先物為替予約取引に係る未実現益（注記6）		316,956
スワップ取引に係る未実現益（注記8,9）		11,688
金融先物取引に係る未実現益（注記10）		9,900
スワップ取引に係る未収利息		1,920
先物為替予約取引に係る未収入金		
資産合計		283,013,189
負債		
TBA取引に係る未払金（注記2f）		10,891,807
投資有価証券買入に係る未払金		1,568,530
未払費用およびその他未払金		99,762
投資証券買戻に係る未払金		5,272
ヘッジ・エクイバレント・クラスの為替予約取引に係る未実現損（注記7）		1,074,080
未払運用報酬（注記3a）		7,650
先物為替予約取引に係る未実現損（注記6）		398,807
当座貸越 ¹		55,880
スワップ取引に係る未実現損（注記8,9）		223,459
委託保証金		20,327

先物為替予約取引に係る未払金	79,259
スワップ取引に係る未払利子	9,843
金融先物取引に係る未実現損(注記10)	28,728
負債合計	14,463,404
純資産合計	268,549,785
投資簿価金額	262,987,662

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

¹ 当座貸越は会計通貨の決済時に、利用可能な現金が準備されていないことで生じ得る。当ファンドは、通常、JPモルガン流動性ファンドが保有する現金で十分にカバーされており、この当座貸越残高とは、基準日における正味現金や保有している現金の計上遅延によるものである。

キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド(LUX)

損益および純資産変動計算書

2017年12月31日現在

(USD)

収益(注記2d)	
受取配当金(源泉徴収税額控除後)(注記5b)	
債券および転換社債に係る利息(源泉徴収税額控除後)(注記5b)	4,082,346
銀行預金利息	10,642
スワップ取引(注記8、9)	
その他収益(注記5b)	
収益小計	4,092,988
費用	
運用報酬(注記3a)	99,604
管理手数料(注記3b)	172,794
専門家サービス	106,612
年次税(注記5a)	20,225
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(注記3b)	46,110
印刷費用	18,021
その他費用	10,741
スワップ取引(注記8、9)	28,160
費用小計	502,267
費用の払戻し(注記3d)	194,262
投資純利益/(損失)(a)	3,784,983
実現純利益/(損失)	
投資有価証券の売却取引(注記2e)	(938,394)
金融先物取引(注記10)	5,407
スワップ取引(注記8)	(167,242)
為替取引(注記2c)	(5,047,214)
当期実現純利益/(損失)(b)	(6,147,443)
未実現評価利益/(損失)の増減	
投資有価証券	(6,777,703)

為替取引(注記2c)	
金融先物取引(注記10)	(18,828)
スワップ取引(注記8)	(211,771)
当期末実現評価利益/(損失)の増減:(c)	(7,759,682)
当期損益(a+b+c)	(10,122,142)
配当金の分配(注記4)	(384,976)
当期投資証券の差引増減額	178,962,628
期首純資産総額	100,094,275
期末純資産総額	268,549,785

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド(LUX)

投資証券口数変動計算書

2017年12月31日現在

クラスA		クラスCh-CHF	
期首投資証券口数	95,683	期首投資証券口数	
引受投資証券口数		引受投資証券口数	46,267
買戻し投資証券口数	(98)	買戻し投資証券口数	
期末投資証券口数	95,585	期末投資証券口数	46,267
クラスA4		クラスCh-JPY	
期首投資証券口数	590,469	期首投資証券口数	1,288,633
引受投資証券口数	4,518	引受投資証券口数	7,249,767
買戻し投資証券口数	(258,143)	買戻し投資証券口数	(2,100,350)
期末投資証券口数	336,844	期末投資証券口数	6,438,050
クラスA7		クラスCh-USD	
期首投資証券口数		期首投資証券口数	738,904
引受投資証券口数	367,257	引受投資証券口数	1,975,502
買戻し投資証券口数	(2,340)	買戻し投資証券口数	(320,599)
期末投資証券口数	364,917	期末投資証券口数	2,393,807
クラスB		クラスT	
期首投資証券口数	103,234	期首投資証券口数	35,855
引受投資証券口数	4,081	引受投資証券口数	8,857
買戻し投資証券口数	(78,892)	買戻し投資証券口数	(10,172)
期末投資証券口数	28,423	期末投資証券口数	34,540
クラスBd		クラスX	
期首投資証券口数	22,676	期首投資証券口数	62,429
引受投資証券口数	283	引受投資証券口数	
買戻し投資証券口数	(17,775)	買戻し投資証券口数	(2,455)
期末投資証券口数	5,184	期末投資証券口数	59,974
クラスC		クラスXd	
期首投資証券口数	411,556	期首投資証券口数	3,125

引受投資証券口数	81,534	引受投資証券口数	27
買戻し投資証券口数	(5,486)	買戻し投資証券口数	(678)
期末投資証券口数	487,604	期末投資証券口数	2,474
クラスCd		クラスZ	
期首投資証券口数	772,580	期首投資証券口数	70,078
引受投資証券口数	230,243	引受投資証券口数	2,472
買戻し投資証券口数		買戻し投資証券口数	(1,332)
期末投資証券口数	1,002,823	期末投資証券口数	71,218
クラスC dh-EUR		クラスZd	
期首投資証券口数	149,941	期首投資証券口数	7,150
引受投資証券口数	74,891	引受投資証券口数	3,699
買戻し投資証券口数	(19,255)	買戻し投資証券口数	(3,731)
期末投資証券口数	205,577	期末投資証券口数	7,118
		期末投資証券口数 総合計	11,580,405

