

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年8月16日提出
【発行者名】	キャピタル・インターナショナル株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 トーマス・クワントリル
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内二丁目1番1号 明治安田生命ビル
【事務連絡者氏名】	原田 伸健
【電話番号】	03(6366)1000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 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(2019年2月15日から2020年2月13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、2019年2月14日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、「第二部ファンド情報」及び「第三部委託会社等の情報」における訂正事項を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書を以下の内容に訂正します。下線部 _____ は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(前略)

委託会社の概況(2018年12月28日現在)

(以下略)

<訂正後>

(前略)

委託会社の概況(2019年6月28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、2018年12月28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12月28日現在のものであり、今後、委託会社の判断その他理由により変更される場合があります。

<訂正後>

(前略)

<参考情報2>投資対象ファンドの概要等

(中略)

上記は、2019年6月28日現在のものであり、今後、投資顧問会社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、2019年6月28日現在のものであり、今後、委託会社の判断その他理由により変更される場合があります。

(3)【運用体制】

<訂正前>

（前略）

内部管理体制

（中略）

（参考情報）

キャピタル・インターナショナル株式会社の運用部門等の人員体制（2018年12月28日現在）

運用部（3名）／法務コンプライアンス部（2名）／オペレーション部（8名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

上記は2018年12月28日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

<訂正後>

（前略）

内部管理体制

（中略）

（参考情報）

キャピタル・インターナショナル株式会社の運用部門等の人員体制（2019年6月28日現在）

運用部（3名）／法務コンプライアンス部（3名）／オペレーション部（6名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

上記は2019年6月28日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

3【投資リスク】

<訂正前>

（前略）

上記は2018年12月28日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

<訂正後>

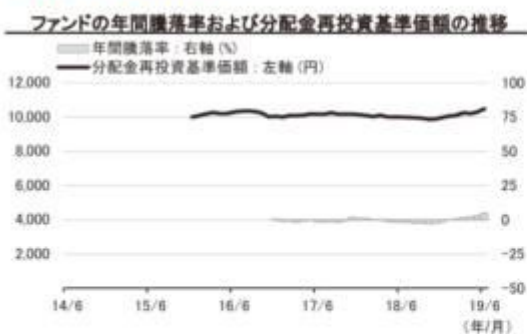
（前略）

上記は2019年6月28日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

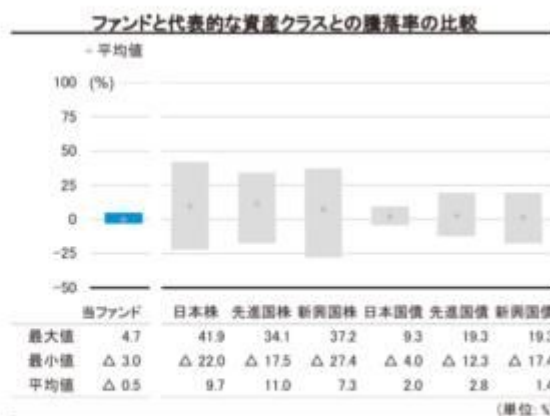
原届出書の第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 3投資リスク リスクの定量的比較につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

リスクの定量的比較



(注1) 年間騰落率は、2016年12月から2019年6月までの各月末における1年間の騰落率を表示したもので、分配金再投資基準価額を基に算出しています。
 (注2) 分配金再投資基準価額は、設定日(2015年12月30日)を10,000として指数化しています。
 (注3) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。



(注1) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
 (注2) 代表的な資産クラスの騰落率は、2014年7月から2019年6月までの5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
 (注3) ファンドの騰落率は、2016年12月から2019年6月までの各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

<各資産クラスの指数>

日本株・・・TOPIX(配当込み)

先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)

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

日本国債・・・NOMURA-BPI国債

先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本/円ベース)

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

※ 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

「ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数について

「日本株」の資産クラスはTOPIX(配当込み)を表示しております。

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

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

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

「日本国債」の資産クラスはNOMURA-BPI国債を表示しております。

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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

信託報酬の総額(消費税等相当額を含みます。)は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に**年0.4644%(税抜0.43%)**の率を乗じて得た額とします。

(中略)

<投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担>

当ファンドの信託報酬	年率0.4644%(税抜0.43%)
投資対象とする外国投資信託の信託報酬(*1)	年率0.00%

投資対象とする国内投資信託の信託報酬（*2） 年率0.007%

実質的な負担（*3） **年率0.4714%程度（税込）**

（中略）

（*2）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）は、年率0.1404%（税込）を上限とする信託報酬がかかりますが、当該ファンドの実質的な組入比率は低位を維持するため、受益者が実質的に負担する信託報酬の算出にあたっては、年率0.007%程度と見込み、当該年率を表示しています。

（以下略）

<訂正後>

信託報酬の総額（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に**年0.4644%¹（税抜0.43%）**の率を乗じて得た額とします。

（中略）

<投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担>

当ファンドの信託報酬 年率0.4644%¹（税抜0.43%）

投資対象とする外国投資信託の信託報酬（*1） 年率0.00%

投資対象とする国内投資信託の信託報酬（*2） 年率0.007%

実質的な負担（*3） **年率0.4714%程度（税込）²**

1 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、**年率0.473%**となります。

2 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、**年率0.48%程度（税込）**となります。

（中略）

（*2）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）は、年率0.1404%²（税抜0.13%）を上限とする信託報酬がかかりますが、当該ファンドの実質的な組入比率は低位を維持するため、受益者が実質的に負担する信託報酬の算出にあたっては、年率0.007%程度と見込み、当該年率を表示しています。2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、0.143%となります。

（以下略）

（5）【課税上の取扱い】

<訂正前>

課税上は、株式投資信託として取扱われ、個人受益者、法人受益者毎に以下の取扱いとなります。以下の取扱内容は、2018年12月28日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご注意ください。

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

（以下略）

<訂正後>

課税上は、株式投資信託として取扱われ、個人受益者、法人受益者毎に以下の取扱いとなります。以下の取扱内容は、2019年6月28日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご注意ください。

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

（以下略）

5【運用状況】

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

されます。

<更新・訂正後>

(1) 【投資状況】

キャピタル・グローバル・ボンド・ファンドF（限定為替ヘッジ）

2019年6月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	29,163,367,081	99.96
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		10,705,834	0.03
合計（純資産総額）		29,174,072,915	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）

2019年6月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	22,878,331	0.07
投資証券	ルクセンブルク	29,141,510,436	99.92
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）		29,164,388,767	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）

2019年6月28日現在

資産の種類	国/地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
	米国	16,266,353,010	32.83
	日本	8,267,738,281	16.69
	イタリア	3,383,923,391	6.83
	中国	2,018,916,957	4.07
	ドイツ	1,729,740,693	3.49
	メキシコ	1,665,872,764	3.36
	英国	1,646,608,544	3.32
	フランス	1,095,770,092	2.21
	スペイン	1,011,190,028	2.04
	デンマーク	954,387,985	1.93
	ルーマニア	950,829,647	1.92
	ノルウェー	828,519,123	1.67
	インド	780,257,062	1.57
	南アフリカ	692,476,278	1.40
	インドネシア	691,566,488	1.40
	タイ	680,519,699	1.37

債券	韓国	678,788,303	1.37
	ポーランド	609,763,678	1.23
	チリ	552,059,801	1.11
	国際機関	550,974,242	1.11
	マレーシア	512,699,995	1.03
	ロシア	509,876,232	1.03
	カナダ	507,448,831	1.02
	イスラエル	476,409,039	0.96
	オランダ	295,040,627	0.60
	アイルランド	255,820,188	0.52
	コロンビア	255,607,302	0.52
	パナマ	170,081,576	0.34
	アラブ首長国連邦	165,802,935	0.33
	ハンガリー	124,222,564	0.25
	モロッコ	107,145,470	0.22
	オーストラリア	100,398,773	0.20
	ペルー	85,035,973	0.17
	カタール	84,390,358	0.17
	ラトビア	79,678,794	0.16
	クウェート	71,148,690	0.14
	スイス	70,456,491	0.14
	サウジアラビア	62,997,182	0.13
	カザフスタン	41,892,005	0.08
	ウルグアイ	32,036,104	0.06
	ルクセンブルク	23,077,322	0.05
	銀行預金、その他資産（負債控除後）	459,672,351	0.93
	純資産総額	49,547,194,868	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

2019年1月23日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	日本	1,806,984,000	97.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		53,032,841	2.85
合計(純資産総額)		1,860,016,841	100.00

（注）投資比率は、日本短期債券マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（注）当該情報は委託会社が入手可能な直近日（2019年1月23日）現在の情報です。

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

キャピタル・グローバル・ボンド・ファンドF（限定為替ヘッジ）

a. 上位30銘柄

2019年6月28日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (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）	27,224,950,599	1.0073	27,424,405,685	1.0712	29,163,367,081	99.96

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

b. 種類別投資比率

2019年6月28日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.96
合計	99.96

(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

2019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・ボンド・ファンド(LUX) (クラスCh-JPY)	10,228,680.392	2,680.1	27,413,915,833	2,849	29,141,510,436	99.92
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	1.0548	22,878,331	1.0548	22,878,331	0.07

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

b. 種類別投資比率

2019年6月28日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	0.07
投資証券	99.92
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

2019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	US TREASURY I/L	0.875 2029/1/15	米国 債券 国債証券	16,260,000	106.4541 米ドル	1,865,525,245	3.77
2	ITALY GOVT BTPS EUR REG S (B)	2.8 2028/12/1	イタリア 債券 国債証券	11,095,000	106.9262 ユーロ	1,453,622,831	2.93
3	JAPAN GVT 346 JPY BD	0.1 2027/3/20	日本 債券 国債証券	1,132,500,000	102.6676 日本円	1,162,710,570	2.35
4	BONOS MEXICAN MXN	7.5 2027/6/3	メキシコ 債券 国債証券	165,912,500	99.261 メキシコ・ペソ	925,117,729	1.87
5	FNCN UMBS 3.0 MA3250	4.0 2049/2/1	米国 債券 その他債券	7,733,163	103.8692 米ドル	865,689,074	1.75
6	US TREASURY BOND	2.625 2029/2/15	米国 債券 国債証券	7,319,000	105.3328 米ドル	830,870,314	1.68
7	US TREASURY NOTE	2.75 2028/2/15	米国 債券 国債証券	6,910,000	106.2093 米ドル	790,967,810	1.60
8	JAPAN GVT 395 JPY BD	0.1 2020/12/1	日本 債券 国債証券	765,600,000	100.4402 日本円	768,970,171	1.55
9	FNCL UMBS 3.5 BJ4014	4.0 2049/2/1	米国 債券 その他債券	6,761,886	103.8692 米ドル	756,959,384	1.53
10	FNCN UMBS 3.5 AE9138	3.5 2049/7/1	米国 債券 その他債券	6,103,019	102.3953 米ドル	673,508,100	1.36
11	JAPAN GVT I/L 23 JPY	0.1 2028/3/10	日本 債券 国債証券	638,700,000	105.4471 日本円	673,490,628	1.36
12	JAPAN GVT 337 JPY BD	0.3 2024/12/20	日本 債券 国債証券	645,500,000	103.0751 日本円	665,349,771	1.34
13	JAPAN GVT I/L 24 JPY	0.100394 2029/3/10	日本 債券 国債証券	626,400,000	104.8198 日本円	656,591,227	1.33
14	ITALY GOVT BTPS EUR (B)	1.85 2024/5/15	イタリア 債券 国債証券	5,000,000	102.5569 ユーロ	628,311,958	1.27
15	SPAIN GOVT EUR 144A LIFE/REG S	1.45 2027/10/31	スペイン 債券 国債証券	4,550,000	109.9706 ユーロ	613,095,724	1.24
16	JAPAN GVT 394 JPY BD	0.1 2020/11/1	日本 債券 国債証券	577,200,000	100.4138 日本円	579,588,454	1.17
17	US TREASURY NOTE	2.75 2023/7/31	米国 債券 国債証券	5,000,000	103.9372 米ドル	560,091,802	1.13

