

【表紙】

| | |
|--------------------------------------|--|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2021年8月13日提出 |
| 【発行者名】 | キャピタル・インターナショナル株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役会長 クワック・ソン・ギョン |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区丸の内二丁目 1 番 1 号 明治安田生命ビル |
| 【事務連絡者氏名】 | 原田 伸健 |
| 【電話番号】 | 03(6366)1000 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 | キャピタル・グローバル・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(2021年2月19日から2022年2月17日まで) 3,000億円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2021年2月18日付けをもって提出した有価証券届出書（2021年6月30日付けをもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、「第二部ファンド情報」及び「第三部委託会社等の情報」における訂正事項を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書を以下の内容に訂正します。下線部_____は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（3）【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

（前略）

委託会社の概況（2020年12月30日現在）

（以下略）

< 訂正後 >

（前略）

委託会社の概況（2021年6月30日現在）

（以下略）

2【投資方針】

（2）【投資対象】

< 訂正前 >

（前略）

< 参考情報 2 > 投資対象ファンドの概要等

（中略）

上記は、2020年12月31日現在のものであり、今後、投資顧問会社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、2020年12月31日現在のものであり、今後、委託会社の判断その他理由により変更される場合があります。

< 訂正後 >

（前略）

< 参考情報 2 > 投資対象ファンドの概要等

（中略）

上記は、2021年6月30日現在のものであり、今後、投資顧問会社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、2021年6月30日現在のものであり、今後、委託会社の判断その他理由により変更される場合があります。

（3）【運用体制】

< 訂正前 >

（前略）

内部管理体制

（中略）

（参考情報）

キャピタル・インターナショナル株式会社の運用部門等の人員体制（2020年12月30日現在）

運用部（3名）／法務コンプライアンス部（3名）／オペレーション部（6名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

上記は2020年12月30日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

<訂正後>

（前略）

内部管理体制

（中略）

（参考情報）

キャピタル・インターナショナル株式会社の運用部門等の人員体制（2021年6月30日現在）

運用部（3名）／法務コンプライアンス部（3名）／オペレーション部（6名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

上記は2021年6月30日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

3【投資リスク】

<訂正前>

（前略）

上記は2020年12月30日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

<訂正後>

（前略）

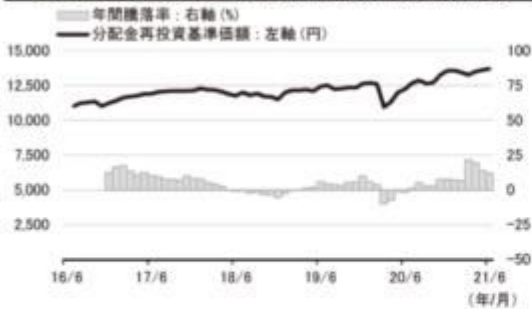
上記は2021年6月30日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

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

<更新・訂正後>

リスクの定量的比較

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



(注1) 年間騰落率は、2016年12月から2021年6月までの各月末における1年間の騰落率を表示したもので、分配金再投資基準価額を基に算出しています。
(注2) 分配金再投資基準価額は、設定日(2015年12月30日)を10,000円とした基準価額です。
(注3) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額であり、実際の基準価額と異なる場合があります。

＜各資産クラスの指数＞

日本株・・・TOPIX(配当込み)
先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)
新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)
日本国債・・・NOMURA-BPI国債
先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本/円ベース)
新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(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、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

「日本国債」の資産クラスはNOMURA-BPI国債を表示しております。

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

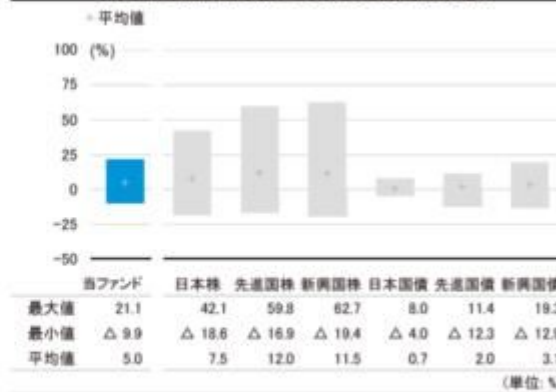
「先進国債」の資産クラスはFTSE世界国債インデックス(除く日本/円ベース)を表示しております。

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

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

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) 資産クラスの騰落率は、2016年7月から2021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2021年6月までの各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

＜訂正前＞

課税上は、株式投資信託として取扱われ、個人受益者、法人受益者毎に以下の取扱いとなります。以下の取扱内容は、2020年12月31日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご注意ください。また、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が以下と異なる場合があります。

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

(以下略)

< 訂正後 >

課税上は、株式投資信託として取扱われ、個人受益者、法人受益者毎に以下の取扱いとなります。以下の取扱内容は、2021年6月30日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご留意ください。また、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が以下と異なる場合があります。

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

（以下略）

5【運用状況】

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

< 更新・訂正後 >

（1）【投資状況】

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）

2021年6月30日現在

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|--------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 9,215,299,584 | 98.12 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 175,770,708 | 1.87 |
| 合計(純資産総額) | | 9,391,070,292 | 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）

2021年6月30日現在

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|---------|---------------|---------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 4,095,032 | 0.04 |
| 投資証券 | ルクセンブルク | 9,198,102,884 | 99.81 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 12,981,175 | 0.14 |
| 合計(純資産総額) | | 9,215,179,091 | 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）

2021年6月30日現在

| 資産の種類 | 国/地域名 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-------|--------|----------------|---------|
| | 米国 | 65,517,027,704 | 36.88 |
| | メキシコ | 10,685,861,319 | 6.02 |
| | 中国 | 7,160,141,114 | 4.03 |
| | ブラジル | 6,742,120,035 | 3.80 |
| | ロシア | 5,582,969,995 | 3.14 |
| | インドネシア | 5,225,003,419 | 2.94 |
| | カナダ | 4,773,114,135 | 2.69 |

| | | | |
|-------------------|--------------|-----------------|--------|
| 債券 | マレーシア | 3,723,688,708 | 2.10 |
| | コロンビア | 3,575,560,783 | 2.01 |
| | パナマ | 2,967,009,304 | 1.67 |
| | エジプト | 2,823,271,810 | 1.59 |
| | トルコ | 2,729,657,815 | 1.54 |
| | ペルー | 2,671,212,215 | 1.50 |
| | ウクライナ | 2,431,535,486 | 1.37 |
| | 南アフリカ | 2,290,892,400 | 1.29 |
| | ルクセンブルク | 2,159,781,749 | 1.22 |
| | ドミニカ共和国 | 2,089,834,847 | 1.18 |
| | アルゼンチン | 1,902,699,531 | 1.07 |
| | アラブ首長国連邦 | 1,872,508,821 | 1.05 |
| | オランダ | 1,757,277,280 | 0.99 |
| | カタール | 1,494,723,167 | 0.84 |
| | オマーン | 1,419,826,670 | 0.80 |
| | 香港 | 1,357,855,083 | 0.76 |
| | ホンジュラス | 1,336,020,247 | 0.75 |
| | パラグアイ | 1,277,750,512 | 0.72 |
| | コートジボワール | 1,235,746,209 | 0.70 |
| | アンゴラ | 1,178,232,413 | 0.66 |
| | カザフスタン | 1,175,073,230 | 0.66 |
| | ケニア | 1,163,853,708 | 0.66 |
| | スリランカ | 1,136,513,974 | 0.64 |
| | チュニジア | 1,070,303,989 | 0.60 |
| | セネガル | 858,648,627 | 0.48 |
| | タイ | 857,059,067 | 0.48 |
| | イタリア | 777,880,016 | 0.44 |
| | コスタリカ | 742,786,122 | 0.42 |
| | グアテマラ | 684,223,197 | 0.39 |
| | サウジアラビア | 663,026,309 | 0.37 |
| | ガボン | 658,307,519 | 0.37 |
| | スペイン | 594,519,030 | 0.33 |
| | パキスタン | 594,381,963 | 0.33 |
| | ベラルーシ | 530,427,106 | 0.30 |
| | 英国 | 483,181,472 | 0.27 |
| | インド | 472,068,183 | 0.27 |
| | ボスニア・ヘルツェゴビナ | 427,589,424 | 0.24 |
| | カメルーン | 416,499,954 | 0.23 |
| | ガーナ | 388,160,518 | 0.22 |
| | チリ | 331,237,038 | 0.19 |
| | ルーマニア | 330,606,616 | 0.19 |
| | フランス | 306,248,341 | 0.17 |
| | モザンビーク | 287,150,310 | 0.16 |
| | ジョージア | 284,835,848 | 0.16 |
| | バミューダ諸島 | 276,500,681 | 0.16 |
| | エチオピア | 264,165,164 | 0.15 |
| | フィリピン | 234,046,522 | 0.13 |
| | ヨルダン | 183,909,147 | 0.10 |
| | ベネズエラ | 136,781,474 | 0.08 |
| | バーレーン | 131,302,866 | 0.07 |
| | アイルランド | 120,697,519 | 0.07 |
| | オーストリア | 100,882,289 | 0.06 |
| | ナミビア | 86,355,587 | 0.05 |
| | イラク | 69,764,619 | 0.04 |
| | ポーランド | 777,988 | 0.00 |
| 株式 | 米国 | 2,634,631,884 | 1.48 |
| 銀行預金、その他資産（負債控除後） | | 10,171,562,043 | 5.73 |
| 純資産総額 | | 177,627,282,115 | 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