キャピタル・インターナショナル・ファンド

財務書類に関する注記

2017年12月31日現在

1) キャピタル・インターナショナル・ファンド(以下「CIF」という。)の概要

a. 法制

CIFは、ルクセンブルク籍外国投資法人の投資証券(Societe d'Investissement a Capital Variable(以下「SICAV」という。))であり、2010年12月17日付ルクセンブルク法第1部に基づきUCITSとして設立された。また、2013年2月1日から、CIFは自らが管理会社となるSICAVより、キャピタル・インターナショナル・マネジメント・カンパニー・S.a r.l(以下「管理会社」という。)という名称のマネジメントカンパニーが管理会社となるSICAVへ変更となった。尚、運営は1969年12月30日より開始されている。

b. ファンド

CIFはアンブレラ形式を採用しており、現在以下のファンド(以下「ファンド」という。)で構成されている。

キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド(LUX)
 キャピタル・グループ・ジャパン・エクイティ・ファンド(LUX)
 キャピタル・グループ・ワールド・ディビデント・グロワーズ(LUX)
 キャピタル・グループ・グローバル・グロース・アンド・インカム・ファンド(LUX)
 キャピタル・グループ・ヨーロピアン・グロース・アンド・インカム・ファンド(LUX)
 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・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ(LUX)
 キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド(LUX)
 キャピタル・グループ・ユーロ・ボンド・ファンド(LUX)
 キャピタル・グループ・ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド(LUX)
 キャピタル・グループ・ニューパースペクティブ・ファンド(LUX)
 キャピタル・グループ・グローバル・アブソリュート・インカム・グロワー(LUX)
 キャピタル・グループ・インベストメント・カンパニー・オブ・アメリカ(LUX)
 キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド(LUX)
 キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド(LUX)
 キャピタル・グループ・US・コーポレート・ボンド・ファンド(LUX)(設定日 2017年3月21日)
 キャピタル・グループ・AMCAP・ファンド(LUX)(設定日 2017年6月16日)
 キャピタル・グループ・US・ハイ・イールド・ファンド(LUX)(設定日 2017年10月30日)

c. 投資証券クラスおよび通貨

各ファンドは、A、A4、A7、A9、A11、B、C、N、T、X、Z、ZLのクラスに分かれる。また、いくつかのクラスはエクイバレント・クラスにさらに分かれる。

純資産価額の発表、投資証券の取引の申込および報告書の作成は各支払通貨で行なわれている。ただし、ヘッジ・エクイバレント・クラス、分配型ヘッジ・エクイバレント・クラスに関しては特定通貨のみ。当期末時点に残高のある全てのクラスを開示している。また、残高のある全てのクラス並びに可能な支払通貨については管理会社のホームページ thecapitalgroup.com/international より入手可能となっている。

2017年11月13日付にて、キャピタル・グループ・アジア・パシフィック(除く日本)・エクイティ・ファンド(LUX)

(2017年12月18日付にて償還)、キャピタル・グループ・ワールド・ディビデント・グロワーズ(LUX)、キャピタル・グループ・グローバル・グロース・アンド・インカム・ファンド(LUX)、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・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ(LUX)、キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド(LUX)の会計通貨をユーロから米ドルへ、また、キャピタル・グループ・ジャパン・エクイティ・ファンド(LUX)の会計通貨をユーロから日本円へ変更した。

ファンドの会計通貨(財務会計用の通貨であり、基準通貨とは異なることもある)は、米ドルであるキャピタル・グループ・アジア・パシフィック(除く日本)・エクイティ・ファンド、キャピタル・グループ・ワールド・ディビデント・グロワーズ、キャピタル・グループ・グローバル・グロース・アンド・インカム・ファンド、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、キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ、キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド、キャピタル・グループ・ニューパースペクティブ・ファンド、キャピタル・グループ・グローバル・アブソリュート・インカム・グロワー、キャピタル・グループ・インベストメント・カンパニー・オブ・アメリカ、キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド、キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド、キャピタル・グループ・U.S.コーポレート・ボンド・ファンド、キャピタル・グループ・AMCAP・ファンド、および、キャピタル・グループ・U.S.ハイ・イールド・ファンド、および日本円であるキャピタル・グループ・ジャパン・エクイティ・ファンドを除き、ユーロである。基準通貨はファンドが投資目的に保有する現金の通貨である。

連結純資産価額計算書、並びに連結損益および純資産変動計算書は、各サブ・ファンドの純資産価額計算書、並びに損益および純資産変動計算書を、2017年12月31日現在の為替レートで会計通貨に換算し合計したものである。

d. 配当方針

- ・クラスA、A4、A7、A9、A11、B、C、N、T、X、Z、ZL並びにヘッジ・エクイバレント・クラスは、現在配当金の分配を行わないクラスである。
- ・分配型エクイバレント・クラス、並びに分配型ヘッジ・エクイバレント・クラスは、取締役会により配当金を分配するよう推奨されているクラスである。

“d”または“dh”表示のある分配型エクイバレント・クラス、並びに分配型ヘッジ・エクイバレント・クラス配当金は、一般に純投資収益(源泉徴収税額および費用を控除した後の投資収益)相当である。特定のクラスはいかなる計算期間においても純投資収益が小額あるいは発生しない場合には分配を行わないことがある。

“gd”または“gdh”表示のある分配型エクイバレント・クラス、並びに分配型ヘッジ・エクイバレント・クラス配当金は、一般に総投資収益(源泉徴収税額控除後、但し費用控除前の投資収益)の実質相当部分である。特定のクラスはいかなる計算期間においても純投資収益が小額あるいは発生しない場合には分配を行わないことがある。

“ad”または“adh”表示のある分配型エクイバレント・クラス、並びに分配型ヘッジ・エクイバレント・クラス配当金は、一般に総投資収益(源泉徴収税額および費用を控除した後の投資収益)および各クラスの為替取引にかかる実現損益相当額である。特定のクラスはいかなる計算期間においても純投資収益が小額あるいは発生しない場合には分配を行わないことがある。

“fd”表示のある分配型エクイバレント・クラス配当金は、一般に総投資収益(源泉徴収税額控除後、但し費用控除前の投資収益)の実質相当部分であり、取締役会により毎月分配するよう推奨されているクラスである。配当金は、純投資収益を超過して分配することがある。また、元本の一部からも分配を行うことがある。