18	ITALY GOVT BTPS EUR REG S I/L (B)	0.103078 2023/5/15	イタリア 債券 国債証券	4,475,000	100.6919 ユーロ	552,112,750	1.11
19	US TREASURY NOTE	2.25 2027/11/15	米国 債券 国債証券	5,000,000	102.2589 米ドル	551,047,513	1.11
20	US TREASURY NOTE	2.75 2025/6/30	米国 債券 国債証券	4,820,000	105.1713 米ドル	546,339,111	1.10
21	NYKREDIT DKK SR SEC SER 01E SF COVERED	1.5 2040/10/1	デンマーク 債券 その他債券	29,808,444	103.45 デンマーク・ クローネ	506,209,102	1.02
22	CHINA DEV BANK (BOND CONNECT) CNY UNSEC	3.48 2029/1/8	中国 債券 国債証券	32,400,000	97.8359 中国元	496,778,123	1.00
23	JAPAN GVT 145 JPY BD	1.7 2033/6/20	日本 債券 国債証券	400,000,000	123.2201 日本円	492,880,400	0.99
24	ROMANIA GOVT BOND EUR REG S	4.625 2049/4/3	ルーマニア 債券 国債証券	3,295,000	121.0625 ユーロ	488,770,913	0.99
25	US TREASURY NOTE	1.375 2023/8/31	米国 債券 国債証券	4,500,000	98.4961 米ドル	477,693,555	0.96
26	US TREASURY BOND	3.0 2049/2/15	米国 債券 国債証券	3,810,000	109.7756 米ドル	450,763,403	0.91
27	US TREASURY NOTE	2.375 2027/5/15	米国 債券 国債証券	3,875,000	103.2732 米ドル	431,297,991	0.87
28	ITALY GOVT BTPS EUR 144A LIFE/REG S	3.1 2040/3/1	イタリア 債券 国債証券	3,355,000	104.4248 ユーロ	429,275,783	0.87
29	NORWAY GOVT NOK 144A/REG S	3.75 2021/5/25	ノルウェー 債券 国債証券	31,679,000	104.7051 ノルウェー・ クローネ	419,708,395	0.85
30	G2SF 4.5 MA5987	4.5 2049/6/20	米国 債券 その他債券	3,314,647	104.527 米ドル	373,408,183	0.75

(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

2019年1月23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4回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2014)	0.425	2019/11/28	社債券	100,000	100.208	100,208,000	5.39
日本	第19回ルノー円貨社債(2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	99.503	99,503,000	5.35
日本	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債(2016)	0.3	2021/1/22	社債券	100,000	100.213	100,213,000	5.39
日本	第3回ソシエテ・ジェネラル非上位円貨社債(2018)	0.804	2023/10/12	社債券	100,000	98.616	98,616,000	5.30
日本	第488回中部電力	1.562	2019/2/25	社債券	100,000	100.127	100,127,000	5.38
日本	第521回関西電力	0.18	2023/9/20	社債券	100,000	99.863	99,863,000	5.37
日本	第4回富士フイルムホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.005	2020/3/3	社債券	100,000	99.949	99,949,000	5.37
日本	第50回日本電気(社債間限定同順位特約付)	0.29	2022/6/15	社債券	100,000	100.151	100,151,000	5.38
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	100.277	100,277,000	5.39
日本	第1回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.12	2020/10/30	社債券	100,000	100.148	100,148,000	5.38
日本	第22回あおぞら銀行(社債間限定同順位特約付)	0.1	2021/12/10	社債券	100,000	99.968	99,968,000	5.37
日本	第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	102.834	102,834,000	5.53
日本	第6回りそな銀行(劣後特約付)	2.084	2020/3/4	社債券	100,000	102.197	102,197,000	5.49
日本	第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	102.859	102,859,000	5.53
日本	第22回東京センチュリーリース(社債間限定同順位特約付)	0.06	2021/4/13	社債券	100,000	99.898	99,898,000	5.37
日本	第75回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.309	2023/2/28	社債券	100,000	99.826	99,826,000	5.37
日本	第69回日立キャピタル(社債間限定同順位特約付)	0.08	2020/12/18	社債券	100,000	100.026	100,026,000	5.38
日本	第33回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付)	0.297	2020/6/4	社債券	100,000	100.321	100,321,000	5.39

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

(注) 当該情報は委託会社が入手可能な直近日(2019年1月23日)現在の情報です。

【投資不動産物件】

キャピタル・グローバル・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 (2016年11月21日)	3,184,794,066	3,184,794,066	0.9994	0.9994
第2期 (2017年11月20日)	19,110,060,395	19,110,060,395	1.0153	1.0153
第3期 (2018年11月20日)	29,181,389,191	29,181,389,191	0.9856	0.9856
2018年 6月末日	28,101,239,922		0.9997	
7月末日	28,991,460,620		0.9985	
8月末日	29,266,962,247		0.9963	
9月末日	28,045,083,650		0.9933	
10月末日	28,088,977,520		0.9859	
11月末日	28,622,766,379		0.9891	
12月末日	28,936,529,953		0.9976	
2019年 1月末日	28,993,912,368		1.0056	
2月末日	28,932,757,809		1.0096	
3月末日	30,123,431,397		1.0247	
4月末日	29,915,667,957		1.0206	
5月末日	30,240,607,902		1.0287	

6月末日	29,174,072,915	1.0469
------	----------------	--------

(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	2015年12月30日～2016年11月21日	0
第2期	2016年11月22日～2017年11月20日	0
第3期	2017年11月21日～2018年11月20日	0

【収益率の推移】

キャピタル・グローバル・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	2015年12月30日～2016年11月21日	0.1
第2期	2016年11月22日～2017年11月20日	1.6
第3期	2017年11月21日～2018年11月20日	2.9
第4中間計算期間末	2018年11月21日～2019年5月20日	3.9

(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	2015年12月30日～2016年11月21日	3,231,682,126	44,994,811	3,186,687,315
第2期	2016年11月22日～2017年11月20日	16,726,579,299	1,091,922,289	18,821,344,325
第3期	2017年11月21日～2018年11月20日	21,829,166,685	11,042,653,256	29,607,857,754
第4中間計算期間末	2018年11月21日～2019年5月20日	2,738,288,695	3,029,366,151	29,316,780,298

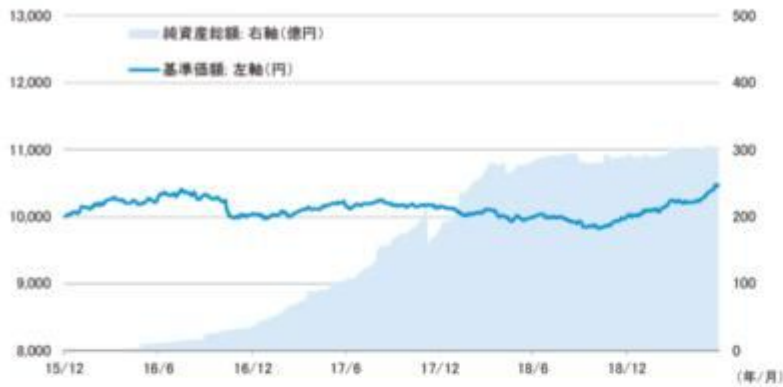
(注)第1期の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

参考情報

2019年6月28日現在

基準価額・純資産の推移(設定～2019年6月28日)



分配金の推移

第1期	2016年11月	0円
第2期	2017年11月	0円
第3期	2018年11月	0円
設定未累計		0円

分配金は1万円当たり、税引前

主要な資産の状況(2019年6月28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Ch-JPY)	99.92
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.07

<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>

(2019年6月28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 1/L 0.875% 01-15-29	米国	国債証券	3.77
2	ITALY GOVT BTPS EUR REG S (B) 2.80% 12-01-28	イタリア	国債証券	2.93
3	JAPAN GVT 346 JPY BD 0.1% 03-20-27	日本	国債証券	2.35
4	BONOS MEXICAN MXN 7.5% 06-03-27	メキシコ	国債証券	1.87
5	FNCN UMBS 3.0 MA3250 01-01-28	米国	その他証券	1.75
6	US TREASURY BOND 2.625% 02-15-29	米国	国債証券	1.68
7	US TREASURY NOTE 2.75% 02-15-28	米国	国債証券	1.60
8	JAPAN GVT 395 JPY BD 0.1% 12-01-20	日本	国債証券	1.55
9	FNCL UMBS 3.5 BJ4014 02-01-48	米国	その他証券	1.53
10	FNCN UMBS 3.5 AE9138 12-01-20	米国	その他証券	1.36

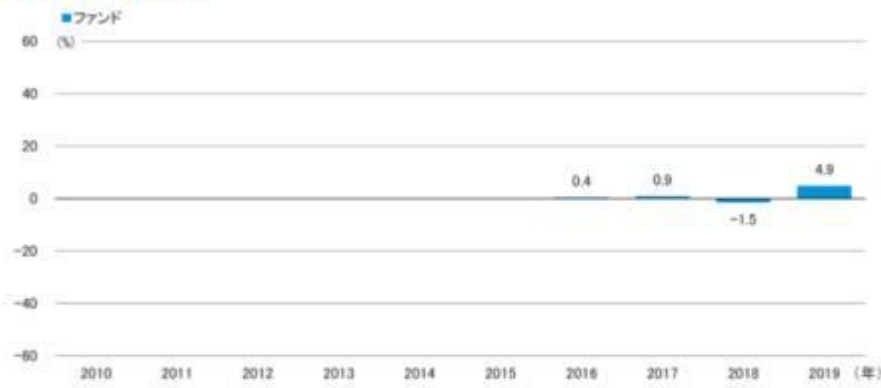
証券種別構成比率

証券種別	投資比率(%)
国債証券	75.98
社債券	14.36
その他証券	8.73
現金・その他	0.93

国別構成比率

国名	投資比率(%)
米国	32.83
日本	16.69
イタリア	6.83
中国	4.07
ドイツ	3.49
その他国	35.16
現金・その他	0.93

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算出。

2019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4期中間計算期間（2018年11月21日から2019年5月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【キャピタル・グローバル・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3期 2018年11月20日現在	第4期中間計算期間 2019年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,120,230,391	98,523,293
親投資信託受益証券	29,161,737,925	29,999,683,594
流動資産合計	30,281,968,316	30,098,206,887
資産合計	30,281,968,316	30,098,206,887
負債の部		
流動負債		
未払金	1,021,500,000	-
未払解約金	11,617,302	20,175,083
未払受託者報酬	3,096,629	3,137,596
未払委託者報酬	63,480,812	64,320,605
未払利息	3,069	283
その他未払費用	881,313	896,131
流動負債合計	1,100,579,125	88,529,698
負債合計	1,100,579,125	88,529,698
純資産の部		
元本等		
元本	29,607,857,754	29,316,780,298
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	426,468,563	692,896,891
元本等合計	29,181,389,191	30,009,677,189
純資産合計	29,181,389,191	30,009,677,189
負債純資産合計	30,281,968,316	30,098,206,887

