

【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・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買 い）
【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>

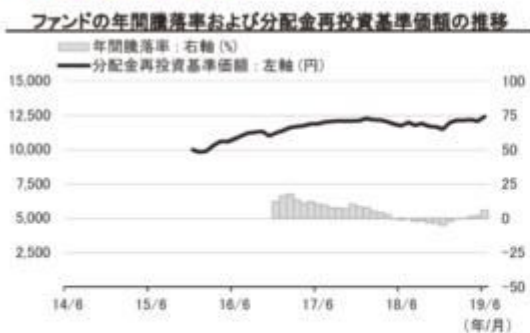
（前略）

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。

<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)

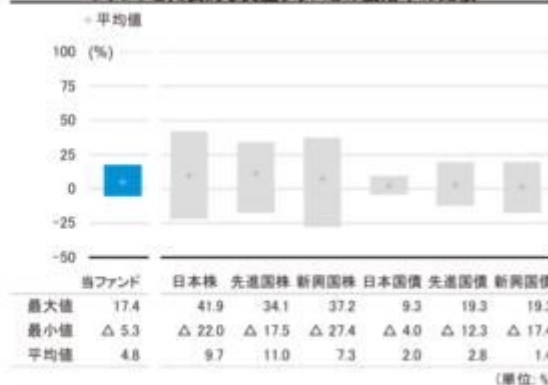
日本国債・・・NOMURA-BPI国債

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



(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。

「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0.7344%(税抜0.68%)**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0.7344%(税抜0.68%)
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0.7414%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0.7344%¹（税抜0.68%）**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0.7344%¹（税抜0.68%）

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0.7414%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0.748%**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0.755%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・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）

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	7,039,130,617	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,425,111	0.03
合計（純資産総額）		7,036,705,506	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・ハイインカム債券マザーファンド（米ドル売り円買い）

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	4,100,085	0.05
投資証券	ルクセンブルク	7,035,290,591	99.94
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）		7,039,390,676	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・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（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	28,909,351,072	32.47
	ロシア	4,168,822,061	4.68
	メキシコ	3,319,515,398	3.73
	カナダ	3,108,744,952	3.49
	インドネシア	2,409,309,195	2.71
	ブラジル	2,326,851,236	2.61
	トルコ	2,118,827,701	2.38
	南アフリカ	2,050,714,058	2.30
	アルゼンチン	1,886,958,431	2.12
	ドミニカ共和国	1,878,896,598	2.11
	タイ	1,856,283,401	2.09
	ナイジェリア	1,632,695,511	1.83
	エジプト	1,632,636,351	1.83
	インド	1,444,841,003	1.62
	パラグアイ	1,241,229,199	1.39
	ペルー	1,208,745,240	1.36

債券	ホンジュラス	1,194,193,675	1.34
	オランダ	1,169,023,667	1.31
	ルクセンブルク	1,095,396,432	1.23
	スリランカ	1,092,338,554	1.23
	ギリシャ	1,018,887,914	1.14
	パナマ	898,243,499	1.01
	ルーマニア	861,161,443	0.97
	ポーランド	800,064,869	0.90
	ウクライナ	778,943,228	0.88
	パキスタン	775,292,934	0.87
	カタール	699,234,392	0.79
	コロンビア	648,921,300	0.73
	ケニア	628,260,674	0.71
	モロッコ	624,028,489	0.70
	コートジボワール	601,443,767	0.68
	英国	505,515,000	0.57
	セネガル	500,246,639	0.56
	サウジアラビア	496,271,710	0.56
	チュニジア	441,953,425	0.50
	イラク	425,882,804	0.48
	チリ	394,380,330	0.44
	ウルグアイ	372,323,686	0.42
	ベネズエラ	354,932,525	0.40
	アラブ首長国連邦	306,664,745	0.34
	中国	303,937,299	0.34
	コスタリカ	302,058,659	0.34
	カザフスタン	250,081,130	0.28
	イタリア	206,697,712	0.23
	ベニン	202,337,389	0.23
	グアテマラ	193,995,000	0.22
ヨルダン	170,824,982	0.19	
ガボン	170,130,543	0.19	
バーレーン	123,258,952	0.14	
オーストラリア	119,114,951	0.13	
スイス	102,607,862	0.12	
ガーナ	14,340,530	0.02	
株式	米国	104,587,964	0.12
銀行預金、その他資産（負債控除後）		8,879,712,008	9.97
純資産総額		89,021,712,089	100.00

（注）投資比率は、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）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・ハイインカム債券ファンドF(米ドル売り円買い)

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・ハイ インカム債券マザーファンド(米ド ル売り円買い)	5,404,322,931	1.2207	6,597,544,051	1.3025	7,039,130,617	100.03

(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	100.03
合計	100.03

(参考)キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(米ドル売り円買い)

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・ハイ・インカム・オポチュニ ティーズ(LUX)(クラスCh- JPY)	1,140,426,421	5,784.55	6,596,860,314	6,169	7,035,290,591	99.94
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)	3,887,074	1.0548	4,100,085	1.0548	4,100,085	0.05

(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	0.05
投資証券	99.94
合計	100.00

（参考）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）

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	BRAZIL NTN F BRL	10.0 2025/1/1	ブラジル 債券 国債証券	53,172,000	112.4662 ブラジル・レア ル	1,681,670,870	1.89
2	THAILAND GVT THB BOND	2.125 2026/12/17	タイ 債券 国債証券	427,450,000	100.8207 タイ・パーツ	1,509,473,346	1.70
3	RUSSIA GOVT OFZ RUB	8.5 2031/9/17	ロシア 債券 国債証券	661,340,000	109.071 ロシア・ルー ブル	1,232,327,131	1.38
4	GOGO INTL 144A LIFE 1ST LIEN	9.875 2024/5/1	米国 債券 社債券	10,225,000	102.875 米ドル	1,133,681,857	1.27
5	RUSSIA GOVT OFZ RUB	7.0 2023/1/25	ロシア 債券 国債証券	634,825,000	99.425 ロシア・ルー ブル	1,078,304,817	1.21
6	VALEANT 144A LIFE SR UNSEC	6.125 2025/4/15	カナダ 債券 社債券	9,125,000	102.25 米ドル	1,005,574,430	1.13
7	SOUTH AFRICA GVT ZAR R2048	8.75 2048/2/28	南アフリカ 債券 国債証券	141,650,000	89.3576 南アフリカ・ラ ンド	962,117,432	1.08
8	SOUTH AFRICA GVT ZAR R214	6.5 2041/2/28	南アフリカ 債券 国債証券	172,510,000	70.62 南アフリカ・ラ ンド	926,023,643	1.04
9	FRONTIER COMMUNICATIONS SR UNSEC	11.0 2025/9/15	米国 債券 社債券	12,845,000	62.50 米ドル	865,231,172	0.97
10	MALLINCKRODT 144A LIFE SR UNSEC	4.875 2020/4/15	米国 債券 社債券	7,235,000	96.875 米ドル	755,384,871	0.85
11	CONSOL ENERGY INC SR UNSEC	5.875 2022/4/15	米国 債券 社債券	7,036,000	97.25 米ドル	737,451,515	0.83
12	HONDURAS REP OF REG S	8.75 2020/12/16	ホンジュラ ス 債券 国債証券	6,308,000	107.251 米ドル	729,140,239	0.82