詳細については、財務書類に関する注記4に開示している。

e. 会計年度

CIFの会計年度は1月1日に開始し、12月31日に終了する。

2) 重要な会計方針

a. 基本事項

当財務書類は、定款、目論見書、およびルクセンブルク法の規定、市場慣行および規制上の要件に準拠して作成されている。

b. 投資有価証券の評価

下記()に該当する場合を除き、公的な証券取引所に上場している有価証券またはその他の規制のある市場で取引されている有価証券は、ファンドの純資産計算日における各有価証券の主要取引市場で発表される直近の相場もしくはその時点で入手可能な価格、または取締役会が承認した価格情報会社より提供される直近の相場もしくはその時点で入手可能な価格を用いて評価される。また、その他の有価証券は、一もしくは複数のディーラーまたは価格情報会社から提供された価格、もしくは同等の利回り相当額により評価される。

UCITS、あるいはUCIsとして発行されている有価証券は、適用する純資産価額計算日において入手し得る直近の基準価額で評価されるが、当該有価証券が上場されている場合には上記の項目()に従って評価される場合がある。

短期金融市場商品は、額面に経過利息を加算した額、または取締役会により承認された手続きに従い誠実に決定された公正な価値で評価されることが保証される場合には償却原価法を使用して評価される。

OTCデリバティブの清算価格は取締役会により承認された清算機関からの情報に基づいて決定されることとする。

上記(i)から()に記述した価格情報元からの適正な時価提供が間に合わない場合、または純資産価額算出前に発生した事象により、上記(i)に準じて評価されたポートフォリオの評価精度が著しく影響される場合は、取締役会において、またはその指示により決定された理論価格で評価を行う。係る理論価格の適用は、より適正な純資産額の評価を行い、また結果として起こりうる短期転売を目的とする投資家による潜在的な裁定機会を排除、あるいは大幅

に軽減することを意図している。

c. 外貨

ユーロ以外の通貨建て資産および負債は、2017年12月31日現在の為替レートでユーロに換算されている。また、ユーロ以外の通貨での期中取引は、取引時の為替レートでユーロに換算されている。2016年12月31日から2017年12月31日までの期間の、未決済の先物為替予約並びにその他資産および負債に係る未実現純利益または損失の変動は、「為替取引に係る未実現評価(損)益の増減」に開示されている。当期中に満期となった先物為替予約を含め、為替に係る実現純利益または損失は、「為替取引に係る実現純(損)益」に開示されている。

2017年12月31日の適用為替レートはキャピタル・グループ・ジャパン・エクイティ・ファンド(LUX)は135.193097618日本円/ユーロ、他の全ファンドは1.199849990米ドル/ユーロが適用された。

d. 収益

配当金は、当該有価証券の配当落ち日に計上され、受取利息は日割計算で計上されている。転換社債、減債基金付社債、減債基金付コーラブル債、インデックス連動債、インフレ連動債、利付債、ユニタイズド・ボンドのプレミアムおよびディスカウントは実効金利法で償却される。その他の確定利付証券のプレミアムおよびディスカウントは定額法で償却される。

e. 投資有価証券の売却に係る実現利益または損失

投資有価証券の売却に係る実現利益または損失は平均取得原価に基づき算出されている。確定利付証券の売却による利益および損失は先入先出法で算出されている。

f. モーゲージ証券-To Be Announced取引 (TBA取引)

TBA契約はファニー・メイ、フレディ・マック、ジニー・メイなどが発行するエージェンシー・モーゲージ・パススルー証券の先渡契約である。受渡しされる特定証券(特定のモーゲージ・プール)は約定日には明らかにされておらず、受渡日の2日前に通知される。しかし、受渡しされる証券は、額面金額、クーポン・レート、満期など「グッド・デリバリー」という業界基準を満たさなければならない。TBA取引は証券業・金融市場協会が発表するカレンダーに基づいて毎月一度、受渡しが行われる。

TBAポジションは投資明細表に開示されている。TBA取引により購入した債券は決済が完了するまでは購入代金は未払金に相当し、純資産価額計算書の「TBA取引に係る未払金」に開示されている。

投資明細表のネガティブ・ポジションはファンドのTBA取引の売り約定が反映されている。その約定が決済されるまでは未収入金に相当し、「TBA取引に係る未収入金」に開示されている。

TBA取引に係る実現損益および未実現評価額(償却額)の増減は「投資有価証券の売却取引に係る実現純(損)益」および「投資有価証券に係る未実現評価(損)益の増減」に開示されている。

g. スイング・プライシング調整

ファンドは大口設定、解約、移管によって純資産価額が希薄化する。その希薄化はキャッシュの流入に対応するため、証券売買時に発生する発注・その他のコストが正しく反映されていない純資産価額にて売買する投資家によって生じる。その希薄化の影響を排除するため、評価基準にスイング・プライシングの方針を採用する。ファンド基準日における設定または解約額の総額があらかじめ決められた純資産価額の一定割合を超えた場合、キャッシュの流入に伴い、インベストメント・アドバイザーが行う証券売買にかかるコストを反映させるため、純資産価額は上方または下方修正される。

純資産価額のスイング・プライシング調整は事前に定義されたファクターに基づいて系統的に一貫して適用される。価額調整はファンドによって異なるが通常、元の純資産価額の2%を超えない。投資家の利益を保護するために、特定のファンドにおいて純資産価額のスイング・プライシング調整を保留したり、特別な状況において価額調整限度額を大きくすることもある。価額調整については純資産価額とともに管理会社のホームページ thecapitalgroup.com/international にて公開されている。現状の取引やコストを反映するため、管理会社およびそのコンダクティング・オフィサーが継続して見直しを行い、価額調整ファクターは定期的に再評価される。

2017年12月31日現在、純資産価額を調整したファンドはない。

3) 費用

a. 運用報酬

CIFは、以下に指定された年率で運用報酬を支出している。この報酬は販売会社、管理会社およびその他の仲介業者による投資家に対するサービスまたは投資関連の類似サービスの手数料として支払われている。

キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド(LUX)