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	第3期中間計算期間 自 2017年11月21日 至 2018年5月20日	第4期中間計算期間 自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	487,996,689	1,167,103,669
営業収益合計	487,996,689	1,167,103,669
営業費用		
支払利息	254,874	48,046
受託者報酬	2,460,126	3,137,596
委託者報酬	50,432,427	64,320,605
その他費用	942,645	896,131
営業費用合計	54,090,072	68,402,378
営業利益又は営業損失()	542,086,761	1,098,701,291
経常利益又は経常損失()	542,086,761	1,098,701,291
中間純利益又は中間純損失()	542,086,761	1,098,701,291
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()	18,982,947	51,014,229
期首剰余金又は期首欠損金()	288,716,070	426,468,563
剰余金増加額又は欠損金減少額	161,435,017	71,678,392
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	41,835,201
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	161,435,017	29,843,191
剰余金減少額又は欠損金増加額	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	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()	190,263,732	692,896,891

(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3期 2018年11月20日現在	第4期中間計算期間 2019年5月20日現在
1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 29,607,857,754口	1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数 29,316,780,298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 426,468,563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 - 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 0.9856円 (1万口当たり純資産額) (9,856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 1.0236円 (1万口当たり純資産額) (10,236円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 自 2017年11月21日 至 2018年11月20日	第4期中間計算期間 自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 親投資信託受益証券 「(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3期	第4期中間計算期間
	自 2017年11月21日 至 2018年11月20日	自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
期首元本額	18,821,344,325円	29,607,857,754円
期中追加設定元本額	21,829,166,685円	2,738,288,695円
期中一部解約元本額	11,042,653,256円	3,029,366,151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)

2019年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
投資信託受益証券	22,856,641
投資証券	29,977,227,523
流動資産合計	30,000,084,164
資産合計	30,000,084,164
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	28,658,467,324
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,341,616,840
元本等合計	30,000,084,164
純資産合計	30,000,084,164
負債純資産合計	30,000,084,164

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	2019年5月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数		28,658,467,324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	1.0468円
	(1万口当たり純資産額)	(10,468円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 投資信託受益証券</p> <p>「(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</p> <p>「(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</p> <p>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	2019年5月20日現在
同計算期間の期首元本額	29,002,225,684円
同計算期間の追加設定元本額	1,621,479,987円
同計算期間の一部解約元本額	1,965,238,347円
計算日の元本額	28,658,467,324円
元本額の内訳	
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）	28,658,467,324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、2018年12月31日付けで、ルクセンブルクにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務書類が作成されております。この財務書類は独立監査人であるプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コオペラティブの監査を受けております。以下の「投資明細表」および「損益および純資産変動計算書」は、原文の財務書類から委託会社が抜粋・翻訳したものでありますが、これらは監査意見の対象外であります。

キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド（LUX）

投資明細表

2018年12月31日現在

投資銘柄	通貨	数量/額面	評価額 (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				
<i>Australia</i>				
Australia Government Bond, Reg. S 5.5% 21/04/2023	AUD	1,200,000	969,993	0.22
Australia Government Bond, Reg. S 5.75% 15/07/2022	AUD	3,300,000	2,634,833	0.59
			3,604,826	0.81
<i>Canada</i>				
Canada Government Bond 2.25% 01/06/2025	CAD	2,390,000	1,786,093	0.40
Enbridge, Inc. 4.25% 01/12/2026	USD	55,000	54,504	0.01
Province of Quebec Canada 2.375% 31/01/2022	USD	289,000	285,671	0.07
			2,126,268	0.48
<i>Chile</i>				
Banco del Estado de Chile, Reg. S 2.668% 08/01/2021	USD	1,500,000	1,467,955	0.33
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4.5% 01/03/2026	CLP	690,000,000	1,013,809	0.23
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, Reg. S, 144A 4% 01/03/2023	CLP	1,215,000,000	1,759,423	0.39
Enel Americas SA 4% 25/10/2026	USD	75,000	70,242	0.02
			4,311,429	0.97
<i>China</i>				

China Development Bank 4.69% 23/03/2023	CNY	20,000,000	3,056,554	0.69
China Development Bank 4.24% 24/08/2027	CNY	13,500,000	2,016,309	0.45
China Development Bank 4.04% 06/07/2028	CNY	5,800,000	862,314	0.19
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd., 144A 3.5% 04/05/2027	USD	1,400,000	1,350,799	0.30
			7,285,976	1.63
<i>Colombia</i>				
Colombian TES 6.25% 26/11/2025	COP	4,625,000,000	1,414,015	0.32
			1,414,015	0.32
<i>Czech Republic</i>				
Czech Republic Government Bond, Reg. S 0.45% 25/10/2023	CZK	15,900,000	666,690	0.15
			666,690	0.15
<i>Denmark</i>				
Nykredit Realkredit A/S 1.5% 01/10/2037	DKK	23,794,234	3,679,681	0.82
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 1.5% 01/10/2040	DKK	52,370,376	7,994,388	1.79
Nykredit Realkredit A/S 2% 01/10/2037	DKK	7,516,822	1,201,377	0.27
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 2.5% 01/10/2047	DKK	2,503,759	401,892	0.09
Realkredit Danmark A/S 2% 01/10/2037	DKK	1		
			13,277,338	2.97
<i>France</i>				
AXA SA, Reg. S, FRN 3.25% 28/05/2049	EUR	500,000	548,286	0.12
AXA SA, Reg. S, FRN 5.453% Perpetual	GBP	150,000	194,337	0.04
BPCE SA, Reg. S 4.625% 18/07/2023	EUR	200,000	260,221	0.06
BPCE SA, Reg. S, FRN 2.75% 08/07/2026	EUR	500,000	591,660	0.13
France Government Bond OAT, Reg. S 1% 25/11/2025	EUR	1,140,000	1,371,268	0.31
France Government Bond OAT, Reg. S, 144A 2% 25/05/2048	EUR	1,550,000	1,931,063	0.43
France Government Bond OAT, Reg. S 2.25% 25/05/2024	EUR	1,035,000	1,328,445	0.30
Orange SA, Reg. S, FRN 5% Perpetual	EUR	270,000	331,007	0.07
Sanofi, Reg. S 1% 21/03/2026	EUR	500,000	581,393	0.13
Veolia Environnement SA, Reg. S 0.314% 04/10/2023	EUR	300,000	337,706	0.08
			7,475,386	1.67
<i>Germany</i>				
Allianz SE, Reg. S, FRN 4.75% Perpetual	EUR	800,000	1,008,960	0.23
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 1.75% 15/02/2024	EUR	4,110,000	5,202,586	1.17
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.5% 15/08/2027	EUR	5,445,000	6,449,230	1.44
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.5% 15/02/2028	EUR	2,880,000	3,397,440	0.76
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 2% 04/01/2022	EUR	200,000	246,950	0.06
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.5% 15/02/2026	EUR	825,000	982,840	0.22
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 2.5% 15/08/2046	EUR	1,230,000	1,985,766	0.44
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 1.25% 15/08/2048	EUR	1,125,000	1,416,323	0.32
Daimler International Finance BV, Reg. S 0.875% 09/04/2024	EUR	225,000	254,724	0.06
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.125% 07/03/2022	USD	383,000	377,270	0.08
Volkswagen International Finance NV, Reg. S 1.125% 02/10/2023	EUR	200,000	224,498	0.05
Volkswagen Leasing GmbH, Reg. S 1.125% 04/04/2024	EUR	200,000	221,521	0.05
			21,768,108	4.88
<i>Hungary</i>				
Hungary Government Bond 5.375% 25/03/2024	USD	1,020,000	1,094,093	0.25
			1,094,093	0.25

India

India Government Bond 7.59% 11/01/2026	INR	49,600,000	718,584	0.16
India Government Bond 6.79% 15/05/2027	INR	153,800,000	2,118,812	0.47
India Government Bond 7.8% 11/04/2021	INR	65,000,000	945,090	0.21
India Government Bond 7.35% 22/06/2024	INR	110,000,000	1,574,962	0.35
India Government Bond 6.97% 06/09/2026	INR	160,000,000	2,236,377	0.50
State of Maharashtra India 8.54% 20/03/2023	INR	17,200,000	253,255	0.06
State of Maharashtra India 8.51% 09/03/2026	INR	24,300,000	355,580	0.08
State of Maharashtra India 9.63% 12/02/2024	INR	11,500,000	177,479	0.04
State of Maharashtra India 8.21% 09/12/2025	INR	20,000,000	289,693	0.07
			8,669,832	1.94

Indonesia

Indonesia Government Bond, Reg. S 4.75% 08/01/2026	USD	1,270,000	1,289,411	0.29
Indonesia Treasury 6.125% 15/05/2028	IDR	4,129,000,000	253,396	0.06
Indonesia Treasury 8.25% 15/05/2029	IDR	16,522,000,000	1,178,321	0.26
Indonesia Treasury 7.5% 15/08/2032	IDR	9,000,000,000	587,535	0.13
			3,308,663	0.74

Ireland

Abbott Ireland Financing DAC, Reg. S 0.875% 27/09/2023	EUR	630,000	721,990	0.16
Ireland Government Bond, Reg. S 0.9% 15/05/2028	EUR	3,115,000	3,571,245	0.80
Ireland Government Bond, Reg. S 2.4% 15/05/2030	EUR	140,000	182,134	0.04
			4,475,369	1.00

Israel

Israel Government Bond 2% 31/03/2027	ILS	9,625,000	2,556,762	0.57
Israel Government Bond 5.5% 31/01/2042	ILS	2,850,000	1,050,740	0.24
			3,607,502	0.81

Italy

Assicurazioni Generali SpA, Reg. S, FRN 7.75% 12/12/2042	EUR	200,000	267,396	0.06
Intesa Sanpaolo SpA, Reg. S 6.625% 13/09/2023	EUR	150,000	195,208	0.04
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 15/05/2025	EUR	925,000	1,015,703	0.23
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.05% 01/08/2027	EUR	1,550,000	1,711,280	0.38
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.35% 15/04/2022	EUR	2,550,000	2,932,239	0.66
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 15/03/2023	EUR	380,000	424,856	0.10
			6,546,682	1.47