13	BONOS MEXICAN MXN	8.5 2029/5/31	メキシコ 債券 国債証券	118,000,000	105.814 メキシコ・ペソ	701,397,785	0.79
14	STATE OF QATAR 144A LIFE	4.5 2028/4/23	カタール 債券 国債証券	5,800,000	111.8605 米ドル	699,234,392	0.79
15	FIRST QUANTUM MINERALS 144A LIFE	7.5 2025/4/1	カナダ 債券 社債券	6,775,000	95.375 米ドル	696,405,002	0.78
16	NAVIENT CORP SR UNSEC	5.5 2023/1/25	米国 債券 社債券	6,170,000	103.25 米ドル	686,583,332	0.77
17	TRILOGY INTL PARTNERS 144A LIFE SEC	8.875 2022/5/1	米国 債券 社債券	6,550,000	97.25 米ドル	686,513,278	0.77
18	PETSMART 144A LIFE SR UNSEC	8.875 2025/6/1	米国 債券 社債券	6,680,000	95.25 米ドル	685,739,993	0.77
19	TURKEY REP OF	4.25 2026/4/14	トルコ 債券 国債証券	7,250,000	87.5145 米ドル	683,810,955	0.77
20	PETSMART 144A LIFE SR SEC 1ST LIEN	5.875 2025/6/1	米国 債券 社債券	6,540,000	95.9167 米ドル	676,067,421	0.76
21	STAPLES 144A LIFE SEC	7.5 2026/4/15	米国 債券 社債券	6,175,000	99.375 米ドル	661,351,184	0.74
22	TURKEY GOVT BOND TRY	10.7 2021/2/17	トルコ 債券 国債証券	39,300,000	89.30 トルコ・リラ	654,726,129	0.74
23	INTELSAT JACKSON 144A LIFE SR UNSEC	8.5 2024/10/15	ルクセンブルク 債券 社債券	6,050,000	99.50 米ドル	648,778,556	0.73
24	PERU GOVT PEN REG S GDN	5.4 2034/8/12	ペルー 債券 国債証券	18,600,000	102.2105 ペルー・ソル	622,679,536	0.70
25	HERTZ 144A LIFE SR SEC 2ND LIEN	7.625 2022/6/1	米国 債券 社債券	5,490,000	104.125 米ドル	616,091,746	0.69
26	PAKISTAN REP REG S	8.25 2024/4/15	パキスタン 債券 国債証券	5,060,000	109.375 米ドル	596,467,266	0.67
27	PERU PEN 144A LIFE/REG S	6.15 2032/8/12	ペルー 債券 国債証券	16,200,000	110.4524 ペルー・ソル	586,065,704	0.66
28	CENTURYLINK SR UNSEC SER W	6.75 2023/12/1	米国 債券 社債券	4,975,000	108.255 米ドル	580,442,336	0.65
29	TEVA PHARMACEUTICAL SR UNSEC	6.0 2024/4/15	オランダ 債券 社債券	5,748,000	93.575 米ドル	579,688,423	0.65

30	INDONESIA GOVT BOND IDR FR59	7.0 2027/5/15	インドネシ ア 債券 国債証券	77,266,000,000	97.95 インドネシア・ ルピー	576,848,151	0.65
----	---------------------------------	------------------	--------------------------	----------------	-------------------------	-------------	------

(注) 投資比率は、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)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	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UF J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・ハイインカム債券ファンドF(米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

(参考) キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(米ドル売り円買い)

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・ハイインカム債券ファンドF(米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

(参考) キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(米ドル売り円買い)

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・ハイインカム債券ファンドF(米ドル売り円買い)

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)	493,430,947	493,430,947	1.0963	1.0963
第2期 (2017年11月20日)	3,602,889,543	3,602,889,543	1.2025	1.2025

第3期	(2018年11月20日)	7,322,397,765	7,322,397,765	1.1679	1.1679
	2018年 6月末日	6,949,790,506		1.1740	
	7月末日	7,394,704,893		1.1987	
	8月末日	7,337,925,024		1.1787	
	9月末日	7,047,931,372		1.1903	
	10月末日	7,008,033,841		1.1697	
	11月末日	7,108,639,664		1.1666	
	12月末日	7,022,785,730		1.1490	
	2019年 1月末日	7,236,321,078		1.1975	
	2月末日	7,301,546,834		1.2144	
	3月末日	7,376,622,856		1.2128	
	4月末日	7,344,683,409		1.2175	
	5月末日	7,313,970,314		1.2084	
	6月末日	7,036,705,506		1.2416	

(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・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）

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・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）

期	計算期間	収益率（%）
第1期	2015年12月30日～2016年11月21日	9.6
第2期	2016年11月22日～2017年11月20日	9.7
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	3.6

(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・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）

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。

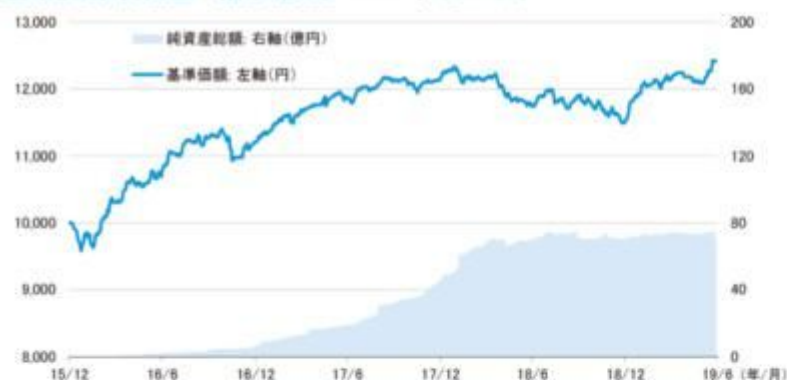
期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	2015年12月30日～2016年11月21日	459,468,457	9,366,806	450,101,651
第2期	2016年11月22日～2017年11月20日	2,620,306,307	74,138,167	2,996,269,791
第3期	2017年11月21日～2018年11月20日	4,448,835,627	1,175,463,418	6,269,642,000
第4中間計算期間末	2018年11月21日～2019年5月20日	432,405,626	663,939,809	6,038,107,817

(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

基準価額・純資産の推移（設定～2019年6月28日）



2019年6月28日現在

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・ハイインカム債券マザーファンド(米ドル売り円買い)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・ハイ・インカム・オポチュニティーズ(LUX)(クラスO)-JPY)	99.94
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.05

<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)の主要な資産の状況等>

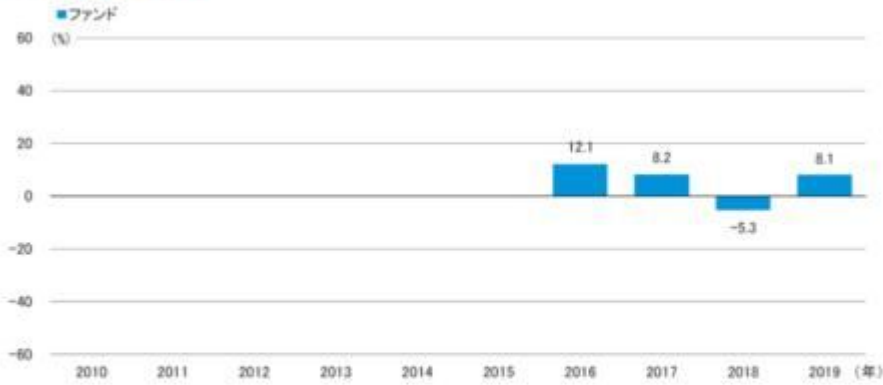
(2019年6月28日現在)

上位10銘柄				
順位	銘柄名	国名/地域名	証券種別	投資比率(%)
1	BRAZL NTNFBRL 10.0% 01-01-25	ブラジル	国債証券	1.89
2	THAILAND GVT THB BOND 2.125% 12-17-26	タイ	国債証券	1.70
3	RUSSIA GOVT OFZ RUB 8.5% 09-17-31	ロシア	国債証券	1.38
4	GOGO INTL 144A LIFE 1ST LIEN 9.875% 05-01-24	米国	社債券	1.27
5	RUSSIA GOVT OFZ RUB 7.0% 01-25-23	ロシア	国債証券	1.21
6	VALEANT 144A LIFE SR UNSEC 6.125% 04-15-25	カナダ	社債券	1.13
7	SOUTH AFRICA GVT ZAR R2048 8.75% 02-28-48	南アフリカ	国債証券	1.08
8	SOUTH AFRICA GVT ZAR R214 6.5% 02-28-41	南アフリカ	国債証券	1.04
9	FRONTIER COMMUNICATIONS SR UNSEC 11.0% 09-15-25	米国	社債券	0.97
10	MALLINCKRODT 144A LIFE SR UNSEC 4.875% 04-15-20	米国	社債券	0.85

証券種別構成比率	
証券種別	投資比率(%)
国債証券	45.63
社債券	44.28
その他証券	0.12
現金・その他	9.97

国別構成比率	
国名	投資比率(%)
米国	32.59
ロシア	4.68
メキシコ	3.73
カナダ	3.49
インドネシア	2.71
その他国	42.82
現金・その他	9.97

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・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）】