投資証券クラスおよびエクイバレント・クラス

クラスC、並びにエクイバレント・クラス

運用報酬に関する個別契約の締結が必須となる。

b. 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

ファンドは、デポジタリー、カストディアンおよび管理会社としてJ.P. Morgan Bank Luxembourg S.A.を任命している。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はファンドの総資産に応じて異なるほか、カストディ費用はポートフォリオの国別構成比に応じて異なる。CIFは以下の年間実効料率にてカストディ・デポジタリー費用およびファンド管理手数料を支出した。なお、料率は期中平均純資産額に基づいて算出されている。

	デポジタリー・カストディ費用	ファンドの管理手数料
キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド（LUX）	0.03%	0.09%

c. 関係会社との取引

損益および純資産変動計算書上の「専門家サービス」は、2017年12月31日で終了する年度に受けた管理サービス料として管理会社から請求された総額1,066,237ユーロを含む。

d. 費用の払戻し

各投資証券クラスはあらゆるタイプの投資家のニーズに対応するべく設計されており、投資収益の一部として反映される総費用率は各クラスで異なっている。投資証券クラス間の違いについては、CIFの目論見書に、より詳細に説明されており、ホームページ thecapitalgroup.com/international より入手可能となっている。

各ファンドの総費用率（運用報酬を除く）は、管理会社が設定した以下の基準値を上回らないように運営が行なわれている。

キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド（LUX）	
クラスC、並びにエクイバレント・クラス	0.10%

2017年1月1日付にて、キャピタル・グループ・ワールド・ディビデント・グロウーズ、キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンドおよびキャピタル・グループ・ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンドのクラスZ並びに各エクイバレント・クラスの払戻の基準値は0.00%に縮小された。

2017年12月31日現在、ファンドで日々発生し、管理会社によって払戻される金額の合計は以下に示すとおりである。また、この払戻に係る方針は管理会社の決定により随時変更または取り下げることができる。

	(USD)
キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド（LUX）	194,262

4) 配当金の分配

配当方針の詳細は、財務書類に関する注記の1) dに記載がある。

2017年12月31日に発表された配当額は当ファンドが保有しているクラスでは該当なし。

5) 税金

a. 年次税

ルクセンブルクにおいて、CIFは、各ファンドの各投資証券クラスの純資産総額に対して課される年率0.05%のみが年次税として徴収される。しかし、機関投資家専用の投資証券クラスについては、ルクセンブルクの法律で規定されるように、年率0.01%の軽減税率が2017年12月31日決算のクラスA、A4、A7、A9、C、並びに各エクイバレント・クラスに適用された。この軽減税率の適用が今後否認されないという保証はなく、また一度適用されたことが将来にわたる継続を保証するものではない。年次税は日割で計上され、四半期ごとに支払われ、四半期末の各クラスの純資産総額を基に算定されている。

b. 外国税額

有価証券に係るキャピタル・ゲインおよびインカム収益は、それぞれキャピタル・ゲイン税と源泉徴収税が課せられる。CIFはそのような税金の全額還付を見込んではいないが、ルクセンブルクと各国との租税条約に定める制限税率に従い、源泉徴収税の一部が還付される可能性がある。

CIFの方針において、源泉徴収税および各国のキャピタル・ゲイン税に関する重要な潜在的負債については未払計上を行っている。

一定条件の下、CIFは、適用される租税措置において申請価値があると見なした場合は、各国の税務当局へ還付申請を行うことがある。これらの申請は性質として複雑であり、各地域の手続規定および判例法が適用される。

不確実性が見込まれた場合、ルクセンブルクで適用される会計原則に従い、CIFは見込みでの税還付を未収計上しない。還付が確定すると、源泉徴収税やキャピタルゲイン税還付金は確定通知に基づき「その他収益」、あるいは「投資有価証券の売却取引に係る実現純益」として計上される。

2017年12月31日に終了した会計年度において、ファンドへの返済はない。

6) 先物為替予約

最適な通貨配分を達成する事を目的として、ファンドは、特定通貨の貨幣価値が下落するリスクを低減する為、先物為替予約を締結する。ファンドは、財務書類に関する注記7に記述されているヘッジ・エクイバレント・クラスの場合を除き、体系的にどの通貨に対しても通貨エクスポージャーをヘッジする事を意図しない。

先物為替予約は、報告日現在の先物為替レートに基づき評価され、その結果生じた未実現利益または損失の純変動は損益および純資産変動計算書に含まれている。

7) ヘッジ・エクイバレント・クラス

分配型を含む各ヘッジ・エクイバレント・クラスは、特定通貨以外のエクスポージャーを制限することを目的として、各ファンドのヘッジ・エクイバレント・クラスに対する資産の大部分において、J.P. Morgan Chase Bank, N.A. が為替オーバーレイ パッシブ・ヘッジの運営を行っている。

該当クラスの資金移動や純資産額の変動が小さい場合には、その都度、為替オーバーレイ パッシブ・ヘッジの調整が行なわれない場合がある。為替オーバーレイ パッシブ・ヘッジは、為替変動のエクスポージャーを完全に排除するものではなく、また該当の通貨に流動性がない場合や、他通貨と密に連動している場合などは、代替ヘッジでの運営を行う場合もある。各ヘッジ・エクイバレント・クラスのリターンが、その他の各クラスのリターンより徐々に大きく乖離していく可能性があり、また為替オーバーレイ パッシブ・ヘッジ運用によって、ポートフォリオの通貨分散から期待しうる運用利益が減少する可能性がある点について、受益者は留意する必要がある。（ファンドのポートフォリオレベルで実施されるヘッジの一部オフセット取引を含む）

為替オーバーレイ パッシブ・ヘッジに係る費用、およびヘッジ取引から生じる損益は、各ヘッジ・エクイバレント・クラスに限り負担する。

これらのクラスは "h" およびヘッジされている通貨が記載されている。

実際の為替オーバーレイ パッシブ・ヘッジの運用方法は各ファンドにより異なる。

8) クレジット・デフォルト・スワップ

クレジット・ポートフォリオへのエクスポージャーを分散するため、またはクレジット・リスクをヘッジするため、クレジット・デフォルト・スワップ・インデックス（CDXs）に投資することがある。CDXはハイ・イールド債など似た特性のクレジット・デフォルト・スワップで構成されている。一般的なCDX取引ではプロテクションの買い手がプロテクションの売り手に契約に従って定期的に支払を行う。特定の参照債務にデフォルトや債務の再構築などのクレジット・イベントが発生した場合、プロテクションの売り手はプロテクションの買い手にそのクレジットの損失を支払わなければならない。ファンドはプロテクションの買い手または売り手としてCDX取引に参加する。