Japan

Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/12/2022	JPY	260,000,000	2,395,755	0.54
Japan Government Ten Year Bond 1.2% 20/06/2021	JPY	260,000,000	2,450,661	0.55
Japan Government Ten Year Bond 0.8% 20/09/2022	JPY	340,000,000	3,210,834	0.72
Japan Government Ten Year Bond 0.3% 20/12/2024	JPY	645,500,000	6,045,120	1.35
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/09/2026	JPY	130,000,000	1,206,940	0.27
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/03/2027	JPY	1,375,000,000	12,755,617	2.86
Japan Government Thirty Year Bond 0.8% 20/12/2047	JPY	186,700,000	1,743,422	0.39
Japan Government Thirty Year Bond 0.7% 20/06/2048	JPY	180,000,000	1,635,365	0.37
Japan Government Thirty Year Bond 1.7% 20/03/2044	JPY	15,000,000	170,796	0.04
Japan Government Thirty Year Bond 0.6% 20/12/2046	JPY	197,800,000	1,760,304	0.39
Japan Government Twenty Year Bond 2.2% 20/03/2030	JPY	50,000,000	563,695	0.13

Japan Government Twenty Year Bond 1.7% 20/06/2033	JPY	400,000,000	4,399,708	0.98
Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/06/2037	JPY	80,000,000	748,861	0.17
Japan Government Two Year Bond 0.1% 01/11/2020	JPY	704,000,000	6,451,654	1.44
Japan Government Two Year Bond 0.1% 01/12/2020	JPY	1,155,600,000	10,590,707	2.37
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., Reg. S 2.25% 21/11/2026	EUR	525,000	615,201	0.14
			56,744,640	12.71
<i>Kazakhstan</i>				
Kazakhstan Government Bond, Reg. S 1.55% 09/11/2023	EUR	225,000	259,595	0.06
			259,595	0.06
<i>Kuwait</i>				
Kuwait Government Bond, 144A 2.75% 20/03/2022	USD	650,000	639,068	0.14
			639,068	0.14
<i>Mexico</i>				
Mexican Bonos 8% 07/12/2023	MXN	71,700,000	3,563,702	0.80
Mexican Bonos 6.5% 10/06/2021	MXN	28,100,000	1,366,225	0.31
Mexican Bonos 6.5% 09/06/2022	MXN	33,000,000	1,577,612	0.35
Mexican Bonos 10% 05/12/2024	MXN	29,000,000	1,568,827	0.35
Mexican Bonos 5.75% 05/03/2026	MXN	128,100,000	5,512,764	1.24
Mexican Bonos 7.5% 03/06/2027	MXN	18,500,000	875,080	0.20
Mexican Bonos 10% 20/11/2036	MXN	5,200,000	291,481	0.07
Mexican Bonos 7.75% 13/11/2042	MXN	7,100,000	319,374	0.07
Mexico Government Bond 3.6% 30/01/2025	USD	485,000	463,660	0.10
Mexico Government Bond 4.15% 28/03/2027	USD	290,000	280,839	0.06
Petroleos Mexicanos 6.35% 12/02/2048	USD	445,000	356,676	0.08
Petroleos Mexicanos 7.47% 12/11/2026	MXN	12,000,000	450,494	0.10
			16,626,734	3.73
<i>Morocco</i>				
Morocco Government Bond, Reg. S 4.25% 11/12/2022	USD	950,000	954,693	0.21
			954,693	0.21
<i>Netherlands</i>				
Cooperatieve Rabobank UA, Reg. S 3.875% 25/07/2023	EUR	250,000	320,779	0.07
Cooperatieve Rabobank UA, Reg. S, FRN 2.5% 26/05/2026	EUR	550,000	652,844	0.15
Enel Finance International NV, Reg. S 1% 16/09/2024	EUR	100,000	113,308	0.03
NN Group NV, Reg. S, FRN 4.625% 08/04/2044	EUR	200,000	241,346	0.05
NN Group NV, Reg. S, FRN 4.5% Perpetual	EUR	150,000	171,843	0.04
			1,500,120	0.34
<i>Norway</i>				
Equinor ASA 3.7% 01/03/2024	USD	100,000	101,929	0.02
Norway Government Bond, Reg. S, 144A 3.75% 25/05/2021	NOK	6,000,000	736,743	0.17
			838,672	0.19
<i>Panama</i>				
Panama Government Bond 4.5% 16/04/2050	USD	675,000	648,000	0.15
			648,000	0.15
<i>Peru</i>				
Peru Government Bond, Reg. S, 144A 6.15% 12/08/2032	PEN	7,100,000	2,148,161	0.48
			2,148,161	0.48
<i>Poland</i>				
Poland Government Bond 2.5% 25/01/2023	PLN	2,000,000	544,631	0.12
Poland Government Bond 4% 22/01/2024	USD	170,000	174,289	0.04
Poland Government Bond 1.5% 25/04/2020	PLN	13,500,000	3,623,679	0.81

Poland Government Bond 5.25% 25/10/2020	PLN	1,200,000	343,119	0.08
Poland Government Bond 5.75% 25/10/2021	PLN	22,120,000	6,561,791	1.47
Poland Government Bond 5.75% 23/09/2022	PLN	4,900,000	1,488,874	0.33
Poland Government Bond 4% 25/10/2023	PLN	3,140,000	910,238	0.21
Poland Government Bond 3.25% 25/07/2025	PLN	12,960,000	3,625,309	0.81
Poland Government Bond 3.25% 06/04/2026	USD	785,000	770,058	0.17
			18,041,988	4.04
<i>Portugal</i>				
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, Reg. S, 144A 2.875% 15/10/2025	EUR	1,600,000	2,042,073	0.46
			2,042,073	0.46
<i>Qatar</i>				
Qatar Government Bond, Reg. S 4.5% 23/04/2028	USD	700,000	732,343	0.16
			732,343	0.16
<i>Romania</i>				
Romania Government Bond, 144A 5.125% 15/06/2048	USD	400,000	386,504	0.09
Romania Government Bond 2.3% 26/10/2020	RON	5,210,000	1,249,470	0.28
Romania Government Bond 5.95% 11/06/2021	RON	5,840,000	1,505,245	0.34
Romania Government Bond 3.4% 08/03/2022	RON	1,500,000	361,904	0.08
Romania Government Bond, Reg. S 2.875% 11/03/2029	EUR	760,000	845,788	0.19
Romania Government Bond, Reg. S 3.875% 29/10/2035	EUR	510,000	570,395	0.13
Romania Government Bond, Reg. S 3.375% 08/02/2038	EUR	760,000	778,713	0.17
Romania Government Bond, Reg. S 5.125% 15/06/2048	USD	700,000	676,382	0.15
Romania Government Bond 3.25% 22/03/2021	RON	2,325,000	565,993	0.13
			6,940,394	1.56
<i>Russian Federation</i>				
Russian Federal Bond - OFZ 7% 16/08/2023	RUB	76,300,000	1,043,046	0.23
			1,043,046	0.23
<i>Saudi Arabia</i>				
Saudi Government Bond, Reg. S 4.5% 17/04/2030	USD	640,000	637,716	0.14
Saudi Government Bond, Reg. S 5% 17/04/2049	USD	600,000	579,595	0.13
			1,217,311	0.27
<i>South Africa</i>				
South Africa Government Bond 7.75% 28/02/2023	ZAR	3,225,000	221,523	0.05
South Africa Government Bond 6.5% 28/02/2041	ZAR	36,800,000	1,785,962	0.40
South Africa Government Bond 8.75% 31/01/2044	ZAR	23,400,000	1,448,401	0.32
			3,455,886	0.77
<i>South Korea</i>				
Hyundai Capital Services, Inc., 144A 3.75% 05/03/2023	USD	350,000	345,719	0.08
Korea Housing Finance Corp., Reg. S 2% 11/10/2021	USD	590,000	568,941	0.13
Korea Treasury 2% 10/09/2022	KRW	1,752,900,000	1,577,431	0.35
			2,492,091	0.56
<i>Spain</i>				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Reg. S, FRN 3.5% 11/04/2024	EUR	600,000	691,773	0.15
CaixaBank SA, Reg. S, FRN 3.5% 15/02/2027	EUR	200,000	235,950	0.05
Spain Government Bond, Reg. S, 144A 1.5% 30/04/2027	EUR	2,050,000	2,402,713	0.54
Spain Government Bond, Reg. S, 144A 2.7% 31/10/2048	EUR	1,650,000	1,927,634	0.43
Spain Government Bond, Reg. S, 144A 1.45% 31/10/2027	EUR	3,715,000	4,319,082	0.97

Spain Government Bond, Reg. S, 144A 2.9% 31/10/2046	EUR	310,000	380,916	0.09
			9,958,068	2.23
<i>Supra National</i>				
European Financial Stability Facility, Reg. S 0.4% 17/02/2025	EUR	1,100,000	1,268,701	0.29
European Financial Stability Facility, Reg. S 0.95% 14/02/2028	EUR	1,500,000	1,756,605	0.39
European Investment Bank 2.25% 15/03/2022	USD	413,000	408,261	0.09
			3,433,567	0.77
<i>Sweden</i>				
Sweden Government Bond, Reg. S 1.125% 21/10/2019	USD	260,000	257,014	0.06
			257,014	0.06
<i>Switzerland</i>				
Credit Suisse Group AG, Reg. S, FRN 2.125% 12/09/2025	GBP	360,000	436,172	0.10
			436,172	0.10
<i>Thailand</i>				
Bank of Thailand 1.5% 21/03/2019	THB	27,770,000	852,698	0.19
Thailand Government Bond 3.775% 25/06/2032	THB	24,000,000	813,297	0.18
Thailand Government Bond 1.875% 17/06/2022	THB	22,500,000	688,202	0.15
Thailand Government Bond 3.85% 12/12/2025	THB	21,400,000	719,729	0.16
Thailand Government Bond 2.125% 17/12/2026	THB	112,250,000	3,374,512	0.76
			6,448,438	1.44
<i>United Arab Emirates</i>				
Abu Dhabi Government Bond, 144A 2.5% 11/10/2022	USD	700,000	680,799	0.15
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC, Reg. S 3.625% 12/01/2023	USD	810,000	795,266	0.18
			1,476,065	0.33
<i>United Kingdom</i>				
AstraZeneca plc 3.5% 17/08/2023	USD	400,000	398,298	0.09
Aviva plc, Reg. S, FRN 6.125% 05/07/2043	EUR	325,000	414,970	0.09
Barclays Bank plc, Reg. S 10% 21/05/2021	GBP	225,000	330,448	0.07
BAT Capital Corp. 3.557% 15/08/2027	USD	550,000	489,420	0.11
HSBC Holdings plc, FRN 4.292% 12/09/2026	USD	1,250,000	1,235,485	0.28
HSBC Holdings plc, FRN 3.033% 22/11/2023	USD	500,000	484,193	0.11
Lloyds Bank plc, Reg. S 6.5% 24/03/2020	EUR	150,000	183,328	0.04
Shell International Finance BV 3.5% 13/11/2023	USD	886,000	896,413	0.20
Shell International Finance BV 1.375% 12/09/2019	USD	340,000	336,345	0.08
Shell International Finance BV 2.5% 12/09/2026	USD	400,000	371,878	0.08
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/09/2021	USD	328,000	317,363	0.07
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23/09/2023	USD	20,000	18,926	
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.2% 23/09/2026	USD	605,000	548,683	0.12
UK Treasury, Reg. S 1.25% 22/07/2027	GBP	1,075,000	1,377,261	0.31
UK Treasury, Reg. S 1.5% 22/07/2047	GBP	1,390,000	1,639,967	0.37
UK Treasury, Reg. S 1.75% 07/09/2022	GBP	1,000,000	1,316,872	0.30
UK Treasury, Reg. S 2.75% 07/09/2024	GBP	590,000	826,098	0.19
UK Treasury, Reg. S 4.25% 07/12/2027	GBP	1,450,000	2,330,790	0.52
UK Treasury, Reg. S 3.25% 22/01/2044	GBP	160,000	260,850	0.06
UK Treasury, Reg. S 3.5% 22/01/2045	GBP	285,000	486,425	0.11
UK Treasury, Reg. S 4.25% 07/12/2046	GBP	230,000	446,781	0.10
			14,710,794	3.30
<i>United States of America</i>				
Abbott Laboratories 3.75% 30/11/2026	USD	395,000	390,969	0.09