(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	306,809,655	33,433,464
親投資信託受益証券	7,312,152,941	7,304,444,408
流動資産合計	7,618,962,596	7,337,877,872
資産合計	7,618,962,596	7,337,877,872
負債の部		
流動負債		
未払金	266,500,000	-
未払解約金	2,776,554	2,510,843
未払受託者報酬	776,996	776,772
未払委託者報酬	25,640,803	25,633,275
未払利息	840	96
その他未払費用	869,638	903,371
流動負債合計	296,564,831	29,824,357
負債合計	296,564,831	29,824,357
純資産の部		
元本等		
元本	6,269,642,000	6,038,107,817
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,052,755,765	1,269,945,698
元本等合計	7,322,397,765	7,308,053,515
純資産合計	7,322,397,765	7,308,053,515
負債純資産合計	7,618,962,596	7,337,877,872

(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	123,720,880	284,423,467
営業収益合計	123,720,880	284,423,467
営業費用		
支払利息	49,378	10,378
受託者報酬	611,465	776,772
委託者報酬	20,178,342	25,633,275
その他費用	965,012	903,371
営業費用合計	21,804,197	27,323,796
営業利益又は営業損失()	145,525,077	257,099,671
経常利益又は経常損失()	145,525,077	257,099,671
中間純利益又は中間純損失()	145,525,077	257,099,671
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()	3,117,116	12,816,996
期首剰余金又は期首欠損金()	606,619,752	1,052,755,765
剰余金増加額又は欠損金減少額	680,284,043	84,631,288
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	680,284,043	84,631,288
剰余金減少額又は欠損金増加額	102,366,825	111,724,030
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	102,366,825	111,724,030
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,042,129,009	1,269,945,698

(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 6,269,642,000口	1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数 6,038,107,817口
2. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1679円 (1万口当たり純資産額) (11,679円)	2. 当該中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2103円 (1万口当たり純資産額) (12,103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	2,996,269,791円	6,269,642,000円
期中追加設定元本額	4,448,835,627円	432,405,626円
期中一部解約元本額	1,175,463,418円	663,939,809円

（参考）

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（米ドル売り円買い）

当ファンドは、「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（米ドル売り円買い）」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	4,096,198
投資証券	7,300,166,454
流動資産合計	7,304,262,652
資産合計	7,304,262,652
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	5,757,878,298
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,546,384,354
元本等合計	7,304,262,652
純資産合計	7,304,262,652
負債純資産合計	7,304,262,652

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2019年5月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数		5,757,878,298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	1.2686円
	(1万口当たり純資産額)	(12,686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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1)投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	2019年5月20日現在
同計算期間の期首元本額	5,996,517,092円
同計算期間の追加設定元本額	217,433,244円
同計算期間の一部解約元本額	456,072,038円
計算日の元本額	5,757,878,298円
元本額の内訳	
キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドF(米ドル売り円買い)	5,757,878,298円

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・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(米ドル売り円買い)」は、円建ての「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)(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・ハイ・インカム・オポチュニティーズ(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 (EUR)	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>Argentina</i>				
Argentina Government Bond 6.875% 22/04/2021	USD	5,145,000	4,667,853	0.74
Argentina Government Bond, FRN 59.564% 21/06/2020	ARS	942,600	27,003	
Argentina Government Bond, FRN 24.94% 03/04/2022	ARS	11,000,000	279,632	0.04
Argentina Government Bond, FRN 0% 15/12/2035	USD	17,350,000	739,110	0.12
Argentina Treasury Bill 0% 30/04/2019	ARS	55,195,010	1,663,471	0.26
Argentina Treasury Bill 0% 31/05/2019	ARS	36,538,200	1,075,826	0.17
Argentina Treasury Bill 0% 31/10/2019	ARS	41,282,400	1,247,461	0.20
Argentina Treasury Bill 0% 30/04/2020	ARS	5,160,500	150,727	0.02
Autonomous City of Buenos Aires Argentina, FRN 29% 22/02/2028	ARS	87,068,000	1,988,639	0.31
Autonomous City of Buenos Aires Argentina, Reg. S 8.95% 19/02/2021	USD	1,435,000	1,433,134	0.23
YPF SA, Reg. S, FRN 8.5% 28/07/2025	USD	3,042,000	2,741,602	0.43
			16,014,458	2.52
<i>Armenia</i>				
Armenia Government Bond, Reg. S 7.15% 26/03/2025	USD	930,000	979,288	0.15
			979,288	0.15
<i>Bahrain</i>				

Bahrain Government Bond, Reg. S 6.75% 20/09/2029	USD	2,520,000	2,475,746	0.39
			2,475,746	0.39
<i>Belarus</i>				
Belarus Government Bond, Reg. S 6.875% 28/02/2023	USD	1,170,000	1,196,938	0.19
			1,196,938	0.19
<i>Brazil</i>				
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2025	BRL	43,500,000	11,730,505	1.85
Brazil Notas do Tesouro Nacional 6% 15/05/2055	BRL	345,500	3,307,559	0.52
Cemig Geracao e Transmissao SA, 144A 9.25% 05/12/2024	USD	200,000	213,600	0.03
Cemig Geracao e Transmissao SA, Reg. S 9.25% 05/12/2024	USD	1,095,000	1,169,460	0.18
Petrobras Global Finance BV 8.375% 23/05/2021	USD	1,311,000	1,428,007	0.22
Petrobras Global Finance BV 6.125% 17/01/2022	USD	401,000	412,529	0.07
Petrobras Global Finance BV 5.875% 07/03/2022	EUR	300,000	379,091	0.06
Petrobras Global Finance BV 4.375% 20/05/2023	USD	1,780,000	1,701,449	0.27
Petrobras Global Finance BV 6.85% 05/06/2115	USD	894,000	802,141	0.13
			21,144,341	3.33
<i>Canada</i>				
Teekay Corp. 8.5% 15/01/2020	USD	5,710,000	5,474,463	0.86
			5,474,463	0.86
<i>Chile</i>				
Enel Chile SA 4.875% 12/06/2028	USD	1,075,000	1,075,000	0.17
			1,075,000	0.17
<i>China</i>				
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd., 144A 3.5% 04/05/2027	USD	2,725,000	2,629,235	0.41
			2,629,235	0.41
<i>Colombia</i>				
Colombian TES 6.25% 26/11/2025	COP	9,400,000,000	2,873,890	0.45
Colombian TES 7.75% 18/09/2030	COP	5,340,000,000	1,753,232	0.28
Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter, Reg. S 7.875% 12/08/2024	COP	2,008,000,000	629,266	0.10
			5,256,388	0.83
<i>Costa Rica</i>				
Costa Rica Government Bond, Reg. S 7% 04/04/2044	USD	1,235,000	1,054,381	0.17
Costa Rica Government Bond, Reg. S 4.25% 26/01/2023	USD	1,600,000	1,414,000	0.22
			2,468,381	0.39
<i>Dominican Republic</i>				
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 8.9% 15/02/2023	DOP	64,000,000	1,232,621	0.19
Dominican Republic Government Bond, 144A 5.5% 27/01/2025	USD	420,000	417,375	0.07
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 5.5% 27/01/2025	USD	3,317,000	3,296,269	0.52
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.875% 29/01/2026	USD	2,480,000	2,607,100	0.41
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 8.625% 20/04/2027	USD	2,375,000	2,725,312	0.43
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 7.45% 30/04/2044	USD	850,000	886,125	0.14
			11,164,802	1.76
<i>Egypt</i>				
Egypt Government Bond, 144A 5.625% 16/04/2030	EUR	1,350,000	1,342,966	0.21
Egypt Government Bond 17.2% 09/08/2023	EGP	11,650,000	631,209	0.10
Egypt Government Bond, Reg. S 5.577% 21/02/2023	USD	2,100,000	1,995,727	0.31