2021年1月22日現在

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|--------|---------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 60,009,480 | 3.33 |
| 特殊債券 | 日本 | 100,031,000 | 5.55 |
| 社債券 | 日本 | 1,501,195,000 | 83.31 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 140,705,508 | 7.81 |
| 合計(純資産総額) | | 1,801,940,988 | 100.00 |

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

(注)当該情報は委託会社が入手可能な直近日（2021年1月22日）現在の情報です。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

キャピタル・グローバル・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

2021年6月30日現在

| 順位 | 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名 | 口数 (口) | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|--------|---------------|---|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | キャピタル・グローバル・ハイ インカム債券マザーファンド（米ド ル売り円買い） | 6,327,016,536 | 1.4089 | 8,914,762,770 | 1.4565 | 9,215,299,584 | 98.12 |

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

b. 種類別投資比率

2021年6月30日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 98.12 |
| 合計 | 98.12 |

（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

2021年6月30日現在

| 順位 | 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 口数 (口) | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|---------|----------|--|---------------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | ルクセンブルク | 投資証券 | キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（LUX）（クラスCh-JPY） | 1,333,251.614 | 6,676.58 | 8,901,570,433 | 6,899 | 9,198,102,884 | 99.81 |
| 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 | 1.0531 | 4,093,477 | 1.0535 | 4,095,032 | 0.04 |

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

b.種類別投資比率

2021年6月30日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 0.04 |
| 投資証券 | 99.81 |
| 合計 | 99.85 |

（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

2021年6月30日現在

| 順位 | 銘柄 | 利率(%) (上段) 償還日 (下段) | 国/地域 (上段) 資産(中 段) 業種/種 類(下 段) | 数量 | 評価単価(上段) 通貨(下段) | 評価金額(円) | 投資 比率 (%) |
|----|---|------------------------------|---|-----------------|---------------------------|---------------|-----------------|
| 1 | CHINA DEV BANK CNY UNSEC 3.48% 01-08-29 | 3.48 2029/1/8 | 中国 債券 国債証券 | 134,800,000 | 99.8466 中国元 | 2,304,028,115 | 1.30 |
| 2 | TITULOS DE TESORERIA COP UNSEC 5.75% 11- 03-27 | 5.75 2027/11/3 | コロンビ ア 債券 国債証券 | 74,087,400,000 | 96.2042 コロンビア・ペ ソ | 2,091,338,396 | 1.18 |
| 3 | ROTECH HEALTHCARE INC PP | - - | 米国 株式 社債券 | 153,793 | 107.50 米ドル | 1,827,612,572 | 1.03 |
| 4 | CHINA DEV BANK CNY UNSEC 3.34% 07-14-25 | 3.34 2025/7/14 | 中国 債券 国債証券 | 93,380,000 | 100.4229 中国元 | 1,605,280,887 | 0.90 |
| 5 | EMIRATE OF ABU DHABI REG S 2.5% 09-30-29 | 2.5 2029/9/30 | アラブ首 長国連邦 債券 国債証券 | 13,000,000 | 104.5964 米ドル | 1,503,139,175 | 0.85 |
| 6 | PERU PEN 144A LIFE/REG S 6.15% 08-12-32 | 6.15 2032/8/12 | ペルー 債券 国債証券 | 46,900,000 | 104.9193 ペルー・ソル | 1,399,974,883 | 0.79 |
| 7 | INDONESIA GOVT BOND IDR FR78 8.25% 05-15-29 | 8.25 2029/5/15 | インドネ シア 債券 国債証券 | 161,692,000,000 | 111.973 インドネシア・ ルピー | 1,381,727,660 | 0.78 |
| 8 | STATE OF QATAR REG S 4.0% 03- 14-29 | 4.0 2029/3/14 | カタール 債券 国債証券 | 10,700,000 | 115.237 米ドル | 1,363,059,536 | 0.77 |

| | | | | | | | |
|----|--|--------------------|--------------------------|-----------------|-----------------------------|---------------|------|
| 9 | HONDURAS REP OF REG S 6.25% 01- 19-27 | 6.25 2027/1/19 | ホンジュ ラス 債券 国債証券 | 11,017,000 | 109.701 米ドル | 1,336,020,247 | 0.75 |
| 10 | TURKEY REP OF 4.25% 04-14-26 | 4.25 2026/4/14 | トルコ 債券 国債証券 | 12,250,000 | 96.375 米ドル | 1,305,087,361 | 0.73 |
| 11 | PEMEX MXN 7.47% 11-12-26 | 7.47 2026/11/12 | メキシコ 債券 社債券 | 253,930,000 | 89.9929 メキシコ・ペソ | 1,274,616,948 | 0.72 |
| 12 | MALAYSIA GVT MYR 4.893% 06- 08-38 | 4.893 2038/6/8 | マレーシ ア 債券 国債証券 | 43,000,000 | 108.2097 マレーシア・リ ンギット | 1,238,992,113 | 0.70 |
| 13 | RUSSIA GOVT OFZ RUB 8.5% 09-17- 31 | 8.5 2031/9/17 | ロシア 債券 国債証券 | 731,540,000 | 110.153 ロシア・ルーブ ル | 1,224,827,286 | 0.69 |
| 14 | FIRST QUANTUM MINERALS 144A LIFE SR UNSEC 7.5% 04-01-25 | 7.5 2025/4/1 | カナダ 債券 社債券 | 10,275,000 | 104.1135 米ドル | 1,182,573,060 | 0.67 |
| 15 | RUSSIA GOVT OFZ RUB 7.0% 01-25- 23 | 7.0 2023/1/25 | ロシア 債券 国債証券 | 734,825,000 | 100.56 ロシア・ルーブ ル | 1,123,180,702 | 0.63 |
| 16 | INDONESIA GOVT BOND IDR FR71 9.00% 03-15-29 | 9.0 2029/3/15 | インドネ シア 債券 国債証券 | 124,192,000,000 | 115.85 インドネシア・ ルピー | 1,098,020,033 | 0.62 |
| 17 | NGL ENERGY OPERATING 144A LIFE SEC 7.5% 02-01-26 | 7.5 2026/2/1 | 米国 債券 社債券 | 8,745,000 | 105.125 米ドル | 1,016,260,221 | 0.57 |
| 18 | BRAZIL NTNB BRL I/L 6.0% 08-15- 24 | 6.0 2024/8/15 | ブラジル 債券 国債証券 | 1,161,800 | 3,848.6463 ブラジル・レアル | 1,000,194,641 | 0.56 |
| 19 | ANGOLA (REPUBLIC OF) 144A LIFE 8.0% 11-26-29 | 8.0 2029/11/26 | アンゴラ 債券 国債証券 | 8,600,000 | 102.8775 米ドル | 978,043,018 | 0.55 |
| 20 | CHINA DEVELOPMENT BANK CNY UNSEC 4.24% 08-24-27 | 4.24 2027/8/24 | 中国 債券 国債証券 | 53,700,000 | 104.4077 中国元 | 959,778,922 | 0.54 |
| 21 | NAVIENT CORP SR UNSEC 6.125% 03-25-24 | 6.125 2024/3/25 | 米国 債券 社債券 | 7,990,000 | 108.325 米ドル | 956,785,491 | 0.54 |
| 22 | ARGENTINA REP OF 0.125% 07- 09-35/21 | 0.125 2035/7/9 | アルゼン チン 債券 国債証券 | 26,466,893 | 32.25 米ドル | 938,462,169 | 0.53 |
| 23 | SOUTH AFRICA GVT ZAR R2048 8.75% 02-28-48 | 8.75 2048/2/28 | 南アフリ カ 債券 国債証券 | 141,650,000 | 84.315 南アフリカ・ラ ンド | 920,525,171 | 0.52 |
| 24 | SOUTH AFRICA GVT ZAR R214 6.5% 02-28-41 | 6.5 2041/2/28 | 南アフリ カ 債券 国債証券 | 172,510,000 | 67.005 南アフリカ・ラ ンド | 890,913,895 | 0.50 |
| 25 | SASOL FINANCING USA LLC SR UNSEC 4.375% 09-18-26 | 4.375 2026/9/18 | 米国 債券 社債券 | 7,600,000 | 103.587 米ドル | 870,277,894 | 0.49 |

| | | | | | | | |
|----|--|--------------------|----------------------|-----------------|-------------------------|-------------|------|
| 26 | MALAYSIA GVT MYR 3.885% 08-15-29 | 3.885 2029/8/15 | マレーシア 債券 国債証券 | 30,500,000 | 104.9367 マレーシア・リンギット | 852,239,144 | 0.48 |
| 27 | INDONESIA GOVT BOND IDR FR59 7.0% 05-15-27 | 7.0 2027/5/15 | インドネシア 債券 国債証券 | 103,906,000,000 | 106.322 インドネシア・ルピー | 843,110,248 | 0.47 |
| 28 | UNIVISION COMM 144A LIFE SEC 6.625% 06-01-27 | 6.625 2027/6/1 | 米国 債券 社債券 | 6,825,000 | 108.25 米ドル | 816,713,369 | 0.46 |
| 29 | BRAZIL NTNB BRL I/L 6.0% 05-15-23 | 6.0 2023/5/15 | ブラジル 債券 国債証券 | 952,700 | 3,788.6809 ブラジル・リアル | 807,401,115 | 0.45 |
| 30 | BONOS MEXICAN MXN 8.5% 05-31-29 | 8.5 2029/5/31 | メキシコ 債券 国債証券 | 131,000,000 | 110.1737 メキシコ・ペソ | 805,019,608 | 0.45 |

（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（L U X）の純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

（参考）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)の投資対象である日本短期債券マザーファンドの投資有価証券の明細