AbbVie, Inc. 2.5% 14/05/2020	USD	190,000	188,232	0.04
AbbVie, Inc. 3.6% 14/05/2025	USD	200,000	192,190	0.04
Allergan Funding SCS 3.8% 15/03/2025	USD	441,000	431,287	0.10
Altria Group, Inc. 2.625% 14/01/2020	USD	350,000	346,847	0.08
American Campus Communities Operating Partnership LP, REIT 3.75% 15/04/2023	USD	400,000	397,477	0.09
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 3.5% 12/01/2024	USD	225,000	220,074	0.05
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4% 13/04/2028	USD	600,000	575,360	0.13
Bank of America Corp. 2.625% 19/10/2020	USD	120,000	118,751	0.03
Becton Dickinson and Co. 3.734% 15/12/2024	USD	81,000	78,342	0.02
Berkshire Hathaway Finance Corp. 3% 15/05/2022	USD	125,000	124,767	0.03
Chubb INA Holdings, Inc. 2.875% 03/11/2022	USD	20,000	19,840	
Chubb INA Holdings, Inc. 3.35% 03/05/2026	USD	20,000	19,593	
Citigroup, Inc. 2.75% 25/04/2022	USD	700,000	679,218	0.15
Citigroup, Inc. 3.3% 27/04/2025	USD	100,000	95,141	0.02
CMS Energy Corp. 3% 15/05/2026	USD	300,000	282,694	0.06
CMS Energy Corp. 3.6% 15/11/2025	USD	175,000	172,382	0.04
Conagra Brands, Inc. 4.3% 01/05/2024	USD	540,000	537,336	0.12
CVS Health Corp. 3.7% 09/03/2023	USD	100,000	99,019	0.02
CVS Health Corp. 4.1% 25/03/2025	USD	95,000	94,294	0.02
CVS Health Corp. 4.3% 25/03/2028	USD	385,000	377,697	0.09
CVS Health Corp. 4.78% 25/03/2038	USD	50,000	48,113	0.01
CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	USD	575,000	562,101	0.13
Duke Energy Corp. 3.75% 15/04/2024	USD	155,000	155,411	0.04
Duke Energy Corp. 2.65% 01/09/2026	USD	470,000	428,846	0.10
Duke Energy Progress LLC 3.7% 01/09/2028	USD	225,000	227,695	0.05
Enbridge Energy Partners LP 5.875% 15/10/2025	USD	155,000	168,233	0.04
Energy Transfer Operating LP 6% 15/06/2048	USD	50,000	48,915	0.01
Energy Transfer Operating LP 4.2% 15/04/2027	USD	30,000	28,044	0.01
Essex Portfolio LP, REIT 3.5% 01/04/2025	USD	120,000	116,842	0.03
Exelon Corp. 3.497% 01/06/2022	USD	610,000	596,534	0.13
Exelon Corp. 3.4% 15/04/2026	USD	60,000	57,163	0.01
FirstEnergy Corp. 3.9% 15/07/2027	USD	195,000	189,309	0.04
FirstEnergy Corp. 4.85% 15/07/2047	USD	210,000	211,212	0.05
Ford Motor Credit Co. LLC 3.339% 28/03/2022	USD	300,000	283,374	0.06
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 2.875% 25/02/2021	USD	100,000	98,337	0.02
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.85% 08/07/2024	USD	200,000	195,643	0.04
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 3.75% 25/02/2026	USD	15,000	14,213	
Halliburton Co. 3.8% 15/11/2025	USD	50,000	48,562	0.01
Honeywell International, Inc. 1.85% 01/11/2021	USD	450,000	435,051	0.10
JPMorgan Chase & Co. 2.55% 01/03/2021	USD	440,000	433,913	0.10
Kinder Morgan, Inc. 4.3% 01/03/2028	USD	240,000	236,061	0.05
Medtronic, Inc. 3.5% 15/03/2025	USD	470,000	468,734	0.11
Morgan Stanley 4% 23/07/2025	USD	70,000	69,149	0.02
Morgan Stanley 3.125% 27/07/2026	USD	260,000	240,214	0.05
Oracle Corp. 2.65% 15/07/2026	USD	443,000	411,186	0.09
Pacific Gas & Electric Co. 3.3% 01/12/2027	USD	450,000	369,685	0.08
Pacific Gas & Electric Co. 3.95% 01/12/2047	USD	140,000	107,176	0.02
Pacific Gas & Electric Co. 3.85% 15/11/2023	USD	110,000	98,990	0.02
Pfizer, Inc. 3.2% 15/09/2023	USD	700,000	703,167	0.16
Philip Morris International, Inc. 2% 21/02/2020	USD	280,000	276,518	0.06
PNC Financial Services Group, Inc. (The) 3.3% 08/03/2022	USD	70,000	69,874	0.02
Prologis LP, REIT 3.75% 01/11/2025	USD	70,000	70,485	0.02
Public Service Enterprise Group, Inc. 2% 15/11/2021	USD	500,000	480,461	0.11
Santander Holdings USA, Inc. 4.45% 03/12/2021	USD	700,000	712,568	0.16
Sunoco Logistics Partners Operations LP 4% 01/10/2027	USD	409,000	375,902	0.08
Union Pacific Corp. 4.5% 10/09/2048	USD	60,000	59,488	0.01
United Technologies Corp. 4.125% 16/11/2028	USD	450,000	447,733	0.10
US Treasury 2.375% 31/01/2023	USD	4,200,000	4,181,461	0.94
US Treasury 2.625% 28/02/2023	USD	2,500,000	2,513,281	0.56

US Treasury 2.5% 31/03/2023	USD	3,325,000	3,326,039	0.75
US Treasury 2.75% 30/04/2023	USD	1,750,000	1,768,389	0.40
US Treasury 1.75% 15/05/2023	USD	800,000	775,437	0.17
US Treasury 2.75% 30/06/2025	USD	6,670,000	6,738,263	1.51
US Treasury 2.75% 15/02/2028	USD	14,082,000	14,167,892	3.18
US Treasury 2.875% 15/08/2028	USD	9,150,000	9,300,791	2.08
US Treasury 2.75% 15/11/2047	USD	3,050,000	2,890,936	0.65
US Treasury 3% 15/02/2048	USD	1,950,000	1,942,536	0.44
US Treasury 3% 15/08/2048	USD	4,830,000	4,814,597	1.08
US Treasury 1.625% 30/06/2019	USD	674,400	671,423	0.15
US Treasury 1.625% 31/12/2019	USD	900,000	891,281	0.20
US Treasury 1.375% 31/01/2021	USD	890,000	869,927	0.20
US Treasury 2% 31/08/2021	USD	2,250,000	2,222,949	0.50
US Treasury 2% 31/12/2021	USD	1,700,000	1,677,685	0.38
US Treasury 1.875% 31/01/2022	USD	1,600,000	1,572,202	0.35
US Treasury 1.875% 30/09/2022	USD	11,370,000	11,129,232	2.49
US Treasury 2% 31/10/2022	USD	3,500,000	3,439,593	0.77
US Treasury 2.125% 31/12/2022	USD	4,855,000	4,789,134	1.07
US Treasury 1.375% 31/08/2023	USD	2,500,000	2,377,051	0.53
US Treasury 2.25% 31/01/2024	USD	1,600,000	1,579,688	0.35
US Treasury 2.125% 30/09/2024	USD	1,400,000	1,368,445	0.31
US Treasury 2% 15/11/2026	USD	1,000,000	954,688	0.21
US Treasury 2.375% 15/05/2027	USD	3,875,000	3,796,302	0.85
US Treasury 2.25% 15/11/2027	USD	7,900,000	7,638,617	1.71
US Treasury 3% 15/05/2047	USD	1,300,000	1,296,321	0.29
US Treasury Inflation Indexed 0.625% 15/04/2023	USD	1,400,000	1,403,007	0.31
US Treasury Inflation Indexed 0.625% 15/01/2024	USD	3,280,000	3,501,328	0.78
US Treasury Inflation Indexed 0.125% 15/07/2024	USD	2,410,000	2,462,947	0.55
US Treasury Inflation Indexed 0.25% 15/01/2025	USD	1,780,000	1,819,852	0.41
US Treasury Inflation Indexed 0.375% 15/01/2027	USD	3,300,000	3,282,159	0.74
US Treasury Inflation Indexed 1% 15/02/2046	USD	1,840,000	1,865,027	0.42
Verizon Communications, Inc. 4.5% 10/08/2033	USD	150,000	148,579	0.03
			128,163,471	28.72
<i>Uruguay</i>				
Uruguay Government Bond, 144A 8.5% 15/03/2028	UYU	5,950,000	155,946	0.03
Uruguay Government Bond, Reg. S 9.875% 20/06/2022	UYU	5,490,000	168,011	0.04
			323,957	0.07
債券合計			371,164,538	83.17
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			371,164,538	83.17
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				
<i>Australia</i>				
WEA Finance LLC, REIT, 144A 3.75% 17/09/2024	USD	200,000	198,784	0.04
WEA Finance LLC, REIT, Reg. S 3.15% 05/04/2022	USD	260,000	256,187	0.06
			454,971	0.10
<i>Canada</i>				
Canada Government Bond 1% 01/09/2022	CAD	600,000	425,727	0.09
Enbridge, Inc. 3.7% 15/07/2027	USD	237,000	225,004	0.05
Province of Saskatchewan Canada 3.05% 02/12/2028	CAD	700,000	519,683	0.12
			1,170,414	0.26
<i>Chile</i>				
Colbun SA, Reg. S 3.95% 11/10/2027	USD	400,000	369,750	0.08
			369,750	0.08
<i>France</i>				
BPCE SA, 144A 5.15% 21/07/2024	USD	632,000	635,332	0.15
Pernod Ricard SA, 144A 4.45% 15/01/2022	USD	400,000	408,252	0.09
			1,043,584	0.24
<i>Germany</i>				
Daimler Finance North America LLC, Reg. S 2.45% 18/05/2020	USD	500,000	494,083	0.11