Egypt Government Bond, Reg. S 7.5% 31/01/2027	USD	1,100,000	1,052,459	0.17
Egypt Government Bond, Reg. S 8.5% 31/01/2047	USD	1,200,000	1,087,249	0.17
			6,109,610	0.96
<i>Ghana</i>				
Ghana Government Bond 24% 09/09/2019	GHS	6,535,000	1,385,556	0.22
Ghana Government Bond 19% 02/11/2026	GHS	5,900,000	1,093,498	0.17
			2,479,054	0.39
<i>Guatemala</i>				
Guatemala Government Bond, Reg. S 4.375% 05/06/2027	USD	1,800,000	1,665,000	0.26
			1,665,000	0.26
<i>Honduras</i>				
Honduras Government Bond, Reg. S 8.75% 16/12/2020	USD	6,308,000	6,724,328	1.06
Honduras Government Bond, Reg. S 6.25% 19/01/2027	USD	4,000,000	3,970,400	0.62
			10,694,728	1.68
<i>India</i>				
India Government Bond 8.83% 25/11/2023	INR	252,570,000	3,858,281	0.61
India Government Bond 8.6% 02/06/2028	INR	228,290,000	3,537,244	0.56
National Highways Authority of India 7.17% 23/12/2021	INR	100,000,000	1,398,376	0.22
National Highways Authority of India 7.27% 06/06/2022	INR	20,000,000	281,058	0.04
			9,074,959	1.43
<i>Indonesia</i>				
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, Reg. S 6.53% 15/11/2028	USD	315,000	331,184	0.05
Indonesia Government Bond, Reg. S 4.75% 08/01/2026	USD	2,330,000	2,365,612	0.37
Indonesia Government Bond, Reg. S 3.75% 14/06/2028	EUR	2,375,000	2,958,065	0.47
Indonesia Treasury 6.125% 15/05/2028	IDR	22,391,000,000	1,374,135	0.22
Indonesia Treasury 6.625% 15/05/2033	IDR	76,272,000,000	4,633,073	0.73
Indonesia Treasury 8.375% 15/09/2026	IDR	17,119,000,000	1,216,352	0.19
Indonesia Treasury 7% 15/05/2027	IDR	37,266,000,000	2,425,659	0.38
Indonesia Treasury 8.375% 15/03/2034	IDR	33,287,000,000	2,342,544	0.37
			17,646,624	2.78
<i>Iraq</i>				
Iraq Government Bond, Reg. S 6.752% 09/03/2023	USD	615,000	587,262	0.09
Iraq Government Bond, Reg. S 5.8% 15/01/2028	USD	3,380,000	3,039,972	0.48
			3,627,234	0.57
<i>Italy</i>				
Wind Tre SpA, 144A 5% 20/01/2026	USD	1,975,000	1,636,801	0.26
			1,636,801	0.26
<i>Ivory Coast</i>				
Ivory Coast Government Bond, Reg. S 5.25% 22/03/2030	EUR	2,500,000	2,533,118	0.40
Ivory Coast Government Bond, STEP, Reg. S 5.75% 31/12/2032	USD	3,644,500	3,226,549	0.51
			5,759,667	0.91
<i>Jordan</i>				
Jordan Government Bond, Reg. S 6.125% 29/01/2026	USD	1,130,000	1,084,457	0.17
Jordan Government Bond, Reg. S 5.75% 31/01/2027	USD	405,000	372,938	0.06
			1,457,395	0.23
<i>Kazakhstan</i>				

Kazakhstan Government Bond, Reg. S 1.55% 09/11/2023	EUR	375,000	432,658	0.07
Kazakhstan Government Bond, Reg. S 2.375% 09/11/2028	EUR	990,000	1,125,892	0.18
Kazakhstan Government Bond, Reg. S 6.5% 21/07/2045	USD	1,055,000	1,267,511	0.20
KazMunayGas National Co. JSC, Reg. S 4.75% 19/04/2027	USD	800,000	780,697	0.12
			3,606,758	0.57
<i>Kenya</i>				
Kenya Government Bond 12.5% 10/01/2033	KES	37,200,000	384,682	0.06
Kenya Government Bond, Reg. S 8.25% 28/02/2048	USD	800,000	684,013	0.11
Kenya Government Bond, Reg. S 5.875% 24/06/2019	USD	3,100,000	3,110,729	0.49
Kenya Government Bond, Reg. S 6.875% 24/06/2024	USD	1,790,000	1,687,030	0.26
			5,866,454	0.92
<i>Mexico</i>				
America Movil SAB de CV 6.45% 05/12/2022	MXN	11,000,000	496,775	0.08
Banco Nacional de Comercio Exterior SNC, Reg. S, FRN 3.8% 11/08/2026	USD	2,500,000	2,393,750	0.38
BBVA Bancomer SA, 144A 6.5% 10/03/2021	USD	2,100,000	2,184,021	0.34
Comision Federal de Electricidad 7.35% 25/11/2025	MXN	35,460,000	1,569,845	0.25
Grupo Televisa SAB 7.25% 14/05/2043	MXN	9,290,000	312,501	0.05
Mexican Bonos 8% 07/12/2023	MXN	97,700,000	4,855,979	0.76
Mexican Bonos 8.5% 31/05/2029	MXN	162,000,000	8,112,633	1.28
Mexican Bonos 7.75% 13/11/2042	MXN	63,200,000	2,842,878	0.45
Mexico Government Bond 3.6% 30/01/2025	USD	1,000,000	956,000	0.15
Mexico Government Bond 4.15% 28/03/2027	USD	960,000	929,674	0.15
Mexico Government Bond 4.35% 15/01/2047	USD	2,560,000	2,203,520	0.35
Mexico Government Bond 5.75% 12/10/2110	USD	3,200,000	3,020,000	0.47
Petroleos Mexicanos 7.47% 12/11/2026	MXN	46,000,000	1,726,895	0.27
Petroleos Mexicanos, Reg. S 7.19% 12/09/2024	MXN	21,600,000	860,076	0.13
			32,464,547	5.11
<i>Morocco</i>				
Morocco Government Bond, Reg. S 4.25% 11/12/2022	USD	2,675,000	2,688,215	0.42
Morocco Government Bond, Reg. S 5.5% 11/12/2042	USD	2,625,000	2,693,263	0.43
			5,381,478	0.85
<i>Netherlands</i>				
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026	USD	870,000	665,426	0.10
			665,426	0.10
<i>Nigeria</i>				
Nigeria Government Bond, Reg. S 6.75% 28/01/2021	USD	3,285,000	3,331,568	0.52
Nigeria Government Bond, Reg. S 6.5% 28/11/2027	USD	1,000,000	887,220	0.14
			4,218,788	0.66
<i>Pakistan</i>				
Pakistan Government Bond, Reg. S 7.25% 15/04/2019	USD	3,175,000	3,175,000	0.50
Pakistan Government Bond, Reg. S 8.25% 15/04/2024	USD	2,930,000	2,962,992	0.47
Pakistan Government Bond, Reg. S 6.875% 05/12/2027	USD	800,000	728,472	0.11
			6,866,464	1.08
<i>Panama</i>				
ENA Norte Trust, Reg. S 4.95% 25/04/2028	USD	1,418,039	1,426,193	0.22