2021年1月22日現在

| 国名 | 銘柄名 | 利率 (%) | 償還日 | 種類 | 額面 (千円) | 評価額 | | 投資 比率 (%) |
|----|---|-----------|------------|------|------------|-----------|-------------|-----------------|
| | | | | | | 単価 (円) | 金額 (円) | |
| 日本 | 第958回国庫短期債券 | 0 | 2021/3/22 | 国債証券 | 60,000 | 100.0158 | 60,009,480 | 3.33 |
| 日本 | 第48回韓国産業銀行 円貨債券（2018） | 0.23 | 2021/9/3 | 特殊債券 | 100,000 | 100.031 | 100,031,000 | 5.55 |
| 日本 | 第6回マラヤン・バン キング・ベルハッド 円貨社債（2020） | 0.224 | 2023/2/13 | 社債券 | 100,000 | 99.765 | 99,765,000 | 5.54 |
| 日本 | 第14回アサヒグルー プホールディングス （特定社債間限定同 順位特約付）（グ リーンボンド） | 0.12 | 2025/10/15 | 社債券 | 100,000 | 100.113 | 100,113,000 | 5.56 |
| 日本 | 第14回セブン＆ア イ・ホールディング ス（社債間限定同順 位特約付） | 0.19 | 2025/12/19 | 社債券 | 100,000 | 100.336 | 100,336,000 | 5.57 |
| 日本 | 第15回Zホールディ ングス（社債間限定 同順位特約付） | 0.35 | 2023/6/9 | 社債券 | 100,000 | 99.945 | 99,945,000 | 5.55 |
| 日本 | 第18回日立製作所 （社債間限定同順位 特約付） | 0.06 | 2023/3/10 | 社債券 | 100,000 | 99.871 | 99,871,000 | 5.54 |
| 日本 | 第46回I H I（社債 間限定同順位特約 付） | 0.22 | 2023/9/1 | 社債券 | 100,000 | 100.015 | 100,015,000 | 5.55 |

| | | | | | | | | |
|----|--|-------|------------|-----|---------|---------|-------------|------|
| 日本 | 第1回明治安田生命 2019基金特定目的会 社特定社債（一般担 保付） | 0.29 | 2024/8/2 | 社債券 | 100,000 | 100.015 | 100,015,000 | 5.55 |
| 日本 | 第37回丸井グループ （社債間限定同順位 特約付） | 0.12 | 2023/12/1 | 社債券 | 100,000 | 99.802 | 99,802,000 | 5.54 |
| 日本 | 第19回みずほ銀行 （劣後特約付） | 1.67 | 2022/2/24 | 社債券 | 100,000 | 101.542 | 101,542,000 | 5.64 |
| 日本 | 第22回芙蓉総合リー ス（社債間限定同順 位特約付） | 0.04 | 2022/10/28 | 社債券 | 100,000 | 99.838 | 99,838,000 | 5.54 |
| 日本 | 第16回東京センチュ リーリース（社債間 限定同順位特約付） | 0.2 | 2021/4/14 | 社債券 | 100,000 | 100.024 | 100,024,000 | 5.55 |
| 日本 | 第5回イオンフィナ ンシャルサービス （社債間限定同順位 特約付） | 0.23 | 2022/5/27 | 社債券 | 100,000 | 99.991 | 99,991,000 | 5.55 |
| 日本 | 第75回アコム（特定 社債間限定同順位特 約付） | 0.309 | 2023/2/28 | 社債券 | 100,000 | 100.055 | 100,055,000 | 5.55 |
| 日本 | 第74回三菱UFJ リース（社債間限定 同順位特約付） | 0.09 | 2023/1/23 | 社債券 | 100,000 | 99.955 | 99,955,000 | 5.55 |
| 日本 | 第5回ソフトバンク （社債間限定同順位 特約付） | 0.1 | 2023/7/28 | 社債券 | 100,000 | 99.928 | 99,928,000 | 5.55 |

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

（注）当該情報は委託会社が入手可能な直近日（2021年1月22日）現在の情報です。

【投資不動産物件】

キャピタル・グローバル・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 |
| 第4期 (2019年11月20日) | 6,680,365,363 | 6,680,365,363 | 1.2294 | 1.2294 |
| 第5期 (2020年11月20日) | 6,100,530,780 | 6,100,530,780 | 1.3158 | 1.3158 |
| 2020年 6月末日 | 6,176,104,325 | | 1.2213 | |
| 7月末日 | 6,073,378,071 | | 1.2643 | |
| 8月末日 | 6,047,447,752 | | 1.2841 | |
| 9月末日 | 5,901,890,174 | | 1.2611 | |
| 10月末日 | 5,869,314,998 | | 1.2692 | |
| 11月末日 | 6,092,789,078 | | 1.3239 | |
| 12月末日 | 6,464,309,245 | | 1.3541 | |
| 2021年 1月末日 | 6,769,398,320 | | 1.3563 | |
| 2月末日 | 6,938,247,085 | | 1.3419 | |
| 3月末日 | 7,503,756,318 | | 1.3233 | |
| 4月末日 | 7,794,157,424 | | 1.3480 | |
| 5月末日 | 8,125,338,506 | | 1.3593 | |
| 6月末日 | 9,391,070,292 | | 1.3667 | |

(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 |
| 第4期 | 2018年11月21日～2019年11月20日 | 0 |
| 第5期 | 2019年11月21日～2020年11月20日 | 0 |

【収益率の推移】

キャピタル・グローバル・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期 | 2018年11月21日～2019年11月20日 | 5.3 |
| 第5期 | 2019年11月21日～2020年11月20日 | 7.0 |
| 第6中間計算期間末 | 2020年11月21日～2021年 5月20日 | 2.8 |

(注)第1期の収益率は、計算期末の基準価額（分配付の額）から設定日の基準価額を控除した額を設定日の基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数です。

(注)収益率は、計算期末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期末の基準価額（分配落ちの額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。

（４）【設定及び解約の実績】

キャピタル・グローバル・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期 | 2018年11月21日～2019年11月20日 | 1,129,753,814 | 1,965,368,052 | 5,434,027,762 |
| 第5期 | 2019年11月21日～2020年11月20日 | 702,089,655 | 1,499,817,925 | 4,636,299,492 |
| 第6中間計算期間末 | 2020年11月21日～2021年 5月20日 | 1,696,934,939 | 490,209,168 | 5,843,025,263 |

(注)第1期の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

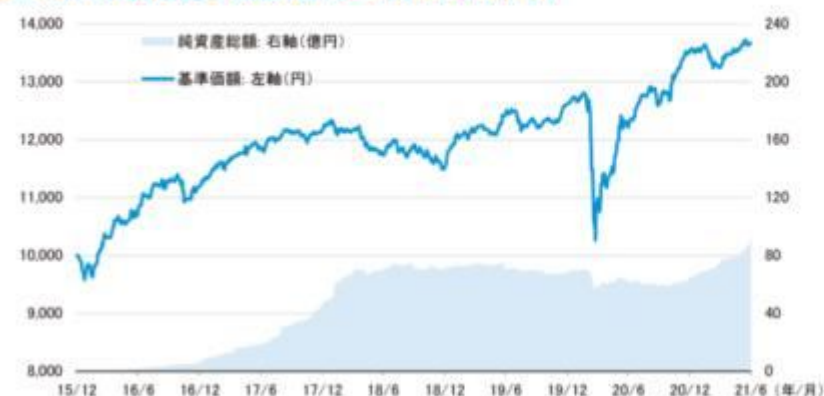
参考情報

2021年6月30日現在

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 |
| 第4期 | 2019年11月 | 0円 |
| 第5期 | 2020年11月 | 0円 |
| 設定累計 | | 0円 |
| 分配金は1万口当たり、税引前 | | |

基準価額・純資産の推移（設定～2021年6月30日）



主要な資産の状況(2021年6月30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C1-JPY) | 99.81 |
| 2 | 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定) | 0.04 |

<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>

(2021年6月30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 | CHINA DEV BANK CNY UNSEC 3.48% 01-08-29 | 中国 | 国債証券 | 1.30 |
| 2 | TITULOS DE TESORERIA COP UNSEC 5.75% 11-03-27 | コロンビア | 国債証券 | 1.18 |
| 3 | ROTECH HEALTHCARE INC PP | 米国 | 株式 | 1.03 |
| 4 | CHINA DEV BANK CNY UNSEC 3.34% 07-14-25 | 中国 | 国債証券 | 0.90 |
| 5 | EMIRATE OF ABU DHABI REG S 2.5% 09-30-29 | アラブ首長国連邦 | 国債証券 | 0.85 |
| 6 | PERU PEN 144A LIFE/REG S 6.15% 08-12-32 | ペルー | 国債証券 | 0.79 |
| 7 | INDONESIA GOVT BOND IDR FR78 8.25% 05-15-29 | インドネシア | 国債証券 | 0.78 |
| 8 | STATE OF QATAR REG S 4.0% 03-14-29 | カタール | 国債証券 | 0.77 |
| 9 | HONDURAS REP OF REG S 6.25% 01-19-27 | ホンジュラス | 国債証券 | 0.75 |
| 10 | TURKEY REP OF 4.25% 04-14-26 | トルコ | 国債証券 | 0.73 |