未実現損益は純資産価額計算書の「スワップ取引に係る未実現(損)益」に開示されている。実現損益および手数料は損益および純資産変動計算書の「スワップ取引に係る実現純(損)益」および「スワップ取引に係る未実現評価(損)益の増減」に開示されている。

9) 金利スワップ

金利スワップは、通常交換されずに計算根拠の役割を果たす想定元本に基づいて一定期間の金利（通常は固定金利と変動金利）を交換する事を当事者間で合意する双務契約である。

金利スワップはNAV算出日毎に時価評価される。時価は契約に基づきプライシング・エージェント、マーケット・メイカーまたは内部モデルによって評価される。未実現損益は純資産価額計算書の「スワップ取引に係る未実現(損)益」に開示されている。実現損益および手数料は損益および純資産変動計算書の「スワップ取引に係る実現純(損)益」および「スワップ取引に係る未実現評価(損)益の増減」に開示されている。

10) 金融先物取引

金融先物取引は、固定価格での原資産の先受渡しまたは将来の特定の日における原資産の価値の変動に基づく現金額を規定している。先物契約を締結する際には、サブ・ファンドは、当初証拠金として契約金額のある一定割合相当額の現金または有価証券をブローカーに預託する必要がある。変動証拠金の支払は、サブ・ファンド毎に定期的に行われ、これは未決済先物契約の時価の変動に基づいている。

金融先物取引の未実現利益/損失は、純資産価額計算書の「金融先物取引に係る未実現益/損」に開示されている。未決済金融先物取引の時価の変動は、損益および純資産変動計算書の「未実現評価利益/(損失)の増減」内の「金融先物取引」に開示されている。未決済時と決済時の先物価格の差である実現損益は決済時または期日に損益および純資産変動計算書の「実現純利益/(損失)」内の「金融先物取引」に開示されている。

11) 担保

2017年12月31日現在、店頭デリバティブの取引目的でブローカーおよびカウンターパーティーに授受された現金および非現金担保で構成された受取/支払担保は、以下のとおりである。

	サブファンド	カウンターパーティ	担保の種類	受取担保額	支払担保額
	通貨	/ブローカー			
キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ (LUX)	USD	Citibank	現金	-	305,000
キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ (LUX)	USD	J.P.Morgan	現金	-	332,000

キャピタル・グループ・グローバル・ボ ンド・ファンド（LUX）	USD	Citibank	債券	-	812,000
キャピタル・グループ・グローバル・ボ ンド・ファンド（LUX）	USD	Goldman Sachs	債券	-	69,000
キャピタル・グループ・ユーロ・ボン ド・ファンド（LUX）	EUR	Citibank	債券	-	171,000
キャピタル・グループ・ユーロ・コーポ レート・ボンド・ファンド（LUX）	EUR	Citibank	債券	-	182,000
キャピタル・グループ・グローバル・イ ンターミディエイト・ボンド・ファンド （LUX）	USD	Citibank	債券	-	489,000

12) クロス・インベストメント

2017年12月31日現在、サブ・ファンド間のクロス・インベストメント総額は9,916,036ユーロである。クロス・イン
ベストメント総額を除いた年末時点における総純資産総額は7,011,063,329ユーロになる。

サブ・ファンド	クロス・インベストメント	通貨	時価（USD）
キャピタル・グループ・グローバル・アブ ソリュート・インカム・グロワー（LUX）	キャピタル・グループ・グローバ ル・ハイ・インカム・オポチュニ ティーズ（LUX）	USD	11,897,756

13) リスクエクスポージャーの算出方法

金融派生商品の利用に起因する海外エクスポージャーの算出方法は、全てのファンドにおいてCSSF通達11/512に基づ
きコミットメント法を採用している。

14) 後発事象

2018年2月13日付で、キャピタル・グループ・グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド(LUX)が設定された。

15) 取引費用

取引費用は、有価証券および派生商品の取引に関連して発生した費用である。当該費用は、印紙税、諸税、売買委託
手数料から成り、投資簿価の一部として記帳される。

固定利付商品の取引については、売買委託手数料は別途発生しない。当該取引の費用は、「マークアップ」として知
られ、取引価格に含まれる。この為、キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ
(LUX)、キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド(LUX)、キャピタル・グループ・ユーロ・ボンド・
ファンド(LUX)、キャピタル・グループ・ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド(LUX)、キャピタル・グルー
プ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド(LUX)、キャピタル・グループ・U.S.・コーポレート・
ボンド・ファンド(LUX)およびキャピタル・グループ・U.S.・ハイ・イールド・ファンド(LUX)については、該当す
る開示情報はない。

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・ボンド・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る有価証券は次のとおりであります。本情報は同マザーファンドの
投信運用会社である三菱UFJ国際投信株式会社からの資料に基づき委託会社が作成したものであります。こ
れらは監査意見の対象外であります。

なお、同ファンド（「日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」）は、三菱UFJ国際投信株式会社の
委嘱に基づき、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に準じて、設定日（平成19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、直近の計算期間は平成29年7月25日から平成30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」の組入る有価証券の状況

(有価証券明細表)