Panama Government Bond 4.5% 16/04/2050	USD	3,670,000	3,523,200	0.56
			4,949,393	0.78
<i>Paraguay</i>				
Paraguay Government Bond, Reg. S 4.625% 25/01/2023	USD	4,700,000	4,727,612	0.74
Paraguay Government Bond, Reg. S 5.6% 13/03/2048	USD	2,190,000	2,162,625	0.34
Paraguay Government Bond, Reg. S 5% 15/04/2026	USD	3,750,000	3,801,563	0.60
			10,691,800	1.68
<i>Peru</i>				
Peru Government Bond, Reg. S, 144A 6.15% 12/08/2032	PEN	16,200,000	4,901,437	0.77
			4,901,437	0.77
<i>Poland</i>				
Poland Government Bond 1.5% 25/04/2020	PLN	20,692,000	5,554,160	0.87
Poland Government Bond 5.75% 23/09/2022	PLN	11,225,000	3,410,737	0.54
			8,964,897	1.41
<i>Qatar</i>				
Qatar Government Bond, 144A 4.5% 23/04/2028	USD	2,200,000	2,301,649	0.36
			2,301,649	0.36
<i>Romania</i>				
Romania Government Bond, 144A 5.125% 15/06/2048	USD	2,100,000	2,029,146	0.32
			2,029,146	0.32
<i>Russian Federation</i>				
Russian Federal Bond - OFZ 7.5% 18/08/2021	RUB	207,000,000	2,942,267	0.46
Russian Federal Bond - OFZ 7% 25/01/2023	RUB	451,325,000	6,219,184	0.98
Russian Federal Bond - OFZ 8.5% 17/09/2031	RUB	82,300,000	1,177,938	0.19
Russian Foreign Bond - Eurobond, 144A 4.375% 21/03/2029	USD	4,200,000	3,986,922	0.63
Vnesheconombank, Reg. S 6.902% 09/07/2020	USD	3,305,000	3,384,363	0.53
			17,710,674	2.79
<i>Saudi Arabia</i>				
Saudi Government Bond, Reg. S 2.375% 26/10/2021	USD	350,000	337,631	0.05
Saudi Government Bond, Reg. S 3.25% 26/10/2026	USD	1,410,000	1,321,602	0.21
			1,659,233	0.26
<i>Senegal</i>				
Senegal Government Bond, Reg. S 8.75% 13/05/2021	USD	1,017,000	1,081,915	0.17
Senegal Government Bond, Reg. S 4.75% 13/03/2028	EUR	2,100,000	2,221,361	0.35
			3,303,276	0.52
<i>South Africa</i>				
Eskom Holdings SOC Ltd., 144A 5.75% 26/01/2021	USD	1,500,000	1,417,821	0.23
South Africa Government Bond 7.75% 28/02/2023	ZAR	40,690,000	2,794,972	0.44
South Africa Government Bond 10.5% 21/12/2026	ZAR	45,600,000	3,450,942	0.54
South Africa Government Bond 6.5% 28/02/2041	ZAR	136,510,000	6,625,045	1.04
South Africa Government Bond 8.75% 28/02/2048	ZAR	7,000,000	433,209	0.07
			14,721,989	2.32
<i>Sri Lanka</i>				
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.25% 27/07/2021	USD	3,075,000	2,970,121	0.47
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 5.75% 18/01/2022	USD	650,000	614,362	0.10
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 5.875% 25/07/2022	USD	650,000	611,111	0.09
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.125% 03/06/2025	USD	2,120,000	1,913,607	0.30
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.85% 03/11/2025	USD	2,090,000	1,959,087	0.31
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.825% 18/07/2026	USD	1,555,000	1,442,500	0.23

			9,510,788	1.50
<i>Supra National</i>				
European Bank for Reconstruction & Development 7.375% 15/04/2019	IDR	16,100,000,000	1,115,450	0.17
			1,115,450	0.17
<i>Thailand</i>				
Bangkok Bank PCL, Reg. S 4.05% 19/03/2024	USD	1,500,000	1,508,640	0.24
Bangkok Bank PCL, Reg. S 4.45% 19/09/2028	USD	1,500,000	1,526,737	0.24
Thailand Government Bond 2.125% 17/12/2026	THB	427,450,000	12,850,203	2.02
			15,885,580	2.50
<i>Tunisia</i>				
Banque Centrale de Tunisie International Bond, Reg. S 6.75% 31/10/2023	EUR	2,050,000	2,254,737	0.35
			2,254,737	0.35
<i>Turkey</i>				
Turkey Government Bond 10.7% 17/02/2021	TRY	14,000,000	2,288,144	0.36
Turkey Government Bond 10.7% 17/08/2022	TRY	13,310,000	2,051,387	0.32
Turkey Government Bond 6.25% 26/09/2022	USD	2,100,000	2,118,812	0.33
Turkey Government Bond 5.75% 11/05/2047	USD	3,800,000	3,104,106	0.49
Turkey Government Bond 9.2% 22/09/2021	TRY	7,300,000	1,133,793	0.18
Turkey Government Bond 11% 02/03/2022	TRY	14,400,000	2,285,498	0.36
Turkey Government Bond 7.1% 08/03/2023	TRY	5,490,000	728,197	0.12
Turkey Government Bond 8.8% 27/09/2023	TRY	8,410,000	1,169,534	0.18
Turkey Government Bond 9% 24/07/2024	TRY	1,600,000	219,752	0.03
Turkey Government Bond 7.375% 05/02/2025	USD	770,000	796,512	0.13
Turkey Government Bond 4.25% 14/04/2026	USD	7,250,000	6,265,697	0.99
			22,161,432	3.49
<i>United Arab Emirates</i>				
DP World Crescent Ltd., Reg. S 4.848% 26/09/2028	USD	2,670,000	2,620,632	0.41
			2,620,632	0.41
<i>United Kingdom</i>				
Inmarsat Finance plc, 144A 4.875% 15/05/2022	USD	2,750,000	2,602,077	0.41
			2,602,077	0.41
<i>United States of America</i>				
AES Corp. 5.5% 15/04/2025	USD	2,077,000	2,071,808	0.33
American Axle & Manufacturing, Inc. 6.5% 01/04/2027	USD	825,000	741,469	0.12
B&G Foods, Inc. 4.625% 01/06/2021	USD	165,000	161,494	0.03
B&G Foods, Inc. 5.25% 01/04/2025	USD	660,000	616,275	0.10
Ball Corp. 4.375% 15/12/2020	USD	475,000	477,969	0.08
Centene Corp. 4.75% 15/05/2022	USD	470,000	465,887	0.07
Centene Corp. 4.75% 15/01/2025	USD	3,350,000	3,207,625	0.50
CenturyLink, Inc. 5.8% 15/03/2022	USD	675,000	653,062	0.10
CenturyLink, Inc. 6.75% 01/12/2023	USD	2,975,000	2,874,594	0.45
CF Industries, Inc. 4.95% 01/06/2043	USD	1,125,000	876,094	0.14
Chemours Co. (The) 6.625% 15/05/2023	USD	2,230,000	2,260,663	0.36
Chesapeake Energy Corp. 5.75% 15/03/2023	USD	690,000	598,575	0.09
Chesapeake Energy Corp. 8% 15/01/2025	USD	3,225,000	2,862,188	0.45
Chesapeake Energy Corp. 8% 15/06/2027	USD	1,370,000	1,157,650	0.18
Chesapeake Energy Corp. 4.875% 15/04/2022	USD	2,110,000	1,851,525	0.29
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. 7.625% 15/03/2020	USD	6,315,000	6,180,806	0.97
Cleveland-Cliffs, Inc. 5.75% 01/03/2025	USD	5,300,000	4,783,250	0.75
CNX Resources Corp. 5.875% 15/04/2022	USD	7,926,000	7,628,775	1.20
DaVita, Inc. 5% 01/05/2025	USD	1,360,000	1,239,300	0.19
DCP Midstream Operating LP 4.95% 01/04/2022	USD	1,265,000	1,255,512	0.20
Diamond Offshore Drilling, Inc. 7.875% 15/08/2025	USD	300,000	250,500	0.04
Diamond Offshore Drilling, Inc. 4.875% 01/11/2043	USD	1,615,000	912,475	0.14
Encompass Health Corp. 5.75% 01/11/2024	USD	1,150,000	1,142,812	0.18
Encompass Health Corp. 5.75% 15/09/2025	USD	1,255,000	1,229,900	0.19
Energy Transfer LP 5.875% 15/01/2024	USD	975,000	997,795	0.16