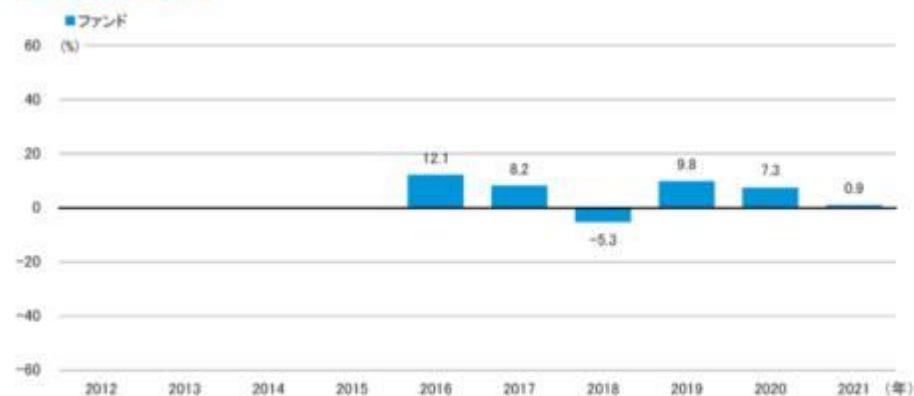
証券種別構成比率

| 証券種別 | 投資比率(%) |
|--------|---------|
| 国債証券 | 38.14 |
| 社債券 | 54.65 |
| その他証券 | 1.48 |
| 現金・その他 | 5.73 |

国別構成比率

| 国名 | 投資比率(%) |
|--------|---------|
| 米国 | 38.37 |
| メキシコ | 6.02 |
| 中国 | 4.03 |
| ブラジル | 3.80 |
| ロシア | 3.14 |
| その他国 | 38.92 |
| 現金・その他 | 5.73 |

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しています。

2021年は6月末までの収益率を表示しています。

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

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

第3【ファンドの経理状況】

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

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間（2020年11月21日から2021年5月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【キャピタル・グローバル・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5期 2020年11月20日現在 | 第6期中間計算期間 2021年5月20日現在 |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 50,397,875 | 43,977,701 |
| 親投資信託受益証券 | 6,077,391,543 | 7,885,541,820 |
| 未収入金 | 1,500,000 | - |
| 流動資産合計 | 6,129,289,418 | 7,929,519,521 |
| 資産合計 | 6,129,289,418 | 7,929,519,521 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 4,913,587 | 3,160,509 |
| 未払受託者報酬 | 675,303 | 761,568 |
| 未払委託者報酬 | 22,284,897 | 25,131,770 |
| 未払利息 | 144 | 120 |
| その他未払費用 | 884,707 | 870,972 |
| 流動負債合計 | 28,758,638 | 29,924,939 |
| 負債合計 | 28,758,638 | 29,924,939 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 4,636,299,492 | 5,843,025,263 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 1,464,231,288 | 2,056,569,319 |
| 元本等合計 | 6,100,530,780 | 7,899,594,582 |
| 純資産合計 | 6,100,530,780 | 7,899,594,582 |
| 負債純資産合計 | 6,129,289,418 | 7,929,519,521 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

| | 第5期中間計算期間 自 2019年11月21日 至 2020年5月20日 | 第6期中間計算期間 自 2020年11月21日 至 2021年5月20日 |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 344,762,970 | 205,650,277 |
| 営業収益合計 | 344,762,970 | 205,650,277 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 11,778 | 33,417 |
| 受託者報酬 | 715,638 | 761,568 |
| 委託者報酬 | 23,616,281 | 25,131,770 |
| その他費用 | 875,354 | 870,972 |
| 営業費用合計 | 25,219,051 | 26,797,727 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 369,982,021 | 178,852,550 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 369,982,021 | 178,852,550 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 369,982,021 | 178,852,550 |
| 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（ ） | 9,797,243 | 10,923,224 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 1,246,337,601 | 1,464,231,288 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 95,280,874 | 581,122,513 |
| 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 | 95,280,874 | 581,122,513 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 116,344,396 | 156,713,808 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 116,344,396 | 156,713,808 |
| 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（ ） | 865,089,301 | 2,056,569,319 |

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

| 第5期 2020年11月20日現在 | 第6期中間計算期間 2021年5月20日現在 |
|---|---|
| 1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 4,636,299,492口 | 1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数 5,843,025,263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 1.3158円 (1万口当たり純資産額) (13,158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 1.3520円 (1万口当たり純資産額) (13,520円) |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第5期 自 2019年11月21日 至 2020年11月20日 | 第6期中間計算期間 自 2020年11月21日 至 2021年5月20日 |
|-----------------------|--|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | (1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

当ファンドの中間計算期間における元本額の変動

| 項目 | 第5期 自 2019年11月21日 至 2020年11月20日 | 第6期中間計算期間 自 2020年11月21日 至 2021年5月20日 |
|-----------|---------------------------------------|--|
| 期首元本額 | 5,434,027,762円 | 4,636,299,492円 |
| 期中追加設定元本額 | 702,089,655円 | 1,696,934,939円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,499,817,925円 | 490,209,168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）

| 2021年5月20日現在 | |
|--------------|---------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 40,391,394 |
| 投資信託受益証券 | 4,094,643 |
| 投資証券 | 7,870,130,176 |
| 流動資産合計 | 7,914,616,213 |
| 資産合計 | 7,914,616,213 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 29,000,000 |
| 未払利息 | 110 |
| 流動負債合計 | 29,000,110 |
| 負債合計 | 29,000,110 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 5,478,353,356 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 2,407,262,747 |
| 元本等合計 | 7,885,616,103 |
| 純資産合計 | 7,885,616,103 |
| 負債純資産合計 | 7,914,616,213 |

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 | 2021年5月20日現在 |
|------------------------|---|
| 1. 計算日における受益権の総数 | 5,478,353,356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 1.4394円 (1万口当たり純資産額) (14,394円) |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 自 2020年11月21日 至 2021年5月20日 |
|------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <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 | 2021年5月20日現在 |
|-------------------------------------|----------------|
| 同計算期間の期首元本額 | 4,355,616,386円 |
| 同計算期間の追加設定元本額 | 1,297,116,832円 |
| 同計算期間の一部解約元本額 | 174,379,862円 |
| 計算日の元本額 | 5,478,353,356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） | 5,478,353,356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、2020年12月31日付けで、ルクセンブルクにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務書類が作成されております。この財務書類は独立監査人であるブ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