(平成30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41回東日本高速道路	0.005	2019/6/20	特殊債券	100,000	99.978	99,978,000
日本	第16回フランス相互信用 連合銀行円貨社債(2015)	0.269	2018/10/15	社債券	100,000	100.099	100,099,000
日本	第1回バンコ・サンタン デール・エセ・アー非上 位円貨社債(2017)	0.568	2023/1/11	社債券	100,000	100.063	100,063,000
日本	第9回モルガン・スタン レー円貨社債(2014)	0.557	2018/5/22	社債券	100,000	100.139	100,139,000
日本	第19回ルノー円貨社債 (2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	100.232	100,232,000
日本	第1回ソシエテ・ジェネ ラル非上位円貨社債 (2017)	0.448	2022/5/26	社債券	100,000	100.442	100,442,000
日本	第237回四国電力社債 (一般担保付)	2.05	2018/11/22	社債券	100,000	101.654	101,654,000
日本	第316回北海道電力	1.164	2020/6/25	社債券	100,000	102.503	102,503,000
日本	第5回ヤフー(社債間限 定同順位特約付)	0.2	2022/12/7	社債券	100,000	99.837	99,837,000
日本	第4回富士フイルムホー ルディングス(社債間限 定同順位特約付)	0.005	2020/3/3	社債券	100,000	99.808	99,808,000
日本	第50回日本電気(社債間 限定同順位特約付)	0.29	2022/6/15	社債券	100,000	100.043	100,043,000
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	100.072	100,072,000
日本	第1回三井住友トラス ト・パナソニックファイ ナンス(社債間限定同順位 特約付)	0.12	2020/10/30	社債券	100,000	99.993	99,993,000
日本	第66回クレディセゾン(社 債間限定同順位特約付)	0.09	2020/12/22	社債券	100,000	99.904	99,904,000
日本	第7回あおぞら銀行(社債 間限定同順位特約付)	0.08	2019/9/9	社債券	100,000	99.941	99,941,000
日本	第28回三菱東京UFJ銀 行(劣後特約付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	104.01	104,010,000
日本	第6回りそな銀行(劣後特 約付)	2.084	2020/3/4	社債券	100,000	103.917	103,917,000
日本	第8回三井住友信託銀行 (社債間限定同順位特約 付)	0.234	2019/7/22	社債券	100,000	100.279	100,279,000
日本	第23回三井住友銀行(劣後 特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	104.036	104,036,000
日本	第38回日産フィナンシャ ルサービス(社債間限定同 順位特約付)	0.001	2019/6/20	社債券	100,000	99.726	99,726,000
日本	第67回アコム(特定社債間 限定同順位特約付)	0.5	2019/6/6	社債券	100,000	100.221	100,221,000
日本	第69回日立キャピタル(社 債間限定同順位特約付)	0.08	2020/12/18	社債券	100,000	99.905	99,905,000
日本	第43回野村ホールディン グス	0.454	2019/2/25	社債券	100,000	100.377	100,377,000

合計	2,300,000		2,317,179,000
----	-----------	--	---------------

2【ファンドの現況】

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

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

キャピタル・グローバル・ボンド・ファンドF(限定為替ヘッジ)

平成30年 6月29日現在

資産総額	28,115,473,505円
負債総額	14,233,583円
純資産総額(-)	28,101,239,922円
発行済口数	28,110,043,452口
1口当たり純資産額(/)	0.9997円

(参考) キャピタル・グローバル・ボンド・マザーファンド(限定為替ヘッジ)

平成30年 6月29日現在

資産総額	28,112,578,316円
負債総額	円
純資産総額(-)	28,112,578,316円
発行済口数	27,618,576,311口
1口当たり純資産額(/)	1.0179円

(参考) 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

平成30年1月24日現在

資産総額	161,076,486円
負債総額	112,189円
純資産総額(-)	160,964,297円
発行済口数	152,692,019口
1口当たり純資産額(/)	1.0542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（2017年12月29日現在）