Enesco plc 7.75% 01/02/2026	USD	1,500,000	1,117,500	0.18
Enesco plc 5.75% 01/10/2044	USD	2,235,000	1,260,272	0.20
Freeport-McMoRan, Inc. 3.55% 01/03/2022	USD	4,260,000	4,041,675	0.64
Genesis Energy LP 6.75% 01/08/2022	USD	2,350,000	2,303,000	0.36
HCA, Inc. 5.875% 01/05/2023	USD	850,000	862,750	0.14
Huntsman International LLC 4.875% 15/11/2020	USD	145,000	146,087	0.02
L Brands, Inc. 5.25% 01/02/2028	USD	660,000	565,125	0.09
Meritage Homes Corp. 5.125% 06/06/2027	USD	675,000	575,437	0.09
MGM Resorts International 7.75% 15/03/2022	USD	1,300,000	1,386,125	0.22
Molina Healthcare, Inc. 5.345% 15/11/2022	USD	4,025,000	3,899,219	0.61
NGL Energy Partners LP 6.125% 01/03/2025	USD	2,675,000	2,313,875	0.36
Noble Holding International Ltd. 7.75% 15/01/2024	USD	1,307,000	994,954	0.16
Noble Holding International Ltd. 8.95% 01/04/2045	USD	1,150,000	879,750	0.14
Owens & Minor, Inc. 3.875% 15/09/2021	USD	2,420,000	1,815,000	0.29
Reynolds Group Issuer, Inc. 5.75% 15/10/2020	USD			
RR Donnelley & Sons Co. 6.5% 15/11/2023	USD	1,150,000	1,141,375	0.18
Sally Holdings LLC 5.5% 01/11/2023	USD	20,000	19,325	
Sally Holdings LLC 5.625% 01/12/2025	USD	1,740,000	1,607,325	0.25
Starwood Property Trust, Inc., REIT 5% 15/12/2021	USD	775,000	763,375	0.12
Targa Resources Partners LP 4.125% 15/11/2019	USD	1,125,000	1,117,969	0.18
Tenet Healthcare Corp. 4.625% 15/07/2024	USD	1,478,000	1,380,083	0.22
Tenet Healthcare Corp. 6% 01/10/2020	USD	3,550,000	3,607,687	0.57
Tenet Healthcare Corp. 4.5% 01/04/2021	USD	3,450,000	3,372,375	0.53
Weatherford International Ltd. 4.5% 15/04/2022	USD	205,000	120,950	0.02
Weatherford International Ltd. 8.25% 15/06/2023	USD	950,000	577,125	0.09
Weatherford International Ltd. 9.875% 15/02/2024	USD	1,975,000	1,224,500	0.19
Weatherford International Ltd. 6.5% 01/08/2036	USD	3,205,000	1,682,625	0.26
Weatherford International Ltd. 6.75% 15/09/2040	USD	2,555,000	1,328,600	0.21
			86,602,086	13.63
<i>Uruguay</i>				
Uruguay Government Bond 4.25% 05/04/2027	UYU	7,930,000	628,673	0.10
Uruguay Government Bond, Reg. S 9.875% 20/06/2022	UYU	45,680,000	1,397,951	0.22
Uruguay Government Bond, Reg. S 8.5% 15/03/2028	UYU	65,174,000	1,708,176	0.27
			3,734,800	0.59
<i>Venezuela</i>				
Venezuela Government Bond, Reg. S 7% 01/12/2018 ²	USD	159,000	34,185	
Venezuela Government Bond, Reg. S 7.75% 13/10/2019 ²	USD	2,851,000	662,002	0.10
Venezuela Government Bond, Reg. S 6% 09/12/2020 ²	USD	2,348,000	542,975	0.09
Venezuela Government Bond, Reg. S 9% 07/05/2023 ²	USD	3,429,000	784,384	0.12
Venezuela Government Bond 9.25% 15/09/2027 ²	USD	422,000	100,225	0.02
Venezuela Government Bond, Reg. S 12.75% 23/08/2022 ²	USD	213,000	51,120	0.01
Venezuela Government Bond, Reg. S 8.25% 13/10/2024 ²	USD	739,000	173,665	0.03
Venezuela Government Bond, Reg. S 7.65% 21/04/2025 ²	USD	315,000	73,237	0.01
Venezuela Government Bond, Reg. S 11.75% 21/10/2026 ²	USD	158,000	39,302	0.01
Venezuela Government Bond, Reg. S 9.25% 07/05/2028 ²	USD	789,000	183,443	0.03
Venezuela Government Bond, Reg. S 11.95% 05/08/2031 ²	USD	264,000	63,030	0.01
Venezuela Government Bond, Reg. S 7% 31/03/2038 ²	USD	263,000	60,490	0.01

			2,768,058	0.44
債券合計			409,589,161	64.46
株式				
<i>Switzerland</i>				
Ceva Logistics AG	CHF	47,802	1,451,714	0.23
			1,451,714	0.23
株式合計			1,451,714	0.23
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			411,040,875	64.69
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>				
Virgin Australia Holdings Ltd., 144A 8.5% 15/11/2019	USD	475,000	480,581	0.08
			480,581	0.08
<i>Brazil</i>				
Brazil Government Bond 10% 01/01/2029	BRL	7,225,000	1,964,676	0.31
Constellation Oil Services Holding SA, 144A 9.632% 09/11/2024	USD	890,689	369,636	0.06
			2,334,312	0.37
<i>Canada</i>				
Bausch Health Cos., Inc., 144A 6.125% 15/04/2025	USD	9,400,000	8,225,000	1.29
First Quantum Minerals Ltd., 144A 7.25% 15/05/2022	USD	1,950,000	1,815,937	0.29
First Quantum Minerals Ltd., 144A 7.5% 01/04/2025	USD	4,750,000	3,936,563	0.62
NOVA Chemicals Corp., 144A 5.25% 01/06/2027	USD	1,950,000	1,733,062	0.27
			15,710,562	2.47
<i>Chile</i>				
Colbun SA, Reg. S 3.95% 11/10/2027	USD	2,950,000	2,726,906	0.43
			2,726,906	0.43
<i>Egypt</i>				
Egypt Treasury Bill 0% 16/04/2019	EGP	56,000,000	2,970,986	0.47
Egypt Treasury Bill 0% 07/05/2019	EGP	53,700,000	2,821,910	0.44
			5,792,896	0.91
<i>Ireland</i>				
Park Aerospace Holdings Ltd., 144A 5.5% 15/02/2024	USD	1,305,000	1,262,588	0.20
			1,262,588	0.20
<i>Kenya</i>				
Kenya Infrastructure Bond 12.5% 18/11/2024	KES	37,150,000	381,827	0.06
			381,827	0.06
<i>Luxembourg</i>				
Intelsat Jackson Holdings SA, 144A 8% 15/02/2024	USD	300,000	309,750	0.05
			309,750	0.05
<i>Malaysia</i>				
Malaysia Government Bond 3.9% 30/11/2026	MYR	17,122,000	4,080,397	0.65
Malaysia Government Bond 4.786% 31/10/2035	MYR	10,025,000	2,423,877	0.38
			6,504,274	1.03
<i>Mexico</i>				
Petroleos Mexicanos 5.5% 21/01/2021	USD	425,000	424,048	0.07
Petroleos Mexicanos 6.375% 04/02/2021	USD	775,000	785,462	0.12
			1,209,510	0.19
<i>Netherlands</i>				

Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 6% 15/04/2024	USD	1,050,000	1,013,932	0.16
Ziggo BV, 144A 5.5% 15/01/2027	USD	3,275,000	2,939,312	0.46
			3,953,244	0.62
<i>Nigeria</i>				
Nigeria Treasury Bill 0% 03/01/2019	NGN	233,790,000	643,164	0.10
Nigeria Treasury Bill 0% 07/02/2019	NGN	378,000,000	1,023,187	0.16
Nigeria Treasury Bill 0% 14/02/2019	NGN	43,000,000	116,089	0.02
Nigeria Treasury Bill 0% 01/08/2019	NGN	479,000,000	1,209,533	0.19
Nigeria Treasury Bill 0% 19/09/2019	NGN	204,500,000	504,261	0.08
Nigeria Treasury Bill 0% 03/10/2019	NGN	860,000,000	2,100,531	0.33
			5,596,765	0.88
<i>Peru</i>				
Peru Government Bond, Reg. S 6.35% 12/08/2028	PEN	3,900,000	1,214,721	0.19
			1,214,721	0.19
<i>Switzerland</i>				
Transocean, Inc., 144A 9% 15/07/2023	USD	720,000	719,100	0.11
			719,100	0.11
<i>United Kingdom</i>				
Inmarsat Finance plc, 144A 6.5% 01/10/2024	USD	1,500,000	1,406,250	0.22
			1,406,250	0.22
<i>United States of America</i>				
ADT Security Corp. (The) 3.5% 15/07/2022	USD	1,600,000	1,486,000	0.23
Allison Transmission, Inc., 144A 5% 01/10/2024	USD	815,000	785,456	0.12
Associated Materials LLC, 144A 9% 01/01/2024	USD	1,925,000	1,867,250	0.29
Avis Budget Car Rental LLC 5.5% 01/04/2023	USD	2,140,000	2,073,125	0.33
Avon International Operations, Inc., 144A 7.875% 15/08/2022	USD	1,160,000	1,148,400	0.18
Blackstone CQP Holdco LP, 144A 6.5% 20/03/2021	USD	1,300,000	1,309,803	0.21
Blackstone CQP Holdco LP, 144A 6% 18/08/2021	USD	1,175,000	1,182,547	0.19
Blackstone CQP Holdco LP, Reg. S 6.5% 20/03/2021	USD	7,575,000	7,632,124	1.20
Calpine Corp., 144A 5.25% 01/06/2026	USD	1,995,000	1,827,919	0.29
CCO Holdings LLC, 144A 5.125% 01/05/2023	USD	1,175,000	1,145,625	0.18
CCO Holdings LLC, 144A 5.75% 15/02/2026	USD	2,905,000	2,854,162	0.45
CCO Holdings LLC, 144A 5% 01/02/2028	USD	850,000	784,125	0.12
Cleveland-Cliffs, Inc., 144A 4.875% 15/01/2024	USD	2,375,000	2,214,687	0.35
Cornerstone Chemical Co., 144A 6.75% 15/08/2024	USD	640,000	564,800	0.09
Covey Park Energy LLC, 144A 7.5% 15/05/2025	USD	750,000	648,750	0.10
CSC Holdings LLC 6.75% 15/11/2021	USD	3,050,000	3,133,875	0.49
CVR Partners LP, 144A 9.25% 15/06/2023	USD	1,025,000	1,069,844	0.17
Endo Dac, 144A 5.87% 01/02/2025	USD	660,000	476,850	0.07
Endo Finance LLC, 144A 5.75% 15/01/2022	USD	2,665,000	2,231,938	0.35
First Data Corp., 144A 5% 15/01/2024	USD	1,775,000	1,715,094	0.27
Frontier Communications Corp. 10.5% 15/09/2022	USD	2,150,000	1,505,000	0.24
Frontier Communications Corp. 11% 15/09/2025	USD	7,405,000	4,646,267	0.73
Gogo Intermediate Holdings LLC, 144A 12.5% 01/07/2022	USD	7,505,000	8,053,465	1.27
Hanesbrands, Inc., 144A 4.875% 15/05/2026	USD	1,055,000	956,094	0.15
Hertz Corp. (The), 144A 7.625% 01/06/2022	USD	3,065,000	2,896,425	0.46
Icahn Enterprises LP 6.25% 01/02/2022	USD	1,725,000	1,707,750	0.27
Infor Software Parent LLC, 144A 7.125% 01/05/2021	USD	2,700,000	2,639,250	0.41
Iron Mountain, Inc., REIT, 144A 4.875% 15/09/2027	USD	695,000	609,863	0.10
Jaguar Holding Co. II, 144A 6.375% 01/08/2023	USD	725,000	694,615	0.11
Jonah Energy LLC, 144A 7.25% 15/10/2025	USD	800,000	520,000	0.08
Joseph T Ryerson & Son, Inc., 144A 11% 15/05/2022	USD	2,637,000	2,663,370	0.42
Kinetic Concepts, Inc., 144A 12.5% 01/11/2021	USD	570,000	612,750	0.10
LSC Communications, Inc., 144A 8.75% 15/10/2023	USD	1,525,000	1,572,656	0.25
Mallinckrodt International Finance SA, 144A 4.875% 15/04/2020	USD	3,705,000	3,593,850	0.57
Molina Healthcare, Inc., 144A 4.875% 15/06/2025	USD	2,198,000	2,013,918	0.32
Navient Corp. 6.5% 15/06/2022	USD	1,195,000	1,114,983	0.18
Navient Corp. 6.125% 25/03/2024	USD	800,000	690,000	0.11

Navient Corp. 5.5% 25/01/2023	USD	5,320,000	4,674,950	0.74
Northwest Hardwoods, Inc., 144A 7.5% 01/08/2021	USD	853,000	614,160	0.10
Novelis Corp., 144A 5.875% 30/09/2026	USD	650,000	576,875	0.09
Omnimax International, Inc., 144A 12% 15/08/2020	USD	1,175,000	1,208,781	0.19
Peabody Energy Corp., 144A 6% 31/03/2022	USD	1,780,000	1,733,275	0.27
PetSmart, Inc., 144A 5.875% 01/06/2025	USD	9,040,000	6,576,600	1.03
PetSmart, Inc., 144A 8.875% 01/06/2025	USD	2,330,000	1,363,050	0.21
Platform Specialty Products Corp., 144A 5.875% 01/12/2025	USD	675,000	634,500	0.10
Rayonier AM Products, Inc., 144A 5.5% 01/06/2024	USD	1,995,000	1,765,575	0.28
Realogy Group LLC, 144A 5.25% 01/12/2021	USD	1,350,000	1,284,188	0.20
Realogy Group LLC, 144A 4.875% 01/06/2023	USD	695,000	608,125	0.10
Realogy Group LLC, 144A 4.5% 15/04/2019	USD	490,000	489,388	0.08
Sable Permian Resources Land LLC, 144A 7.125% 01/11/2020	USD	3,825,000	879,750	0.14
Sable Permian Resources Land LLC, 144A 7.375% 01/11/2021	USD	1,075,000	241,875	0.04
Sable Permian Resources Land LLC, FRN, 144A 9.059% 01/08/2019	USD	950,000	332,500	0.05
Sirius XM Radio, Inc., 144A 3.875% 01/08/2022	USD	1,000,000	962,150	0.15
Staples, Inc., 144A 8.5% 15/09/2025	USD	755,000	684,936	0.11
Sunoco LP 4.875% 15/01/2023	USD	555,000	542,512	0.08
Talen Energy Supply LLC, 144A 9.5% 15/07/2022	USD	1,100,000	1,111,000	0.17
Team Health Holdings, Inc., 144A 6.375% 01/02/2025	USD	1,820,000	1,494,675	0.23
Trilogy International Partners LLC, 144A 8.875% 01/05/2022	USD	3,150,000	3,055,500	0.48
Ultra Resources, Inc., 144A 6.875% 15/04/2022	USD	1,445,000	811,367	0.13
Ultra Resources, Inc., 144A 7.125% 15/04/2025	USD	650,000	334,750	0.05
Unisys Corp., 144A 10.75% 15/04/2022	USD	1,000,000	1,098,750	0.17
UPC Holding BV, 144A 5.5% 15/01/2028	USD	1,025,000	930,187	0.15
Venator Finance Sarl, 144A 5.75% 15/07/2025	USD	1,130,000	909,650	0.14
Veritas US, Inc., 144A 7.5% 01/02/2023	USD	1,150,000	943,000	0.15
Vine Oil & Gas LP, 144A 8.75% 15/04/2023	USD	925,000	735,375	0.12
Warrior Met Coal, Inc., 144A 8% 01/11/2024	USD	775,000	771,125	0.12
Wynn Las Vegas LLC, 144A 4.25% 30/05/2023	USD	1,500,000	1,415,625	0.22
Wynn Las Vegas LLC, 144A 5.5% 01/03/2025	USD	1,175,000	1,098,625	0.17
Wynn Las Vegas LLC, 144A 5.25% 15/05/2027	USD	950,000	837,188	0.13
			113,362,637	17.84
債券合計			162,965,923	25.65
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			162,965,923	25.65
新規発行証券				
債券				
<i>Bermuda</i>				
Teekay Offshore Partners LP, 144A 8.5% 15/07/2023	USD	1,025,000	1,004,500	0.16
			1,004,500	0.16
<i>Canada</i>				
First Quantum Minerals Ltd., 144A 6.875% 01/03/2026	USD	2,125,000	1,713,281	0.27
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 144A 9.25% 01/04/2026	USD	175,000	175,438	0.02
			1,888,719	0.29
<i>Luxembourg</i>				
Consolidated Energy Finance SA, 144A 6.5% 15/05/2026	USD	970,000	933,625	0.15
Intelsat Jackson Holdings SA, 144A 8.5% 15/10/2024	USD	4,125,000	4,021,875	0.63
			4,955,500	0.78
<i>United States of America</i>				
Compass Diversified Holdings, 144A 8% 01/05/2026	USD	1,375,000	1,363,828	0.22

Comstock Escrow Corp., 144A 9.75% 15/08/2026	USD	1,300,000	1,105,000	0.18
Extraction Oil & Gas, Inc., 144A 5.625% 01/02/2026	USD	1,325,000	973,875	0.15
FS Energy & Power Fund, 144A 7.5% 15/08/2023	USD	930,000	885,825	0.14
HUB International Ltd., 144A 7% 01/05/2026	USD	95,000	86,450	0.01
LSB Industries, Inc., 144A 9.625% 01/05/2023	USD	955,000	974,100	0.15
Meredith Corp., 144A 6.875% 01/02/2026	USD	275,000	269,500	0.04
NCI Building Systems, Inc., 144A 8% 15/04/2026	USD	2,365,000	2,172,844	0.34
Tronox, Inc., 144A 6.5% 15/04/2026	USD	900,000	750,375	0.12
Uber Technologies, Inc., 144A 8% 01/11/2026	USD	1,925,000	1,862,437	0.29
Weatherford International LLC, 144A 9.875% 01/03/2025	USD	975,000	597,188	0.10
			11,041,422	1.74
債券合計			18,890,141	2.97
新規発行証券合計			18,890,141	2.97