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|--|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing | | | | |
| Bonds | | | | |
| <i>Angola</i> | | | | |
| Angola Government Bond, 144A 8% 26/11/2029 | USD | 8,600,000 | 8,105,844 | 0.60 |
| Angola Government Bond, Reg. S 8.25% 09/05/2028 | USD | 600,000 | 577,154 | 0.04 |
| Angola Government Bond, Reg. S 8% 26/11/2029 | USD | 1,150,000 | 1,083,921 | 0.08 |
| | | | 9,766,919 | 0.72 |
| <i>Argentina</i> | | | | |
| Argentina Government Bond 1% 09/07/2029 | USD | 1,713,573 | 752,790 | 0.06 |
| Argentina Government Bond 0.125% 09/07/2030 | USD | 16,931,912 | 6,943,180 | 0.51 |
| Argentina Government Bond 0.125% 09/07/2035 | USD | 15,566,893 | 5,752,729 | 0.42 |
| YPF Energia Electrica SA, 144A 10% 25/07/2026 | USD | 2,000,000 | 1,652,520 | 0.12 |
| | | | 15,101,219 | 1.11 |
| <i>Austria</i> | | | | |
| Suzano Austria GmbH 3.75% 15/01/2031 | USD | 3,300,000 | 3,505,425 | 0.26 |
| | | | 3,505,425 | 0.26 |
| <i>Azerbaijan</i> | | | | |
| Azerbaijan Government Bond, Reg. S 4.75% 18/03/2024 | USD | 2,348,000 | 2,579,447 | 0.19 |
| | | | 2,579,447 | 0.19 |
| <i>Bahrain</i> | | | | |
| Bahrain Government Bond, Reg. S 6.75% 20/09/2029 | USD | 1,080,000 | 1,244,010 | 0.09 |
| | | | 1,244,010 | 0.09 |
| <i>Belarus</i> | | | | |
| Belarus Government Bond, Reg. S 7.625% 29/06/2027 | USD | 2,250,000 | 2,486,475 | 0.18 |
| | | | 2,486,475 | 0.18 |
| <i>Brazil</i> | | | | |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional 6% 15/08/2030 | BRL | 355,000 | 2,952,685 | 0.22 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional 6% 15/05/2055 | BRL | 215,500 | 2,009,534 | 0.15 |
| JBS Investments II GmbH, Reg. S 7% 15/01/2026 | USD | 2,000,000 | 2,161,900 | 0.16 |
| JBS Investments II GmbH, Reg. S 5.75% 15/01/2028 | USD | 1,800,000 | 1,929,393 | 0.14 |
| MV24 Capital BV, Reg. S 6.748% 01/06/2034 | USD | 2,744,328 | 3,012,613 | 0.22 |
| Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/05/2026 | USD | 1,900,000 | 2,470,475 | 0.18 |
| Petrobras Global Finance BV 6.75% 03/06/2050 | USD | 6,100,000 | 7,586,875 | 0.56 |
| Petrobras Global Finance BV 6.85% 05/06/2115 | USD | 894,000 | 1,116,517 | 0.08 |
| | | | 23,239,992 | 1.71 |
| <i>Cameroon</i> | | | | |
| Cameroon Government Bond, Reg. S 9.5% 19/11/2025 | USD | 3,200,000 | 3,571,680 | 0.26 |
| | | | 3,571,680 | 0.26 |
| <i>Canada</i> | | | | |
| Cenovus Energy, Inc. 6.75% 15/11/2039 | USD | 255,000 | 337,144 | 0.02 |
| | | | 337,144 | 0.02 |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|--|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| <i>Chile</i> | | | | |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, Reg. S, 144A 2.8% 01/10/2033 | CLP | 5,530,000,000 | 7,523,773 | 0.55 |
| | | | 7,523,773 | 0.55 |
| <i>China</i> | | | | |
| China Development Bank 4.24% 24/08/2027 | CNY | 53,700,000 | 8,606,682 | 0.63 |
| China Development Bank 3.48% 08/01/2029 | CNY | 134,800,000 | 20,438,201 | 1.51 |
| China Government Bond 3.29% 23/05/2029 | CNY | 16,900,000 | 2,597,471 | 0.19 |
| ENN Energy Holdings Ltd., Reg. S 2.625% 17/09/2030 | USD | 3,300,000 | 3,320,854 | 0.25 |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd., Reg. S 4.875% 21/09/2025 | USD | 1,800,000 | 2,059,410 | 0.15 |
| Meituan, 144A 3.05% 28/10/2030 | USD | 2,500,000 | 2,601,500 | 0.19 |
| Tencent Holdings Ltd., Reg. S 3.975% 11/04/2029 | USD | 1,900,000 | 2,166,326 | 0.16 |
| | | | 41,790,444 | 3.08 |
| <i>Colombia</i> | | | | |
| Colombia Government Bond 4.5% 15/03/2029 | USD | 380,000 | 440,728 | 0.03 |
| Colombian TES 6.25% 26/11/2025 | COP | 9,400,000,000 | 3,016,384 | 0.22 |
| Colombian TES 5.75% 03/11/2027 | COP | 40,082,900,000 | 12,440,572 | 0.92 |
| Colombian TES 6% 28/04/2028 | COP | 4,364,000,000 | 1,368,659 | 0.10 |
| Colombian TES 7.25% 26/10/2050 | COP | 20,242,000,000 | 6,388,202 | 0.47 |
| Empresas Publicas de Medellin ESP, Reg. S 8.375% 08/11/2027 | COP | 6,415,000,000 | 2,005,917 | 0.15 |
| Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter, Reg. S 7.875% 12/08/2024 | COP | 2,008,000,000 | 629,498 | 0.05 |
| Oleoducto Central SA, 144A 4% 14/07/2027 | USD | 645,000 | 700,799 | 0.05 |
| Oleoducto Central SA, Reg. S 4% 14/07/2027 | USD | 3,895,000 | 4,231,956 | 0.31 |
| | | | 31,222,715 | 2.30 |
| <i>Costa Rica</i> | | | | |
| Costa Rica Government Bond, Reg. S 4.375% 30/04/2025 | USD | 207,000 | 193,784 | 0.02 |
| Costa Rica Government Bond, Reg. S 6.125% 19/02/2031 | USD | 3,928,000 | 3,677,590 | 0.27 |
| Costa Rica Government Bond, Reg. S 5.625% 30/04/2043 | USD | 222,000 | 187,590 | 0.01 |
| Costa Rica Government Bond, Reg. S 7% 04/04/2044 | USD | 2,048,000 | 1,894,400 | 0.14 |
| Costa Rica Government Bond, Reg. S 7.158% 12/03/2045 | USD | 630,000 | 586,688 | 0.04 |
| | | | 6,540,052 | 0.48 |
| <i>Dominican Republic</i> | | | | |
| Dominican Republic Government Bond, 144A 9.75% 05/06/2026 | DOP | 48,600,000 | 900,247 | 0.07 |
| Dominican Republic Government Bond, 144A 6.4% 05/06/2049 | USD | 1,220,000 | 1,436,550 | 0.11 |
| Dominican Republic Government Bond, Reg. S 8.9% 15/02/2023 | DOP | 64,000,000 | 1,136,069 | 0.08 |
| Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.875% 29/01/2026 | USD | 5,280,000 | 6,382,200 | 0.47 |
| Dominican Republic Government Bond, Reg. S 11.25% 05/02/2027 | DOP | 123,100,000 | 2,453,008 | 0.18 |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|---|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| Dominican Republic Government Bond, Reg. S 8.625% 20/04/2027 | USD | 2,375,000 | 3,028,125 | 0.22 |
| Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.85% 27/01/2045 | USD | 1,330,000 | 1,627,588 | 0.12 |
| Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.5% 15/02/2048 | USD | 775,000 | 918,375 | 0.07 |
| Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.4% 05/06/2049 | USD | 1,140,000 | 1,342,350 | 0.10 |
| | | | 19,224,512 | 1.42 |
| <i>Egypt</i> | | | | |
| Egypt Government Bond, 144A 4.75% 16/04/2026 | EUR | 3,300,000 | 4,197,295 | 0.31 |
| Egypt Government Bond, 144A 5.625% 16/04/2030 | EUR | 1,350,000 | 1,729,627 | 0.13 |
| Egypt Government Bond, 144A 7.053% 15/01/2032 | USD | 2,100,000 | 2,292,937 | 0.17 |
| Egypt Government Bond 13.973% 04/02/2023 | EGP | 26,500,000 | 1,696,938 | 0.12 |
| Egypt Government Bond 17.2% 09/08/2023 | EGP | 11,650,000 | 800,111 | 0.06 |
| Egypt Government Bond, Reg. S 7.5% 31/01/2027 | USD | 3,000,000 | 3,477,573 | 0.25 |
| Egypt Government Bond, Reg. S 6.588% 21/02/2028 | USD | 5,500,000 | 6,063,750 | 0.45 |
| | | | 20,258,231 | 1.49 |
| <i>Ethiopia</i> | | | | |
| Ethiopia Government Bond, Reg. S 6.625% 11/12/2024 | USD | 2,575,000 | 2,626,938 | 0.19 |
| | | | 2,626,938 | 0.19 |
| <i>Gabon</i> | | | | |
| Gabon Government Bond, 144A 6.625% 06/02/2031 | USD | 760,000 | 786,643 | 0.06 |
| Gabon Government Bond, Reg. S 6.375% 12/12/2024 | USD | 1,702,508 | 1,776,993 | 0.13 |
| Gabon Government Bond, Reg. S 6.95% 16/06/2025 | USD | 3,100,000 | 3,328,625 | 0.24 |
| | | | 5,892,261 | 0.43 |
| <i>Guatemala</i> | | | | |
| Guatemala Government Bond, Reg. S 4.375% 05/06/2027 | USD | 1,800,000 | 2,004,228 | 0.15 |
| Guatemala Government Bond, Reg. S 6.125% 01/06/2050 | USD | 3,450,000 | 4,579,875 | 0.33 |
| | | | 6,584,103 | 0.48 |
| <i>Honduras</i> | | | | |
| Honduras Government Bond, Reg. S 6.25% 19/01/2027 | USD | 11,017,000 | 12,790,737 | 0.94 |
| | | | 12,790,737 | 0.94 |
| <i>Hong Kong</i> | | | | |
| Kasikornbank PCL, Reg. S, FRN 3.343% 02/10/2031 | USD | 3,896,000 | 4,008,166 | 0.30 |
| Melco Resorts Finance Ltd., 144A 5.75% 21/07/2028 | USD | 1,290,000 | 1,376,107 | 0.10 |
| | | | 5,384,273 | 0.40 |
| <i>India</i> | | | | |
| National Highways Authority of India 7.27% 06/06/2022 | INR | 20,000,000 | 286,609 | 0.02 |
| Power Finance Corp. Ltd., 144A 3.95% 23/04/2030 | USD | 2,000,000 | 2,140,700 | 0.16 |
| | | | 2,427,309 | 0.18 |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|--|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| <i>Indonesia</i> | | | | |
| Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, Reg. S 6.53% 15/11/2028 | USD | 315,000 | 395,409 | 0.03 |
| Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, Reg. S 5.45% 15/05/2030 | USD | 3,430,000 | 4,131,084 | 0.30 |
| Indonesia Government Bond 4.2% 15/10/2050 | USD | 1,845,000 | 2,209,913 | 0.16 |
| Indonesia Treasury 8.25% 15/05/2029 | IDR | 37,500,000,000 | 3,080,323 | 0.23 |
| Indonesia Treasury 7% 15/09/2030 | IDR | 25,000,000,000 | 1,929,715 | 0.14 |
| Indonesia Treasury 8.75% 15/05/2031 | IDR | 61,026,000,000 | 5,170,475 | 0.38 |
| Indonesia Treasury 7.5% 15/08/2032 | IDR | 27,608,000,000 | 2,143,435 | 0.16 |