（中略）

過去5年間における資本金の額の増減

2013年4月 資本金の額9,000万円から5億9,000万円に増資

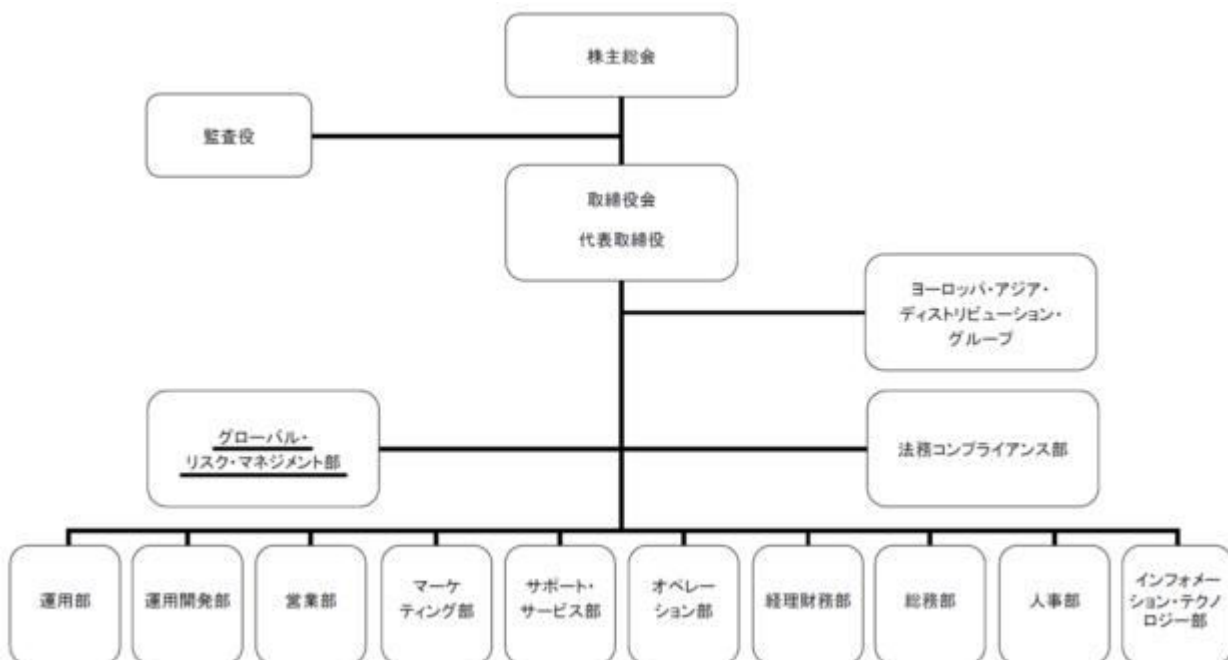
2013年4月 資本金の額5億9,000万円から4億5,000万円に減資

2013年12月 資本金の額4億5,000万円から9億5,000万円に増資

2013年12月 資本金の額9億5,000万円から4億5,000万円に減資

(2) 会社の機構（2017年12月29日現在）

（中略）



（以下略）

<訂正後>

(1) 資本金の額（2018年6月29日現在）

（中略）

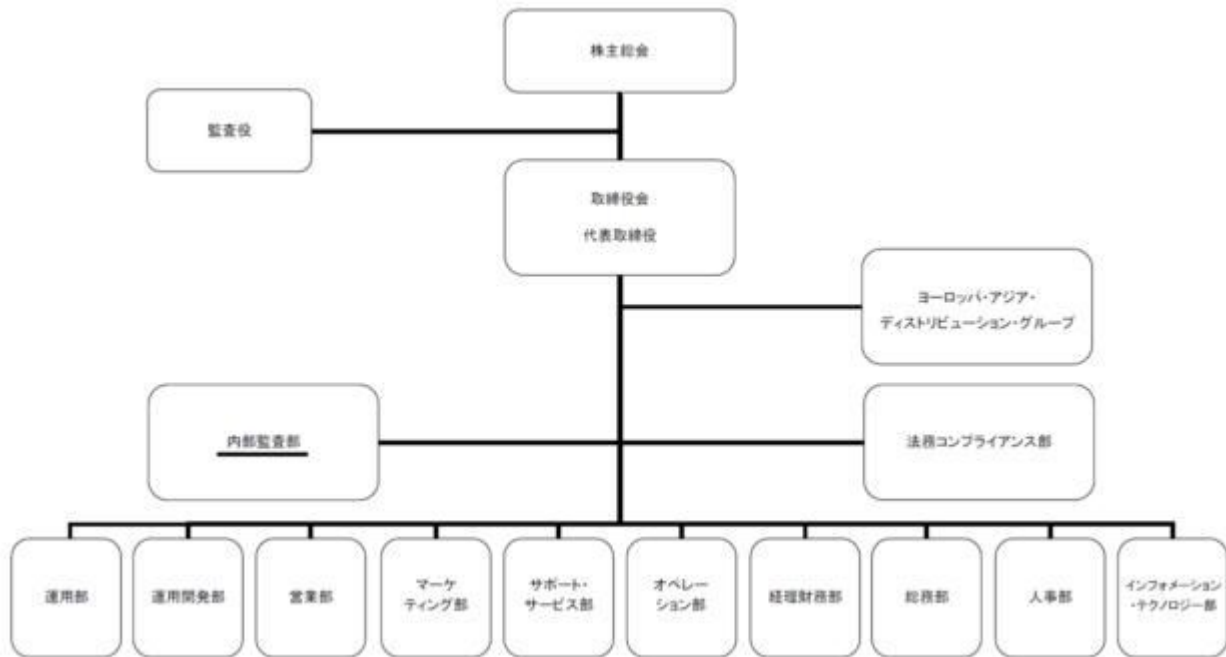
過去5年間における資本金の額の増減

2013年12月 資本金の額4億5,000万円から9億5,000万円に増資

2013年12月 資本金の額9億5,000万円から4億5,000万円に減資

(2) 会社の機構（2018年6月29日現在）

（中略）



(以下略)

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。

委託会社の運用する証券投資信託は2017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	22	388,271
合計	22	388,271

<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2018年6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	24	466,187
合計	24	466,187

3【委託会社等の経理状況】

原届出書の第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況につきまして

は、以下の訂正とともに、中間財務諸表の内容が追加されます。

<訂正前>

1. 財務諸表の作成方法について

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

財務諸表に記載している金額は、千円未満の端数を切捨てて表示しております。

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自平成28年7月1日 至平成29年6月30日）の財務諸表については有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

<訂正後>

1. 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自平成28年7月1日 至平成29年6月30日）の財務諸表については有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間（自平成29年7月1日 至平成29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

(平成29年12月31日現在)

科目	注記 番号	内訳 (千円)	金額 (千円)
(資産の部)			
・流動資産			
1. 現金・預金			951,621
2. 証券会社預け金			1,191,615
3. 前払費用			49,043
4. 未収入金			635,047

5.未収委託者報酬			1,385,367
6.未収運用受託報酬			1,016,466
7.繰延税金資産			232,029
8.立替金			6,592
流動資産計			5,467,784
.固定資産			
1.有形固定資産			75,471
器具備品	*1	75,471	
2.無形固定資産			2,921
ソフトウェア		2,921	
3.投資その他の資産			295,550
(1)保険積立金		11,087	
(2)長期差入保証金		274,005	
(3)繰延税金資産		10,458	
固定資産計			373,943
資産合計			5,841,727
(負債の部)			
.流動負債			
1.預り金			15,528
2.未払金			1,420,485
(1)未払手数料		889,313	
(2)その他未払金		531,171	
3.未払費用			77,331
4.未払法人税等			71,918
5.未払消費税等	*2		84,350
6.賞与引当金			367,571
7.役員賞与引当金			1,071
流動負債計			2,038,258
.固定負債			
1.退職給付引当金			1,295,396
2.資産除去債務			245,266
固定負債計			1,540,662
負債合計			3,578,920
(純資産の部)			
.株主資本			
1.資本金			450,000
2.資本剰余金			582,736
資本準備金		582,736	
3.利益剰余金			1,230,070
その他利益剰余金		1,230,070	
繰越利益剰余金		1,230,070	
株主資本計			2,262,806
純資産合計			2,262,806
負債・純資産合計			5,841,727

(2) 中間損益計算書

当中間会計期間

(自 平成29年 7月 1日 至 平成29年 12月31日)