Daimler Finance North America LLC, Reg. S 2% 06/07/2021	USD	460,000	442,734	0.10
EMD Finance LLC, 144A 3.25% 19/03/2025	USD	825,000	792,691	0.18
			1,729,508	0.39
<i>Italy</i>				
Intesa Sanpaolo SpA, 144A 5.017% 26/06/2024	USD	1,000,000	905,911	0.21
UniCredit SpA, 144A 4.625% 12/04/2027	USD	450,000	412,670	0.09
			1,318,581	0.30
<i>Japan</i>				
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2024	JPY	300,000,000	2,920,509	0.65
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/09/2024	JPY	105,000,000	996,654	0.22
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2025	JPY	50,000,000	476,692	0.11
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2026	JPY	90,000,000	861,190	0.19
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2027	JPY	165,000,000	1,585,751	0.36
Nissan Motor Acceptance Corp., 144A 2.6% 28/09/2022	USD	1,175,000	1,119,551	0.25
			7,960,347	1.78
<i>Malaysia</i>				
Malaysia Government Bond 4.232% 30/06/2031	MYR	1,500,000	356,637	0.08
Malaysia Government Bond 3.882% 10/03/2022	MYR	1,800,000	438,041	0.10
Malaysia Government Bond 3.9% 30/11/2026	MYR	10,972,000	2,614,772	0.58
Malaysia Government Bond 4.498% 15/04/2030	MYR	2,500,000	611,067	0.14
			4,020,517	0.90
<i>Netherlands</i>				
Enel Finance International NV, 144A 2.75% 06/04/2023	USD	600,000	554,055	0.12
Enel Finance International NV, 144A 3.625% 25/05/2027	USD	350,000	309,465	0.07
Enel Finance International NV, 144A 3.5% 06/04/2028	USD	200,000	171,888	0.04
			1,035,408	0.23
<i>South Korea</i>				
Hyundai Capital America, 144A 3.25% 20/09/2022	USD	514,000	500,286	0.11
Hyundai Capital America, Reg. S 2.55% 03/04/2020	USD	365,000	360,448	0.08
			860,734	0.19
<i>Switzerland</i>				
Roche Holdings, Inc., 144A 2.25% 30/09/2019	USD	200,000	198,707	0.05
Roche Holdings, Inc., 144A 3.35% 30/09/2024	USD	550,000	552,122	0.12
			750,829	0.17
<i>United Kingdom</i>				
HSBC Holdings plc 4.3% 08/03/2026	USD	510,000	503,775	0.11
			503,775	0.11
<i>United States of America</i>				
Amazon.com, Inc. 2.8% 22/08/2024	USD	400,000	389,054	0.09
Apple, Inc. 2.5% 09/02/2022	USD	170,000	167,385	0.04
Apple, Inc. 3.35% 09/02/2027	USD	145,000	142,005	0.03
Apple, Inc. 2.9% 12/09/2027	USD	570,000	537,596	0.12
Bank of America Corp., FRN 3.55% 05/03/2024	USD	400,000	395,367	0.09
Bank of America Corp., FRN 3.419% 20/12/2028	USD	347,000	324,711	0.07
Baxalta, Inc. 4% 23/06/2025	USD	6,000	5,877	
Cleveland Electric Illuminating Co. (The), 144A 3.5% 01/04/2028	USD	60,000	57,305	0.01
Comcast Corp. 3.95% 15/10/2025	USD	205,000	207,701	0.05
Comcast Corp. 4.15% 15/10/2028	USD	415,000	422,159	0.09
CVS Health Corp. 3.125% 09/03/2020	USD	150,000	149,727	0.03

CVS Health Corp. 3.35% 09/03/2021	USD	75,000	74,788	0.02
Duke Energy Carolinas LLC 3.05% 15/03/2023	USD	705,000	699,201	0.16
FNMA MA3495 4% 01/10/2048	USD	1,125,215	1,148,504	0.26
General Mills, Inc. 3.2% 16/04/2021	USD	80,000	79,622	0.02
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN 2.905% 24/07/2023	USD	900,000	857,865	0.19
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN 3.691% 05/06/2028	USD	600,000	558,527	0.12
JPMorgan Chase & Co., FRN 3.54% 01/05/2028	USD	700,000	668,541	0.15
Kraft Heinz Foods Co. 3% 01/06/2026	USD	200,000	178,797	0.04
McDonald's Corp. 3.35% 01/04/2023	USD	205,000	204,151	0.05
Microsoft Corp. 2.4% 06/02/2022	USD	300,000	296,662	0.07
Microsoft Corp. 2.4% 08/08/2026	USD	656,000	614,519	0.14
US Treasury 2.875% 30/11/2023	USD	1,000,000	1,017,617	0.23
US Treasury Inflation Indexed 0.375% 15/07/2025	USD	1,320,000	1,357,718	0.30
US Treasury Inflation Indexed 0.625% 15/01/2026	USD	880,000	912,560	0.20
Wells Fargo & Co., FRN 3.584% 22/05/2028	USD	550,000	528,904	0.12
			11,996,863	2.69
債券合計			33,215,281	7.44
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			33,215,281	7.44
新規発行証券				
債券				
<i>France</i>				
BNP Paribas SA, 144A 3.375% 09/01/2025	USD	325,000	306,388	0.07
			306,388	0.07
<i>Germany</i>				
Daimler Finance North America LLC, 144A 3% 22/02/2021	USD	875,000	865,693	0.19
Deutsche Telekom International Finance BV, 144A 4.375% 21/06/2028	USD	450,000	444,193	0.10
Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A 3.875% 13/11/2020	USD	340,000	341,745	0.08
Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A 4% 12/11/2021	USD	340,000	340,910	0.08
Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A 4.25% 13/11/2023	USD	1,000,000	992,819	0.22
Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A 4.625% 13/11/2025	USD	290,000	287,226	0.06
			3,272,586	0.73
<i>Japan</i>				
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 144A 3.8% 26/11/2020	USD	300,000	301,887	0.07
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., 144A 4.4% 26/11/2023	USD	645,000	652,724	0.14
			954,611	0.21
<i>United States of America</i>				
Anheuser-Busch Cos. LLC, Reg. S 3.65% 01/02/2026	USD	260,000	245,989	0.06
Bayer US Finance II LLC, 144A 3.875% 15/12/2023	USD	250,000	245,721	0.05
Cigna Corp., 144A 3.4% 17/09/2021	USD	135,000	134,773	0.03
Cigna Corp., 144A 4.125% 15/11/2025	USD	295,000	295,159	0.07
Cigna Corp., 144A 4.375% 15/10/2028	USD	330,000	332,686	0.07
Keurig Dr Pepper, Inc., 144A 4.597% 25/05/2028	USD	450,000	447,714	0.10
Keurig Dr Pepper, Inc., 144A 5.085% 25/05/2048	USD	225,000	215,041	0.05
Pacific Gas & Electric Co., 144A 4.65% 01/08/2028	USD	128,000	113,328	0.03
			2,030,411	0.46
債券合計			6,563,996	1.47
新規発行証券合計			6,563,996	1.47

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

集団投資スキーム- UCITS

Luxembourg

JPMorgan US Dollar Treasury Liquidity Fund - JPM US Dollar Treasury Liquidity Institutional (dist.)	USD	15,040,461	15,040,461	3.37
			15,040,461	3.37
集団投資スキーム合計- UCITS			15,040,461	3.37
公的・私的集団投資スキーム合計			15,040,461	3.37
投資総額			425,984,276	95.45
銀行預金			11,393,711	2.55
その他の純資産 / (負債)			8,901,980	2.00
純資産総額			446,279,967	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 (%)	
United States of America	FNMA, 3.00%, 25/01/2034	USD	1,050,000	1,047,828	7,672	0.24	
United States of America	FNMA, 4.50%, 25/01/2048	USD	2,750,000	2,849,404	40,492	0.64	
United States of America	FNMA, 3.50%, 25/01/2049	USD	5,700,000	5,701,237	75,159	1.28	
United States of America	FNMA, 4.00%, 25/01/2049	USD	4,044,783	4,124,814	75,406	0.92	
TBA	ロングポジションの合計			13,723,283	198,729	3.08	
TBA	総額			13,723,283	198,729	3.08	

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 (%)
12,200,000	EUR	Citigroup	Pay floating EONIA 1 day	03/12/2021	35,757	35,757	0.01
			Receive fixed (0.025)%				
12,700,000	EUR	Citigroup	Pay floating EONIA 1 day Receive fixed (0.039)%	04/12/2021	32,937	32,937	0.01
500,000	USD	Citigroup	Pay fixed 2.521% Receive floating LIBOR 3 month	03/08/2047	32,105	32,105	
金利スワップの未実現利益合計					100,799	100,799	0.02
金利スワップの未実現損益総額					100,799	100,799	0.02

金融先物取引

銘柄	契約口数	通貨	グローバル・エクスポ ージャー (USD)	未実現利益/(損失) (USD)	投資比率 (%)
Euro-Bund, 07/03/2019	20	EUR	3,747,519	25,876	0.01
US 2 Year Note, 29/03/2019	2	USD	424,625	1,904	
US 5 Year Note, 29/03/2019	303	USD	34,750,313	506,653	0.11
US 10 Year Note, 20/03/2019	19	USD	2,318,297	53,642	0.01
US 10 Year Ultra Bond, 20/03/2019	26	USD	3,382,031	62,014	0.02
金融先物取引の未実現利益合計				650,089	0.15
3 Month Eurodollar, 16/09/2019	(56)	USD	(13,627,600)	(42,819)	(0.01)
US Ultra Bond, 20/03/2019	(3)	USD	(481,969)	(25,265)	(0.01)