| Indonesia Treasury 8.375% 15/03/2034 | IDR | 146,514,000,000 | 12,182,687 | 0.90 |
| Indonesia Treasury 7.5% 15/06/2035 | IDR | 139,949,000,000 | 11,081,371 | 0.82 |
| | | | 42,324,412 | 3.12 |
| <i>Iraq</i> | | | | |
| Iraq Government Bond, Reg. S 6.752% 09/03/2023 | USD | 615,000 | 602,496 | 0.04 |
| | | | 602,496 | 0.04 |
| <i>Ivory Coast</i> | | | | |
| Ivory Coast Government Bond, 144A 5.875% 17/10/2031 | EUR | 1,810,000 | 2,450,583 | 0.18 |
| Ivory Coast Government Bond, 144A 4.875% 30/01/2032 | EUR | 3,540,000 | 4,458,186 | 0.33 |
| Ivory Coast Government Bond, Reg. S 5.25% 22/03/2030 | EUR | 1,900,000 | 2,496,295 | 0.18 |
| Ivory Coast Government Bond, STEP, Reg. S 5.75% 31/12/2032 | USD | 2,567,950 | 2,598,544 | 0.19 |
| | | | 12,003,608 | 0.88 |
| <i>Jordan</i> | | | | |
| Jordan Government Bond, Reg. S 6.125% 29/01/2026 | USD | 1,130,000 | 1,260,013 | 0.09 |
| Jordan Government Bond, Reg. S 5.75% 31/01/2027 | USD | 405,000 | 447,556 | 0.04 |
| | | | 1,707,569 | 0.13 |
| <i>Kazakhstan</i> | | | | |
| Kazakhstan Government Bond, Reg. S 6.5% 21/07/2045 | USD | 1,610,000 | 2,603,652 | 0.19 |
| KazMunayGas National Co. JSC, Reg. S 4.75% 19/04/2027 | USD | 2,401,000 | 2,791,342 | 0.21 |
| | | | 5,394,994 | 0.40 |
| <i>Kenya</i> | | | | |
| Kenya Government Bond, Reg. S 7.25% 28/02/2028 | USD | 3,000,000 | 3,373,236 | 0.25 |
| Kenya Government Bond, Reg. S 6.875% 24/06/2024 | USD | 1,790,000 | 1,965,438 | 0.14 |
| | | | 5,338,674 | 0.39 |
| <i>Malaysia</i> | | | | |
| Petronas Capital Ltd., Reg. S 3.5% 21/04/2030 | USD | 1,655,000 | 1,905,657 | 0.14 |
| | | | 1,905,657 | 0.14 |
| <i>Mexico</i> | | | | |
| America Movil SAB de CV 6.45% 05/12/2022 | MXN | 11,000,000 | 563,806 | 0.04 |
| Banco Nacional de Comercio Exterior SNC, Reg. S, FRN 3.8% 11/08/2026 | USD | 2,500,000 | 2,515,175 | 0.18 |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|--|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| Braskem Idesa SAPI, Reg. S 7.45% 15/11/2029 | USD | 2,600,000 | 2,444,000 | 0.18 |
| Comision Federal de Electricidad 7.35% 25/11/2025 | MXN | 35,460,000 | 1,748,454 | 0.13 |
| Grupo Televisa SAB 7.25% 14/05/2043 | MXN | 9,290,000 | 367,644 | 0.03 |
| Mexican Bonos 5.75% 05/03/2026 | MXN | 238,500,000 | 12,536,906 | 0.92 |
| Mexican Bonos 8% 07/11/2047 | MXN | 118,000,000 | 7,004,099 | 0.52 |
| Mexican Bonos 8.5% 31/05/2029 | MXN | 216,000,000 | 13,241,458 | 0.97 |
| Mexican Bonos 7.75% 13/11/2042 | MXN | 40,000,000 | 2,317,103 | 0.17 |
| Mexico City Airport Trust, 144A 5.5% 31/07/2047 | USD | 724,000 | 764,363 | 0.06 |
| Mexico City Airport Trust, Reg. S 4.25% 31/10/2026 | USD | 564,000 | 598,438 | 0.04 |
| Mexico City Airport Trust, Reg. S 3.875% 30/04/2028 | USD | 1,085,000 | 1,123,382 | 0.08 |
| Mexico City Airport Trust, Reg. S 5.5% 31/10/2046 | USD | 1,384,000 | 1,476,555 | 0.11 |
| Mexico City Airport Trust, Reg. S 5.5% 31/07/2047 | USD | 4,028,000 | 4,252,561 | 0.31 |
| Mexico Government Bond 3.25% 16/04/2030 | USD | 3,520,000 | 3,809,590 | 0.28 |
| Mexico Government Bond 4.75% 27/04/2032 | USD | 1,590,000 | 1,917,540 | 0.14 |
| Mexico Government Bond 5.75% 12/10/2110 | USD | 6,200,000 | 8,272,629 | 0.61 |
| Petroleos Mexicanos 5.375% 13/03/2022 | USD | 416,000 | 431,194 | 0.03 |
| Petroleos Mexicanos 4.875% 18/01/2024 | USD | 335,000 | 352,373 | 0.03 |
| Petroleos Mexicanos 7.47% 12/11/2026 | MXN | 114,930,000 | 4,824,525 | 0.36 |
| Petroleos Mexicanos, Reg. S 7.19% 12/09/2024 | MXN | 68,157,400 | 3,105,018 | 0.23 |
| | | | 73,666,813 | 5.42 |
| <i>Morocco</i> | | | | |
| Morocco Government Bond, 144A 4% 15/12/2050 | USD | 1,400,000 | 1,447,892 | 0.11 |
| Morocco Government Bond, Reg. S 5.5% 11/12/2042 | USD | 2,625,000 | 3,286,088 | 0.24 |
| | | | 4,733,980 | 0.35 |
| <i>Mozambique</i> | | | | |
| Mozambique Government Bond, Reg. S 5% 15/09/2031 | USD | 3,065,000 | 2,820,530 | 0.21 |
| | | | 2,820,530 | 0.21 |
| <i>Namibia</i> | | | | |
| Namibia Government Bond, Reg. S 5.5% 03/11/2021 | USD | 770,000 | 790,503 | 0.06 |
| | | | 790,503 | 0.06 |
| <i>Netherlands</i> | | | | |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 2.8% 21/07/2023 | USD | 1,247,000 | 1,236,825 | 0.09 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 6% 15/04/2024 | USD | 6,748,000 | 7,168,569 | 0.53 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026 | USD | 6,470,000 | 6,231,483 | 0.46 |
| Ziggo Bond Co. BV, 144A 5.125% 28/02/2030 | USD | 1,025,000 | 1,082,964 | 0.08 |
| | | | 15,719,841 | 1.16 |
| <i>Nigeria</i> | | | | |
| Nigeria Government Bond, Reg. S 6.75% 28/01/2021 | USD | 1,000,000 | 1,003,569 | 0.07 |
| | | | 1,003,569 | 0.07 |
| <i>Pakistan</i> | | | | |
| Pakistan Government Bond, Reg. S 8.25% 15/04/2024 | USD | 1,560,000 | 1,705,626 | 0.13 |
| | | | 1,705,626 | 0.13 |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|--|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| <i>Panama</i> | | | | |
| Panama Government Bond 3.75% 17/04/2026 | USD | 5,725,000 | 6,276,690 | 0.46 |
| Panama Government Bond 3.16% 23/01/2030 | USD | 4,400,000 | 4,881,250 | 0.36 |
| Panama Government Bond 4.5% 16/04/2050 | USD | 3,670,000 | 4,734,300 | 0.35 |
| Panama Government Bond 4.5% 01/04/2056 | USD | 2,850,000 | 3,683,625 | 0.27 |
| | | | 19,575,865 | 1.44 |
| <i>Paraguay</i> | | | | |
| Paraguay Government Bond, Reg. S 4.625% 25/01/2023 | USD | 5,155,000 | 5,554,512 | 0.41 |
| Paraguay Government Bond, Reg. S 5% 15/04/2026 | USD | 4,620,000 | 5,428,500 | 0.40 |
| Paraguay Government Bond, Reg. S 4.95% 28/04/2031 | USD | 405,000 | 491,569 | 0.03 |
| Paraguay Government Bond, Reg. S 5.6% 13/03/2048 | USD | 2,190,000 | 2,825,122 | 0.21 |
| Paraguay Government Bond, Reg. S 5.4% 30/03/2050 | USD | 940,000 | 1,193,800 | 0.09 |
| | | | 15,493,503 | 1.14 |
| <i>Peru</i> | | | | |
| Peru Government Bond 6.15% 12/08/2032 | PEN | 46,900,000 | 15,770,085 | 1.16 |
| Peru Government Bond, Reg. S 5.4% 12/08/2034 | PEN | 5,600,000 | 1,708,153 | 0.13 |
| | | | 17,478,238 | 1.29 |
| <i>Philippines</i> | | | | |
| Philippine Government Bond 2.95% 05/05/2045 | USD | 2,180,000 | 2,306,678 | 0.17 |
| | | | 2,306,678 | 0.17 |
| <i>Poland</i> | | | | |
| Poland Government Bond 5.75% 23/09/2022 | PLN | 25,000 | 7,354 | – |
| | | | 7,354 | – |
| <i>Qatar</i> | | | | |
| Qatar Government Bond, 144A 4.5% 23/04/2028 | USD | 5,800,000 | 7,037,575 | 0.52 |
| Qatar Government Bond, Reg. S 4.5% 23/04/2028 | USD | 2,800,000 | 3,397,450 | 0.25 |
| Qatar Government Bond, Reg. S 4% 14/03/2029 | USD | 10,700,000 | 12,706,250 | 0.94 |
| Qatar Government Bond, Reg. S 4.4% 16/04/2050 | USD | 980,000 | 1,279,782 | 0.09 |
| | | | 24,421,057 | 1.80 |
| <i>Romania</i> | | | | |
| Romania Government Bond, Reg. S 3.375% 08/02/2038 | EUR | 4,200,000 | 5,918,872 | 0.44 |
| Romania Government Bond, Reg. S 4.625% 03/04/2049 | EUR | 654,000 | 1,081,803 | 0.08 |
| Romania Government Bond, Reg. S 3.375% 28/01/2050 | EUR | 1,193,000 | 1,680,773 | 0.12 |
| | | | 8,681,448 | 0.64 |
| <i>Russian Federation</i> | | | | |
| Russian Federal Bond - OFZ 7% 25/01/2023 | RUB | 734,825,000 | 10,440,211 | 0.77 |
| Russian Federal Bond - OFZ 8.15% 03/02/2027 | RUB | 224,000,000 | 3,445,525 | 0.25 |
| Russian Federal Bond - OFZ 8.5% 17/09/2031 | RUB | 731,540,000 | 11,881,205 | 0.88 |
| Russian Federation 2.5% 02/02/2028 | RUB | 501,800,000 | 7,617,718 | 0.56 |
| Russian Foreign Bond - Eurobond, 144A 4.375% 21/03/2029 | USD | 4,200,000 | 4,908,553 | 0.36 |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|--|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| Russian Foreign Bond - Eurobond, 144A 5.1% 28/03/2035 | USD | 2,400,000 | 3,040,464 | 0.23 |
| Russian Foreign Bond - Eurobond, Reg. S 4.375% 21/03/2029 | USD | 6,200,000 | 7,245,959 | 0.53 |
| Russian Foreign Bond - Eurobond, Reg. S 5.1% 28/03/2035 | USD | 3,200,000 | 4,053,952 | 0.30 |
| | | | 52,633,587 | 3.88 |
| <i>Senegal</i> | | | | |
| Senegal Government Bond, Reg. S 4.75% 13/03/2028 | EUR | 3,500,000 | 4,570,312 | 0.34 |
| | | | 4,570,312 | 0.34 |
| <i>South Africa</i> | | | | |
| South Africa Government Bond 6.5% 28/02/2041 | ZAR | 172,510,000 | 7,695,311 | 0.57 |
| South Africa Government Bond 8.75% 28/02/2048 | ZAR | 141,650,000 | 7,941,890 | 0.58 |
| | | | 15,637,201 | 1.15 |
| <i>Sri Lanka</i> | | | | |
| Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.25% 27/07/2021 | USD | 5,975,000 | 5,200,520 | 0.38 |
| Sri Lanka Government Bond, Reg. S 5.75% 18/01/2022 | USD | 650,000 | 509,802 | 0.04 |
| Sri Lanka Government Bond, Reg. S 5.875% 25/07/2022 | USD | 1,650,000 | 1,149,753 | 0.08 |
| Sri Lanka Government Bond, Reg. S 5.75% 18/04/2023 | USD | 1,000,000 | 644,510 | 0.05 |