科目	注記 番号	内訳 (千円)	金額 (千円)
. 営業収益			
1. 委託者報酬			1,979,926
2. 運用受託報酬			936,133
3. その他営業収益	*2		2,935,159
営業収益計			5,851,219
. 営業費用			
1. 支払手数料	*2		3,754,222
2. 広告宣伝費			39,756
3. 調査費			99,281
4. 営業雑経費			20,018
(1) 通信費		10,248	
(2) 印刷費		4,499	
(3) 協会費		5,270	
営業費用計			3,913,279
. 一般管理費			
1. 給料			1,149,229
(1) 役員報酬		27,902	
(2) 給料・手当		492,935	
(3) 賞与		392,363	
(4) 賞与引当金繰入額		234,956	
(5) 役員賞与引当金繰入額		1,071	
2. 交際費			5,349
3. 寄付金			950
4. 旅費交通費			53,226
5. 租税公課			18,725
6. 不動産賃借料			156,690
7. 退職給付費用			77,230
8. 固定資産減価償却費	*1		8,094
9. 器具備品賃借料			2,391
10. 消耗品費			9,528
11. 事務委託費			36,461
12. 採用費			8,589
13. 福利厚生費			98,573
14. 共通発生経費負担額	*3		61,281
15. 諸経費			4,021
一般管理費計			1,690,343
営業利益			247,596
. 営業外収益			
1. 受取利息及び配当金			6,741
2. 雑収入			91
営業外収益計			6,832
. 営業外費用			
1. 為替差損			3,306
2. 有価証券売却損			0
3. 固定資産除却損			3,251
営業外費用計			6,559
経常利益			247,870

税引前中間純利益			247,870
法人税、住民税及び事業税			55,193
法人税等調整額			40,276
中間純利益			232,952

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自平成29年7月1日 至平成29年12月31日)

(単位:千円)

	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	450,000	582,736	582,736	997,117	997,117	2,029,854	2,029,854
当中間期変動額							
中間純利益				232,952	232,952	232,952	232,952
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	-	-	-	232,952	232,952	232,952	232,952
当中間期末残高	450,000	582,736	582,736	1,230,070	1,230,070	2,262,806	2,262,806

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は、器具備品3~15年であります。

(2)無形固定資産

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

3. 外貨建資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

4. 引当金の計上基準

(1)賞与引当金

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

(2)役員賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間 (平成29年12月31日現在)	
*1. 有形固定資産の減価償却累計額	30,981 千円
*2. 消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。	

(中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自平成29年7月1日 至平成29年12月31日)	
*1. 減価償却実施額	
有形固定資産	7,471 千円
無形固定資産	623 千円
*2. 当社はキャピタル・グループの日本拠点として、キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー（以下「CRMC社」という。）との役務提供契約に基づき、当社の最終の親会社であるキャピタル・グループ・カンパニーズ・インクの各グループ会社（以下「各グループ会社」という。）との間で各種投資運用サービスを相互に提供しております。	
当社の主要な事業は、当社が各グループ会社に対して提供している各種投資運用サービス（市場調査業務、投資運用関連業務、マーケティング業務、顧客リレーションサポート業務など）であり、当該サービスに係る対価は、営業費用及び一般管理費の合計額から一定の支払手数料を差引いた金額を基準に一定の利益率を加味して算定し、その他営業収益に計上しております。	
当社が各グループ会社から提供を受けている各種投資運用サービスは、市場調査業務、投資運用関連業務、ITサービスなどであり、当該サービスに係る対価は、当社の委託者報酬及び運用受託報酬を基準に算定し、支払手数料に含めて計上しております。	
*3. 共通発生経費負担額は、各グループ会社の利益規模に応じて負担しております。	

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自平成29年7月1日 至平成29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

(自平成29年7月1日 至平成29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 238,796 千円

1年超 - 千円

合計 238,796 千円

[金融商品関係]

当中間会計期間

(自平成29年7月1日 至平成29年12月31日)

1. 金融商品の時価等に関する事項

	中間貸借対照表計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
長期差入保証金	274,005	274,727	722

時価については、下記の考え方によっております。その結果、平成29年12月31日における上記以外のその他金融商品の中間貸借対照表計上額は、時価と同額または近似しているため、上記表における記載を省略しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

(1)現金・預金、証券会社預け金、未収入金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬

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

(2)長期差入保証金

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

負債

(1)未払金

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

(注2)金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

[デリバティブ取引関係]

当中間会計期間

（自平成29年7月1日 至平成29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

（平成29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	243,467 千円
時の経過による調整額	1,799 千円
当中間会計期間末残高	245,266 千円

[セグメント情報等]

当中間会計期間

（自平成29年7月1日 至平成29年12月31日）

（セグメント情報）

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

日本	米国	その他	合計
2,820,581千円	2,935,159千円	95,478千円	5,851,219千円

（注）営業収益は、顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称又は氏名	営業収益
キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー	2,935,159千円

[1株当たり情報]

当中間会計期間

（自平成29年7月1日 至平成29年12月31日）

1株当たり純資産額	40,120.69	円
1株当たり中間純利益金額	4,130.37	円
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		
(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。		
中間純利益	232,952	千円
普通株主に帰属しない金額	-	千円
普通株式に係る中間純利益	232,952	千円
期中平均株式数	56,400	株

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額：324,279百万円(2017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(2017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(2017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(2018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(2018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(2018年3月31日現在)

(以下略)

独立監査人の中間監査報告書

平成30年7月17日

キャピタル・インターナショナル株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 中島紀子 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているキャピタル・グローバル・ボンド・ファンドF（限定為替ヘッジ）の平成29年11月21日から平成30年5月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、キャピタル・グローバル・ボンド・ファンドF（限定為替ヘッジ）の平成30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（平成29年11月21日から平成30年5月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成30年3月19日

キャピタル・インターナショナル株式会社
取締役 会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 誠 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 水野 龍也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているキャピタル・インターナショナル株式会社の平成29年7月1日から平成30年6月30日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成29年7月1日から平成29年12月31日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、キャピタル・インターナショナル株式会社の平成29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（平成29年7月1日から平成29年12月31日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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