その他譲渡可能な有価証券と短期金融商品

株式

United States of America

Corporate Risk Holdings Corp. 'A' ¹	USD	1,358	27	
Corporate Risk Holdings I, Inc. ¹	USD	268,508	94,488	0.01
Rotech Healthcare, Inc. ¹	USD	153,793	615,172	0.10
White Star Petroleum LLC ¹	USD	1,617,481	566,118	0.09
			1,275,805	0.20

株式合計 **1,275,805** **0.20**

その他譲渡可能な有価証券と短期金融商品の合計 **1,275,805** **0.20**

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	14,130,553	14,130,553	2.22
			14,130,553	2.22

集団投資スキーム合計- UCITS **14,130,553** **2.22**

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 **14,130,553** **2.22**

投資総額 **608,303,297** **95.73**

銀行預金 **13,823,201** **2.18**

その他の純資産 / (負債) **13,323,351** **2.09**

純資産総額 **635,449,849** **100.00**

1. 証券は取締役会により公正な価値で評価されている。

2. 債務不履行中。

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 (%)
75,000,000	USD	Goldman Sachs	Pay floating LIBOR 3 month Receive fixed 2.769%	20/12/2024	709,676	709,676	0.11
金利スワップの未実現利益合計					709,676	709,676	0.11
40,000,000	USD	Goldman Sachs	Pay fixed 2.888% Receive floating LIBOR 3 month	20/12/2029	(528,508)	(528,508)	(0.08)
金利スワップの未実現損合計					(528,508)	(528,508)	(0.08)
金利スワップの未実現損益総額					181,168	181,168	0.03

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	1,550,000	USD	1,765,528	10/01/2019	Goldman Sachs	11,400	
EUR	1,500,000	USD	1,716,035	18/01/2019	J.P. Morgan	4,825	
MXN	15,073,813	USD	741,076	25/01/2019	Bank of America	23,222	
先物為替予約の未実現損益						39,447	
AUD Hedged Share Class							
USD	15,855	AUD	22,295	18/01/2019	J.P. Morgan	146	
CHF Hedged Share Class							
CHF	1,192,130	USD	1,209,511	18/01/2019	J.P. Morgan	5,105	
EUR Hedged Share Class							
EUR	19,887,266	USD	22,664,801	18/01/2019	J.P. Morgan	150,663	0.02
USD	583,801	EUR	508,378	18/01/2019	J.P. Morgan	569	
GBP Hedged Share Class							
GBP	26,050,417	USD	32,796,303	18/01/2019	J.P. Morgan	433,206	0.08
JPY Hedged Share Class							
JPY	7,098,438,733	USD	62,908,640	18/01/2019	J.P. Morgan	1,937,969	0.31
SGD Hedged Share Class							
SGD	3,657,993	USD	2,663,264	18/01/2019	J.P. Morgan	21,528	
ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現利益						2,549,186	0.41
先物為替予約の未実現利益合計						2,588,633	0.41
USD	2,325,619	EUR	2,030,000	04/01/2019	Morgan Stanley	(444)	
USD	3,204,140	EUR	2,830,000	10/01/2019	Goldman Sachs	(40,186)	(0.01)
USD	285,734	EUR	250,000	14/01/2019	J.P. Morgan	(971)	
USD	2,082,304	INR	147,500,000	15/01/2019	Citibank	(27,482)	(0.01)
USD	2,083,186	INR	147,500,000	15/01/2019	Goldman Sachs	(26,600)	
USD	2,349,546	CNH	16,220,000	17/01/2019	J.P. Morgan	(12,021)	
USD	5,859,006	EUR	5,150,000	17/01/2019	HSBC	(48,742)	(0.01)
USD	1,421,811	ZAR	20,500,000	17/01/2019	J.P. Morgan	(625)	
USD	1,556,456	EUR	1,365,000	18/01/2019	HSBC	(9,526)	
USD	5,080,101	EUR	4,460,000	25/01/2019	Goldman Sachs	(39,846)	(0.01)
USD	2,141,181	EUR	1,890,000	28/01/2019	Bank of America	(29,074)	(0.01)
USD	2,416,904	MXN	48,900,000	29/01/2019	Citibank	(60,695)	(0.01)
先物為替予約の未実現損						(296,212)	(0.06)
AUD Hedged Share Class							
AUD	2,200,678	USD	1,582,377	18/01/2019	J.P. Morgan	(31,832)	(0.01)
CHF Hedged Share Class							
USD	80,985	CHF	79,905	18/01/2019	J.P. Morgan	(427)	
EUR Hedged Share Class							
USD	1,407,313	EUR	1,234,739	18/01/2019	J.P. Morgan	(9,228)	
GBP Hedged Share Class							
USD	528,395	GBP	416,696	18/01/2019	J.P. Morgan	(3,136)	
JPY Hedged Share Class							
USD	701,147	JPY	77,796,841	18/01/2019	J.P. Morgan	(9,554)	
SGD Hedged Share Class							
USD	30,578	SGD	41,968	18/01/2019	J.P. Morgan	(225)	
ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現損						(54,402)	
先物為替予約の未実現損合計						(350,614)	(0.06)
先物為替予約の未実現損益総額						2,238,019	0.35

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・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（LUX）

損益および純資産変動計算書

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）	20,414
債券および転換社債に係る利息（源泉徴収税額控除後）	47,745,724
銀行預金利息	266,711
スワップ取引	8,131
収益小計	48,040,980
費用	
運用報酬	3,760,600
管理手数料	528,262
専門家サービス	227,948
年次税	182,835
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	228,107
印刷費用	42,708
その他費用	17,591
当座貸越利息*	
スワップ取引	
費用小計	4,988,051
費用の払戻し	350,536
投資純利益 / (損失) (a)	43,403,465
実現純利益 / (損失)	
投資有価証券の売却取引	-22,794,615
スワップ取引	-221,911
金融先物取引	
為替取引	-4,299,713
当期実現純利益 / (損失) (b)	-27,316,239
未実現評価利益 / (損失)の増減	
投資有価証券	-39,871,473
スワップ取引	300,313
為替取引	2,078,609
金融先物取引	
当期末実現評価利益 / (損失)の増減 (c)	-37,492,551
当期損益 (a+b+c)	-21,405,325
配当金の分配	-15,053,279
当期投資証券の差引増減額	-69,352,904
期首純資産総額	741,261,357
期末純資産総額	635,449,849

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・ハイインカム債券マザーファンド（米ドル売り円買い）」の投資対象である「日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」は、「日本短期債券マザーファンド」受益証券を投資対象としており、同マザーファンドにおける計算日直近の組入有価証券は次のとおりであります。本情報は同マザーファンドの投信運用会社である三菱UFJ国際投信株式会社からの資料に基づき委託会社が作成したものでありますが、これらは監査意見の対象外であります。

なお、同ファンド（「日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」）は、三菱UFJ国際投信株式会社の委嘱に基づき、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に準じて、設定日（2007年9月26日）より各計算期間の財務諸表について、監査を受けております。なお、直近の計算期間は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・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）

2019年6月28日現在

資産総額	7,067,218,361円
負債総額	30,512,855円
純資産総額（ - ）	7,036,705,506円
発行済口数	5,667,273,304口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2416円

（参考）キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（米ドル売り円買い）

2019年6月28日現在

資産総額	7,054,036,676円
負債総額	14,646,000円
純資産総額（ - ）	7,039,390,676円
発行済口数	5,404,322,931口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3025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

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（2018年12月28日現在）
（中略）
- (2) 会社の機構（2018年12月28日現在）
（以下略）

<訂正後>

- (1) 資本金の額（2019年6月28日現在）
（中略）
- (2) 会社の機構（2019年6月28日現在）
（以下略）

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

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

委託会社の運用する証券投資信託は2018年12月28日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	28	365,800
合計	28	365,800

<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2019年6月28日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	28	363,433
合計	28	363,433

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・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）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・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）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期事業年度の中間会計期間（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。