| | | | 7,504,585 | 0.55 |
| <i>Thailand</i> | | | | |
| Bangkok Bank PCL, Reg. S 4.05% 19/03/2024 | USD | 1,500,000 | 1,630,691 | 0.12 |
| Bangkok Bank PCL, Reg. S 4.45% 19/09/2028 | USD | 1,500,000 | 1,740,476 | 0.13 |
| | | | 3,371,167 | 0.25 |
| <i>Tunisia</i> | | | | |
| Banque Centrale de Tunisie International Bond, 144A 6.375% 15/07/2026 | EUR | 2,900,000 | 3,261,134 | 0.24 |
| Banque Centrale de Tunisie International Bond, Reg. S 6.75% 31/10/2023 | EUR | 2,050,000 | 2,394,440 | 0.18 |
| Banque Centrale de Tunisie International Bond, Reg. S 5.625% 17/02/2024 | EUR | 1,500,000 | 1,700,681 | 0.12 |
| | | | 7,356,255 | 0.54 |
| <i>Turkey</i> | | | | |
| Turkey Government Bond 7.375% 05/02/2025 | USD | 770,000 | 860,920 | 0.06 |
| Turkey Government Bond 6.375% 14/10/2025 | USD | 2,810,000 | 3,042,710 | 0.22 |
| Turkey Government Bond 4.25% 14/04/2026 | USD | 12,250,000 | 12,174,577 | 0.90 |
| Turkey Government Bond 5.125% 17/02/2028 | USD | 930,000 | 943,903 | 0.07 |
| | | | 17,022,110 | 1.25 |
| <i>Ukraine</i> | | | | |
| Ukraine Government Bond, 144A 7.253% 15/03/2033 | USD | 3,200,000 | 3,503,808 | 0.26 |
| Ukraine Government Bond, 144A 6.75% 20/06/2026 | EUR | 425,000 | 573,471 | 0.04 |
| Ukraine Government Bond 17% 11/05/2022 | UAH | 103,453,000 | 3,918,547 | 0.29 |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|--|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| Ukraine Government Bond 14.91% 12/10/2022 | UAH | 16,226,000 | 605,653 | 0.04 |
| Ukraine Government Bond 10% 23/08/2023 | UAH | 50,800,000 | 1,735,010 | 0.13 |
| Ukraine Government Bond 15.84% 26/02/2025 | UAH | 42,021,000 | 1,667,562 | 0.12 |
| Ukraine Government Bond, Reg. S 7.75% 01/09/2025 | USD | 1,500,000 | 1,685,587 | 0.12 |
| Ukraine Government Bond, Reg. S, FRN 0% 31/05/2040 | USD | 2,700,000 | 2,791,517 | 0.21 |
| | | | 16,481,155 | 1.21 |
| <i>United Arab Emirates</i> | | | | |
| Abu Dhabi Government Bond, 144A 1.7% 02/03/2031 | USD | 4,035,000 | 4,042,077 | 0.30 |
| Abu Dhabi Government Bond, Reg. S 2.5% 30/09/2029 | USD | 13,000,000 | 14,058,395 | 1.03 |
| Abu Dhabi Government Bond, Reg. S 3.125% 16/04/2030 | USD | 315,000 | 356,344 | 0.03 |
| Abu Dhabi Government Bond, Reg. S 3.875% 16/04/2050 | USD | 2,100,000 | 2,566,200 | 0.19 |
| DP World Crescent Ltd., Reg. S 4.848% 26/09/2028 | USD | 2,670,000 | 3,109,549 | 0.23 |
| | | | 24,132,565 | 1.78 |
| <i>United Kingdom</i> | | | | |
| Rolls-Royce plc, 144A 5.75% 15/10/2027 | USD | 725,000 | 803,844 | 0.06 |
| Vmed O2 UK Financing I plc, 144A 4.25% 31/01/2031 | USD | 2,050,000 | 2,099,487 | 0.15 |
| | | | 2,903,331 | 0.21 |
| <i>United States of America</i> | | | | |
| Apache Corp. 4.875% 15/11/2027 | USD | 1,545,000 | 1,640,017 | 0.12 |
| B&G Foods, Inc. 5.25% 01/04/2025 | USD | 1,145,000 | 1,183,358 | 0.09 |
| Boeing Co. (The) 3.625% 01/02/2031 | USD | 2,275,000 | 2,496,453 | 0.18 |
| Boeing Co. (The) 3.5% 01/03/2039 | USD | 160,000 | 162,068 | 0.01 |
| Boeing Co. (The) 3.75% 01/02/2050 | USD | 850,000 | 893,893 | 0.07 |
| Centene Corp. 3% 15/10/2030 | USD | 3,670,000 | 3,894,421 | 0.29 |
| Centene Corp. 4.75% 15/01/2025 | USD | 3,350,000 | 3,442,058 | 0.25 |
| CenturyLink, Inc. 7.5% 01/04/2024 | USD | 1,150,000 | 1,303,812 | 0.10 |
| CenturyLink, Inc. 6.75% 01/12/2023 | USD | 1,650,000 | 1,840,781 | 0.14 |
| Cleveland-Cliffs, Inc. 5.75% 01/03/2025 | USD | 6,350,000 | 6,457,156 | 0.48 |
| DCP Midstream Operating LP 4.95% 01/04/2022 | USD | 1,515,000 | 1,565,775 | 0.11 |
| Diebold Nixdorf, Inc. 8.5% 15/04/2024 | USD | 875,000 | 887,031 | 0.07 |
| Embarq Corp. 7.995% 01/06/2036 | USD | 1,580,000 | 1,951,813 | 0.14 |
| Encompass Health Corp. 4.5% 01/02/2028 | USD | 1,150,000 | 1,203,694 | 0.09 |
| Encompass Health Corp. 5.75% 15/09/2025 | USD | 1,080,000 | 1,117,800 | 0.08 |
| Energy Transfer Operating LP 5% 15/05/2050 | USD | 3,448,000 | 3,736,910 | 0.27 |
| EQM Midstream Partners LP 4.125% 01/12/2026 | USD | 380,000 | 383,445 | 0.03 |
| EQM Midstream Partners LP 5.5% 15/07/2028 | USD | 1,290,000 | 1,412,524 | 0.10 |
| EQT Corp. 7.875% 01/02/2025 | USD | 881,000 | 1,004,468 | 0.07 |
| EQT Corp. 5% 15/01/2029 | USD | 325,000 | 343,466 | 0.03 |
| EQT Corp. 3.9% 01/10/2027 | USD | 300,000 | 298,598 | 0.02 |
| EQT Corp. 8.75% 01/02/2030 | USD | 1,690,000 | 2,068,138 | 0.15 |
| FirstEnergy Corp. 3.4% 01/03/2050 | USD | 1,450,000 | 1,393,975 | 0.10 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 5.125% 16/06/2025 | USD | 9,045,000 | 9,845,935 | 0.72 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 3.375% 13/11/2025 | USD | 3,600,000 | 3,691,116 | 0.27 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 4.542% 01/08/2026 | USD | 2,250,000 | 2,404,688 | 0.18 |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|--|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| Ford Motor Credit Co. LLC 3.815% 02/11/2027 | USD | 250,000 | 257,344 | 0.02 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 3.087% 09/01/2023 | USD | 205,000 | 208,961 | 0.02 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 3.81% 09/01/2024 | USD | 995,000 | 1,021,119 | 0.07 |
| Freeport-McMoRan, Inc. 3.875% 15/03/2023 | USD | 475,000 | 496,518 | 0.04 |
| Freeport-McMoRan, Inc. 4.25% 01/03/2030 | USD | 2,500,000 | 2,696,100 | 0.20 |
| Genesis Energy LP 5.625% 15/06/2024 | USD | 310,000 | 302,056 | 0.02 |
| Genesis Energy LP 8% 15/01/2027 | USD | 605,000 | 603,488 | 0.04 |
| Genesis Energy LP 6.5% 01/10/2025 | USD | 4,075,000 | 3,970,578 | 0.29 |
| HCA, Inc. 3.5% 01/09/2030 | USD | 1,375,000 | 1,461,426 | 0.11 |
| HCA, Inc. 5.875% 01/05/2023 | USD | 850,000 | 935,174 | 0.07 |
| HCA, Inc. 5.375% 01/02/2025 | USD | 305,000 | 343,435 | 0.03 |
| Howmet Aerospace, Inc. 6.875% 01/05/2025 | USD | 1,140,000 | 1,346,625 | 0.10 |
| MGIC Investment Corp. 5.25% 15/08/2028 | USD | 1,100,000 | 1,179,062 | 0.09 |
| MGM Resorts International 7.75% 15/03/2022 | USD | 3,650,000 | 3,894,094 | 0.29 |
| Molina Healthcare, Inc. 5.375% 15/11/2022 | USD | 4,125,000 | 4,375,078 | 0.32 |
| NGL Energy Partners LP 7.5% 01/11/2023 | USD | 2,005,000 | 1,423,550 | 0.10 |
| NGL Energy Partners LP 6.125% 01/03/2025 | USD | 4,205,000 | 2,675,431 | 0.20 |
| Occidental Petroleum Corp. 5.5% 01/12/2025 | USD | 1,670,000 | 1,744,290 | 0.13 |
| Occidental Petroleum Corp. 6.375% 01/09/2028 | USD | 1,225,000 | 1,297,734 | 0.10 |
| Occidental Petroleum Corp. 2.9% 15/08/2024 | USD | 1,764,000 | 1,700,496 | 0.12 |
| OneMain Finance Corp. 6.125% 15/03/2024 | USD | 5,000,000 | 5,468,750 | 0.40 |
| Ovintiv, Inc. 6.5% 15/08/2034 | USD | 1,175,000 | 1,361,123 | 0.10 |
| Owens & Minor, Inc. 4.375% 15/12/2024 | USD | 5,150,000 | 5,294,844 | 0.39 |
| Owl Rock Capital Corp. 3.4% 15/07/2026 | USD | 1,870,000 | 1,896,790 | 0.14 |
| Owl Rock Capital Corp. 3.75% 22/07/2025 | USD | 1,450,000 | 1,505,917 | 0.11 |
| PG&E Corp. 5% 01/07/2028 | USD | 2,550,000 | 2,719,129 | 0.20 |
| RR Donnelley & Sons Co. 6.5% 15/11/2023 | USD | 950,000 | 981,963 | 0.07 |
| Sally Holdings LLC 5.625% 01/12/2025 | USD | 2,615,000 | 2,690,835 | 0.20 |
| Southwestern Energy Co. 8.375% 15/09/2028 | USD | 375,000 | 407,578 | 0.03 |
| Southwestern Energy Co. 6.45% 23/01/2025 | USD | 1,155,000 | 1,200,478 | 0.09 |
| Southwestern Energy Co. 7.5% 01/04/2026 | USD | 265,000 | 278,383 | 0.02 |
| Starwood Property Trust, Inc., REIT 5% 15/12/2021 | USD | 2,525,000 | 2,573,657 | 0.19 |
| Targa Resources Partners LP 5.875% 15/04/2026 | USD | 850,000 | 902,781 | 0.07 |
| Tenet Healthcare Corp. 4.625% 15/07/2024 | USD | 1,403,000 | 1,439,506 | 0.11 |
| TransDigm, Inc. 5.5% 15/11/2027 | USD | 725,000 | 763,280 | 0.06 |
| TransDigm, Inc. 6.5% 15/07/2024 | USD | 1,140,000 | 1,162,338 | 0.09 |
| TreeHouse Foods, Inc. 4% 01/09/2028 | USD | 310,000 | 321,237 | 0.02 |
| Triumph Group, Inc. 5.25% 01/06/2022 | USD | 485,000 | 463,175 | 0.03 |
| Triumph Group, Inc. 7.75% 15/08/2025 | USD | 560,000 | 513,800 | 0.04 |
| United Rentals North America, Inc. 3.875% 15/02/2031 | USD | 625,000 | 656,828 | 0.05 |
| Vertical US Newco, Inc., 144A 5.25% 15/07/2027 | USD | 1,325,000 | 1,406,984 | 0.10 |
| Xerox Corp. 4.375% 15/03/2023 | USD | 445,000 | 468,084 | 0.03 |
| | | | 123,033,412 | 9.06 |
| Venezuela | | | | |
| Venezuela Government Bond, Reg. S 7% 01/12/2018 [§] | USD | 159,000 | 15,423 | — |
| Venezuela Government Bond, Reg. S 7.75% 13/10/2019 [§] | USD | 2,851,000 | 276,547 | 0.02 |
| Venezuela Government Bond, Reg. S 6% 09/12/2020 [§] | USD | 2,348,000 | 227,756 | 0.02 |
| Venezuela Government Bond, Reg. S 9% 07/05/2023 [§] | USD | 3,429,000 | 332,613 | 0.03 |
| Venezuela Government Bond 9.25% 15/09/2027 [§] | USD | 422,000 | 41,145 | — |