金融先物取引の未実現損合計	(68,084)	(0.02)
金融先物取引の未実現損益総額	582,005	0.13

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	4,420,559	DKK	33,000,000	07/01/2019	Morgan Stanley	655	
EUR	1,551,000	USD	1,762,439	09/01/2019	Citibank	15,490	
EUR	800,000	USD	912,319	11/01/2019	Bank of America	4,888	
EUR	1,780,000	USD	2,038,075	11/01/2019	Citibank	2,711	
JPY	88,000,000	USD	782,640	11/01/2019	Citibank	20,825	0.01
USD	1,335,604	AUD	1,810,000	11/01/2019	Citibank	60,513	0.01
USD	1,048,298	CAD	1,380,000	11/01/2019	Bank of America	37,233	0.01
EUR	2,130,000	USD	2,439,457	14/01/2019	Citibank	3,275	
EUR	1,750,000	USD	2,000,140	14/01/2019	J.P. Morgan	6,799	
USD	1,821,428	COP	5,794,000,000	14/01/2019	Goldman Sachs	38,342	0.01
JPY	247,000,000	AUD	3,050,390	15/01/2019	Morgan Stanley	106,798	0.03
USD	1,361,965	CLP	933,600,000	15/01/2019	Goldman Sachs	16,415	
EUR	1,774,930	USD	2,020,000	17/01/2019	J.P. Morgan	16,085	
JPY	234,132,417	USD	2,075,000	17/01/2019	J.P. Morgan	63,709	0.02
JPY	325,713,344	EUR	2,540,000	18/01/2019	Goldman Sachs	61,511	0.02
KRW	1,282,900,000	USD	1,144,731	18/01/2019	HSBC	5,576	
USD	5,274,975	AUD	7,325,000	18/01/2019	J.P. Morgan	113,951	0.03
USD	656,925	CNH	4,500,000	18/01/2019	HSBC	1,747	
USD	1,465,855	ZAR	21,100,000	22/01/2019	Citibank	2,761	
GBP	730,000	EUR	810,265	24/01/2019	Bank of America	1,402	
GBP	430,000	USD	545,457	24/01/2019	Bank of America	3,221	
CHF	791,786	USD	800,000	25/01/2019	HSBC	7,269	
EUR	238,220	USD	271,020	25/01/2019	HSBC	2,449	
GBP	4,228,000	USD	5,348,378	25/01/2019	HSBC	46,827	0.01
JPY	141,772,400	EUR	1,100,000	25/01/2019	Goldman Sachs	33,088	0.01
JPY	4,980,000	USD	44,010	25/01/2019	Goldman Sachs	1,509	
JPY	2,137,045,485	USD	18,885,000	25/01/2019	HSBC	648,431	0.15
USD	325,337	AUD	450,000	25/01/2019	HSBC	8,229	
USD	709,728	AUD	990,000	25/01/2019	J.P. Morgan	12,092	
EUR	4,400,000	USD	5,002,768	28/01/2019	HSBC	49,678	0.01
GBP	120,000	USD	152,237	29/01/2019	Citibank	923	
USD	1,716,138	CNY	11,650,000	05/07/2019	Citibank	16,576	
先物為替予約の未実現益						1,410,978	0.32
CHF Hedged Share Class							
CHF	105,129	CAD	142,895	18/01/2019	J.P. Morgan	2,399	
CHF	1,764,920	USD	1,791,106	18/01/2019	J.P. Morgan	7,104	
EUR Hedged Share Class							
EUR	56,256	CAD	85,878	18/01/2019	J.P. Morgan	1,608	
EUR	944,433	USD	1,076,431	18/01/2019	J.P. Morgan	7,059	
JPY Hedged Share Class							
JPY	775,174,277	CAD	9,198,057	18/01/2019	J.P. Morgan	341,158	0.08
JPY	7,077,427,607	EUR	55,048,109	18/01/2019	J.P. Morgan	1,501,286	0.34

JPY	1,391,855,673	GBP	9,794,894	18/01/2019	J.P. Morgan	220,852	0.05
JPY	13,013,706,464	USD	115,346,800	18/01/2019	J.P. Morgan	3,537,755	0.79
USD Hedged Share Class							
EUR	218,972	USD	249,479	18/01/2019	J.P. Morgan	1,734	
GBP	38,709	USD	49,063	18/01/2019	J.P. Morgan	314	
JPY	18,957,315	USD	169,028	18/01/2019	J.P. Morgan	4,153	
USD	2,782,902	CAD	3,726,479	18/01/2019	J.P. Morgan	52,146	0.01
ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現益						5,677,568	1.27
先物為替予約の未実現益合計						7,088,546	1.59
GBP	1,150,000	USD	1,477,244	04/01/2019	Bank of America	(11,383)	
USD	648,808	CNH	4,500,000	04/01/2019	J.P. Morgan	(6,380)	
USD	1,689,873	MYR	7,100,000	04/01/2019	J.P. Morgan	(28,184)	(0.01)
USD	3,310,882	CNH	23,000,000	08/01/2019	HSBC	(37,941)	(0.01)
USD	3,965,199	EUR	3,480,000	08/01/2019	Citibank	(23,639)	(0.01)
USD	1,245,757	THB	41,100,000	08/01/2019	HSBC	(16,501)	(0.01)
GBP	530,000	USD	677,878	09/01/2019	Citibank	(2,143)	
USD	1,636,602	CNH	11,400,000	10/01/2019	Citibank	(23,269)	(0.01)
USD	795,841	CHF	790,000	11/01/2019	Bank of America	(8,513)	
USD	2,945,643	EUR	2,580,000	11/01/2019	HSBC	(12,351)	
USD	2,122,038	INR	151,000,000	11/01/2019	HSBC	(38,857)	(0.01)
USD	10,883,125	JPY	1,230,245,000	11/01/2019	Citibank	(349,354)	(0.08)
USD	1,317,607	PLN	4,960,000	11/01/2019	J.P. Morgan	(7,882)	
COP	5,794,000,000	USD	1,784,081	14/01/2019	Citibank	(995)	
GBP	440,000	USD	563,499	14/01/2019	Bank of America	(2,362)	
USD	741,269	INR	52,000,000	14/01/2019	Citibank	(2,610)	
USD	724,464	MYR	3,030,000	14/01/2019	J.P. Morgan	(8,611)	
CLP	933,600,000	USD	1,400,267	15/01/2019	HSBC	(54,717)	(0.01)
USD	847,158	INR	60,000,000	15/01/2019	HSBC	(11,060)	
NOK	7,685,832	USD	900,000	17/01/2019	Bank of America	(10,504)	
USD	115,208	JPY	13,000,000	17/01/2019	Bank of America	(3,542)	
USD	661,646	THB	21,700,000	17/01/2019	Bank of America	(4,886)	
AUD	5,700,000	USD	4,197,395	18/01/2019	Citibank	(181,307)	(0.04)
GBP	520,000	USD	663,754	18/01/2019	HSBC	(450)	
USD	1,142,285	KRW	1,282,900,000	18/01/2019	Goldman Sachs	(8,022)	
USD	363,282	INR	26,100,000	22/01/2019	Citibank	(9,726)	
EUR	2,416,588	PLN	10,400,000	25/01/2019	HSBC	(5,963)	
NOK	8,555,700	USD	1,000,000	25/01/2019	HSBC	(9,439)	
USD	1,544,566	ILS	5,800,000	25/01/2019	Citibank	(9,458)	
USD	3,158,340	INR	223,800,000	25/01/2019	J.P. Morgan	(38,937)	(0.01)
USD	5,270,246	JPY	596,360,000	25/01/2019	Goldman Sachs	(180,717)	(0.04)
USD	681,653	CNH	4,700,000	29/01/2019	UBS	(2,593)	
先物為替予約の未実現損						(1,112,296)	(0.24)
CHF Hedged Share Class							
CHF	959,841	EUR	854,624	18/01/2019	J.P. Morgan	(2,513)	
CHF	188,764	GBP	152,188	18/01/2019	J.P. Morgan	(1,804)	
CHF	650,316	JPY	74,480,620	18/01/2019	J.P. Morgan	(17,823)	(0.01)
EUR Hedged Share Class							
EUR	101,010	GBP	91,420	18/01/2019	J.P. Morgan	(731)	

EUR	347,993	JPY	44,741,695	18/01/2019	J.P. Morgan	(9,499)	
JPY Hedged Share Class							
CAD	6,644	JPY	562,991	18/01/2019	J.P. Morgan	(274)	
EUR	39,825	JPY	5,140,163	18/01/2019	J.P. Morgan	(1,268)	
GBP	7,052	JPY	1,010,871	18/01/2019	J.P. Morgan	(239)	
USD	83,651	JPY	9,451,537	18/01/2019	J.P. Morgan	(2,692)	
USD Hedged Share Class							
CAD	36,599	USD	27,325	18/01/2019	J.P. Morgan	(506)	
USD	25,408,209	EUR	22,292,498	18/01/2019	J.P. Morgan	(166,632)	(0.04)
USD	4,996,810	GBP	3,968,383	18/01/2019	J.P. Morgan	(65,198)	(0.02)
USD	17,214,682	JPY	1,942,255,274	18/01/2019	J.P. Morgan	(528,469)	(0.12)
ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現損						(797,648)	(0.19)
先物為替予約の未実現損合計						(1,909,944)	(0.43)
先物為替予約の未実現損益総額						5,178,602	1.16

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)

投資明細表

2018年12月31日現在

(USD)

収益	
受取配当金(源泉徴収税額控除後)	
債券および転換社債に係る利息(源泉徴収税額控除後)	9,760,188
銀行預金利息	138,578
スワップ取引	
収益小計	9,898,766
費用	
運用報酬	94,989
管理手数料	371,128
専門家サービス	164,047
年次税	41,518
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	98,198
印刷費用	33,828
その他費用	21,303
当座貸越利息*	
スワップ取引	43,672
費用小計	868,683
費用の払戻し	345,436
投資純利益/(損失)(a)	9,375,519
実現純利益/(損失)	
投資有価証券の売却取引	-4,362,594
スワップ取引	-121,304
金融先物取引	-223,735
為替取引	157,062

当期実現純利益/(損失) (b)	-4,550,571
未実現評価利益/(損失)の増減	
投資有価証券	-8,173,072
スワップ取引	312,570
為替取引	5,875,569
金融先物取引	600,833
当期末実現評価利益/(損失)の増減 (c)	-1,384,100
当期損益 (a+b+c)	3,440,848
配当金の分配	-472,257
当期投資証券の差引増減額	174,761,591
期首純資産総額	268,549,785
期末純資産総額	446,279,967

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

*主に中央銀行が実施するマイナス金利政策によるものです。

日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

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

なお、同ファンド(「日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)」)は、三菱UFJ国際投信株式会社の委嘱に基づき、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に準じて、設定日(2007年9月26日)より各計算期間の財務諸表について、監査を受けております。なお、直近の計算期間は2018年7月24日から2019年1月23日までとなっております。ただし、同マザーファンド(「日本短期債券マザーファンド」)は当該監査の対象ではありません。

「日本短期債券マザーファンド」の組入有価証券の状況

(有価証券明細表)

(2019年1月23日現在)

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額	
						単価 (円)	評価金額(円)
日本	第4回クレディ・アグリ コル・エス・エー円貨社 債(2014)	0.425	2019/11/28	社債券	100,000	100.208	100,208,000
日本	第19回ルノー円貨社債 (2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	99.503	99,503,000
日本	第11回ウエストパック・ バンキング・コーポレー ション円貨社債(2016)	0.3	2021/1/22	社債券	100,000	100.213	100,213,000
日本	第3回ソシエテ・ジェネ ラル非上位円貨社債 (2018)	0.804	2023/10/12	社債券	100,000	98.616	98,616,000

日本	第488回中部電力	1.562	2019/2/25	社債券	100,000	100.127	100,127,000
日本	第521回関西西電力	0.18	2023/9/20	社債券	100,000	99.863	99,863,000
日本	第4回富士フィルムホールディングス（社債間限定同順位特約付）	0.005	2020/3/3	社債券	100,000	99.949	99,949,000
日本	第50回日本電気（社債間限定同順位特約付）	0.29	2022/6/15	社債券	100,000	100.151	100,151,000
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	100.277	100,277,000
日本	第1回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス（社債間限定同順位特約付）	0.12	2020/10/30	社債券	100,000	100.148	100,148,000
日本	第22回あおぞら銀行（社債間限定同順位特約付）	0.1	2021/12/10	社債券	100,000	99.968	99,968,000
日本	第28回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	102.834	102,834,000
日本	第6回りそな銀行（劣後特約付）	2.084	2020/3/4	社債券	100,000	102.197	102,197,000
日本	第23回三井住友銀行（劣後特約付）	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	102.859	102,859,000
日本	第22回東京センチュリーリース（社債間限定同順位特約付）	0.06	2021/4/13	社債券	100,000	99.898	99,898,000
日本	第75回アコム（特定社債間限定同順位特約付）	0.309	2023/2/28	社債券	100,000	99.826	99,826,000
日本	第69回日立キャピタル（社債間限定同順位特約付）	0.08	2020/12/18	社債券	100,000	100.026	100,026,000
日本	第33回三菱UFJリース（社債間限定同順位特約付）	0.297	2020/6/4	社債券	100,000	100.321	100,321,000
合 計					1,800,000		1,806,984,000

2【ファンドの現況】

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

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

キャピタル・グローバル・ボンド・ファンドF（限定為替ヘッジ）

2019年6月28日現在

資産総額	29,300,414,634円
負債総額	126,341,719円
純資産総額（ - ）	29,174,072,915円
発行済口数	27,866,242,661口

1口当たり純資産額(/)	1.0469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)

2019年6月28日現在

資産総額	29,246,744,767円
負債総額	82,356,000円
純資産総額(-)	29,164,388,767円
発行済口数	27,224,950,599口
1口当たり純資産額(/)	1.0712円

(参考) 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

2019年1月23日現在

資産総額	162,220,138円
負債総額	116,509円
純資産総額(-)	162,103,629円
発行済口数	153,924,025口
1口当たり純資産額(/)	1.0531円

3【委託会社等の経理状況】

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

< 訂正前 >

1．財務諸表の作成方法について

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

財務諸表に記載している金額は、千円未満の端数を切捨てて表示しております。

2．監査証明について

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

< 訂正後 >

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自2017年7月1日 至2018年6月30日）の財務諸表については有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間（自2018年7月1日 至2018年12月31日）の中間財務諸表については有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

< 中間財務諸表 >

（3）【株主資本等変動計算書】

（1）中間貸借対照表

当中間会計期間

（2018年12月31日現在）

科目	注記 番号	内訳 (千円)	金額 (千円)
(資産の部)			
・流動資産			

1.現金・預金			2,890,845
2.前払費用			56,359
3.未収入金			673,554
4.未収委託者報酬			1,260,690
5.未収運用受託報酬			682,359
6.立替金			10,118
流動資産計			5,573,927
.固定資産			
1.有形固定資産			86,756
器具備品	*1	86,756	
2.無形固定資産			1,857
ソフトウェア		1,857	
3.投資その他の資産			537,154
(1)投資有価証券		367	
(2)保険積立金		11,637	
(3)長期差入保証金		275,321	
(4)繰延税金資産		249,828	
固定資産計			625,768
資産合計			6,199,696
(負債の部)			
.流動負債			
1.預り金			16,673
2.未払金			1,255,465
(1)未払手数料		753,053	
(2)その他未払金		502,412	
3.未払費用			77,472
4.未払法人税等			95,995
5.未払消費税等			33,531
6.賞与引当金			356,240
7.役員賞与引当金			1,075
流動負債計			1,836,454
.固定負債			
1.退職給付引当金			1,398,065
2.資産除去債務			248,863
固定負債計			1,646,929
負債合計			3,483,383
(純資産の部)			
.株主資本			
1.資本金			450,000
2.資本剰余金			582,736
資本準備金		582,736	
3.利益剰余金			1,683,608
その他利益剰余金		1,683,608	
繰越利益剰余金		1,683,608	
株主資本計			2,716,345
.評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金			32
評価・換算差額等合計			32
純資産合計			2,716,312

負債・純資産合計			6,199,696
----------	--	--	-----------

(2) 中間損益計算書

当中間会計期間

(自 2018年 7月 1日 至 2018年 12月31日)

科 目	注記 番号	内訳 (千円)	金額 (千円)
. 営業収益			
1. 委託者報酬			2,386,183
2. 運用受託報酬			718,602
3. その他営業収益	*2		3,439,212
営業収益計			6,543,997
. 営業費用			
1. 支払手数料	*2		4,070,855
2. 広告宣伝費			48,946
3. 調査費			107,154
4. 営業雑経費			22,983
(1) 通信費		10,124	
(2) 印刷費		6,124	
(3) 協会費		6,734	
営業費用計			4,249,940
. 一般管理費			
1. 給料			1,340,085
(1) 役員報酬		30,621	
(2) 給料・手当		524,370	
(3) 賞与		542,784	
(4) 賞与引当金繰入額		241,233	
(5) 役員賞与引当金繰入額		1,075	
2. 交際費			11,715
3. 寄付金			1,713
4. 旅費交通費			58,827
5. 租税公課			23,460
6. 不動産賃借料			164,160
7. 退職給付費用			137,762
8. 固定資産減価償却費	*1		10,566
9. 器具備品賃借料			1,892
10. 消耗品費			8,488
11. 事務委託費			30,700
12. 採用費			7,744
13. 福利厚生費			110,863
14. 共通発生経費負担額	*3		95,112
15. 諸経費			4,354
一般管理費計			2,007,448
営業利益			286,609
. 営業外収益			
1. 受取利息及び配当金			4,402
2. 雑収入			105
営業外収益計			4,508
. 営業外費用			

1.為替差損			3,372
2.固定資産除却損			45
営業外費用計			3,418
経常利益			287,699
税引前中間純利益			287,699
法人税、住民税及び事業税			74,373
法人税等調整額			35,899
中間純利益			249,225

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自2018年7月1日 至2018年12月31日)

(単位:千円)

	株主資本					株主資本 合計	評価・換算差額等		純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			その他 有価 証券 評価 差額 金	評価・ 換算 差額 等合 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	1,434,383	1,434,383	2,467,120	-	-	2,467,120
当中間期 変動額									
中間純 利益				249,225	249,225	249,225			249,225
株主資本 以外の項 目の当中 間期変動 額(純 額)							32	32	32
当中間期 変動額合 計	-	-	-	249,225	249,225	249,225	32	32	249,192
当中間期 末残高	450,000	582,736	582,736	1,683,608	1,683,608	2,716,345	32	32	2,716,312

[重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は、器具備品2～10年であります。

(2)無形固定資産

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

3．外貨建資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

4．引当金の計上基準

(1)賞与引当金

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

(2)役員賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

5．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

[表示方法の変更]

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更
「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間
(2018年12月31日現在)

- *1. 有形固定資産の減価償却累計額 49,338千円
- *2. 消費税等の取扱い
 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。

(中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自2018年7月1日 至2018年12月31日)	
*1. 減価償却実施額	
有形固定資産	10,034千円
無形固定資産	531千円
*2. 当社はキャピタル・グループの日本拠点として、キャピタル・リサーチ・アンド・マネージメント・カンパニー（以下「CRMC社」という。）との役務提供契約に基づき、当社の最終の親会社であるキャピタル・グループ・カンパニーズ・インクの各グループ会社（以下「各グループ会社」という。）との間で各種投資運用サービスを相互に提供しております。	
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2018年7月1日 至2018年12月31日)				
発行済株式の種類及び総数				
株式の種類	当事業年度期首 (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2018年7月1日 至2018年12月31日)	
--------------------------------------	--

1. 所有権移転外ファイナンス・リース取引

当中間会計期間末現在、該当するリース取引はありません。

2. オペレーティング・リース取引

（借主側）

未経過リース料

1年以内 329,780千円

1年超 1,264,159千円

合計 1,593,939千円

[金融商品関係]

当中間会計期間

（自2018年7月1日 至2018年12月31日）

1. 金融商品の時価等に関する事項

	中間貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
長期差入保証金	275,321	272,690	2,631

時価については、下記の考え方によっております。その結果、2018年12月31日における上記以外のその他金融商品の中間貸借対照表計上額は、時価と同額または近似しているため、上記表における記載を省略しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

(1)現金・預金、未収入金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬

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

(2)投資有価証券

証券投資信託であります。証券投資信託の時価は、当社が算定し、公表している基準価額によっております。

(3)長期差入保証金

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

負債

(1)未払金

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

(注2)金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

[有価証券関係]

当中間会計期間
(2018年12月31日現在)

(その他有価証券)

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
その他有価証券 (証券投資信託)	367	400	32

[デリバティブ取引関係]

当中間会計期間
(自2018年7月1日 至2018年12月31日)

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

[資産除去債務関係]

当中間会計期間
(2018年12月31日現在)

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減

当事業年度期首残高	247,065千円
時の経過による調整額	1,798千円
当中間会計期間末残高	248,863千円

[セグメント情報等]

当中間会計期間
(自2018年7月1日 至2018年12月31日)

（セグメント情報）

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

日本	米国	その他	合計
3,024,850千円	3,439,212千円	79,934千円	6,543,997千円

（注）営業収益は、顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称又は氏名	営業収益
キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー	3,439,212千円

[1株当たり情報]

当中間会計期間

（自2018年7月1日 至2018年12月31日）

1株当たり純資産額 48,161.56円

1株当たり中間純利益金額 4,418.88円

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

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

中間純利益	249,225千円
普通株主に帰属しない金額	- 千円
普通株式に係る中間純利益	249,225千円
期中平均株式数	56,400株

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額：324,279百万円（2018年9月30日現在）

（中略）

(2) 販売会社

名称：みずほ証券株式会社

資本金の額：125,167百万円（2018年9月30日現在）
（中略）

<再信託受託会社の概要>

名称：日本マスタートラスト信託銀行株式会社
資本金の額：10,000百万円（2018年9月30日現在）
（以下略）

<訂正後>

（1）受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社
資本金の額：324,279百万円（2019年3月31日現在）
（中略）

（2）販売会社

名称：みずほ証券株式会社
資本金の額：125,167百万円（2019年3月31日現在）
（中略）

<再信託受託会社の概要>

名称：日本マスタートラスト信託銀行株式会社
資本金の額：10,000百万円（2019年3月31日現在）
（以下略）

独立監査人の中間監査報告書

2019年7月16日

キャピタル・インターナショナル株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 中島紀子 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているキャピタル・グローバル・ボンド・ファンドF（限定為替ヘッジ）の2018年11月21日から2019年5月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、キャピタル・グローバル・ボンド・ファンドF（限定為替ヘッジ）の2019年5月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年11月21日から2019年5月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2019年3月18日

キャピタル・インターナショナル株式会社
取締役 会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 誠 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 水野 龍也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているキャピタル・インターナショナル株式会社の2018年7月1日から2019年6月30日までの第35期事業年度の間会計期間（2018年7月1日から2018年12月31日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、キャピタル・インターナショナル株式会社の2018年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2018年7月1日から2018年12月31日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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