[§] Security is currently in default.

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|--|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| Venezuela Government Bond, Reg. S 12.75% 23/08/2022 [§] | USD | 213,000 | 20,661 | – |
| Venezuela Government Bond, Reg. S 8.25% 13/10/2024 [§] | USD | 739,000 | 71,683 | 0.01 |
| Venezuela Government Bond, Reg. S 7.65% 21/04/2025 [§] | USD | 315,000 | 30,555 | – |
| Venezuela Government Bond, Reg. S 11.75% 21/10/2026 [§] | USD | 158,000 | 15,326 | – |
| Venezuela Government Bond, Reg. S 9.25% 07/05/2028 [§] | USD | 789,000 | 76,533 | 0.01 |
| Venezuela Government Bond, Reg. S 11.95% 05/08/2031 [§] | USD | 264,000 | 25,608 | – |
| Venezuela Government Bond, Reg. S 7% 31/03/2038 [§] | USD | 263,000 | 25,511 | – |
| | | | 1,159,361 | 0.09 |
| Total Bonds | | | 757,585,115 | 55.77 |
| Equities | | | | |
| <i>United States of America</i> | | | | |
| Mcdermott International Ltd. | USD | 24,370 | 19,740 | – |
| Weatherford International plc | USD | 110,121 | 660,726 | 0.05 |
| | | | 680,466 | 0.05 |
| Total Equities | | | 680,466 | 0.05 |
| Total Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing | | | 758,265,581 | 55.82 |
| Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market | | | | |
| Bonds | | | | |
| <i>Argentina</i> | | | | |
| Argentina Government Bond, FRN 0% 15/12/2035 | USD | 17,350,000 | 43,375 | – |
| | | | 43,375 | – |
| <i>Brazil</i> | | | | |
| Braskem Finance Ltd. 6.45% 03/02/2024 | USD | 530,000 | 581,018 | 0.04 |
| Braskem Netherlands Finance BV, Reg. S 4.5% 31/01/2030 | USD | 2,620,000 | 2,695,325 | 0.20 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional 2.021% 15/05/2023 | BRL | 371,500 | 2,748,257 | 0.20 |
| BRAZIL NTN-B, FRN 1.977% 15/08/2024 | BRL | 501,800 | 3,816,849 | 0.28 |
| Constellation Oil Services Holding SA, 144A 10.167% 09/11/2024 | USD | 1,128,454 | 321,609 | 0.03 |
| | | | 10,163,058 | 0.75 |
| <i>Canada</i> | | | | |
| Bausch Health Cos., Inc., 144A 5% 30/01/2028 | USD | 4,060,000 | 4,189,067 | 0.31 |
| Bausch Health Cos., Inc., 144A 6.125% 15/04/2025 | USD | 7,550,000 | 7,789,033 | 0.57 |
| Bombardier, Inc., 144A 8.75% 01/12/2021 | USD | 820,000 | 854,165 | 0.06 |
| Bombardier, Inc., 144A 7.875% 15/04/2027 | USD | 2,405,000 | 2,214,933 | 0.16 |
| First Quantum Minerals Ltd., 144A 7.25% 01/04/2023 | USD | 1,700,000 | 1,754,740 | 0.13 |
| First Quantum Minerals Ltd., 144A 6.5% 01/03/2024 | USD | 1,627,000 | 1,674,793 | 0.12 |

§ Security is currently in default.

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|---|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| First Quantum Minerals Ltd., 144A 6.875% 01/03/2026 | USD | 2,425,000 | 2,532,609 | 0.19 |
| First Quantum Minerals Ltd., 144A 7.5% 01/04/2025 | USD | 10,275,000 | 10,711,688 | 0.79 |
| Methanex Corp. 5.125% 15/10/2027 | USD | 2,990,000 | 3,253,509 | 0.24 |
| Teekay Corp., 144A 9.25% 15/11/2022 | USD | 3,295,000 | 3,369,138 | 0.25 |
| | | | 38,343,675 | 2.82 |
| <i>Chile</i> | | | | |
| Colbun SA, Reg. S 3.95% 11/10/2027 | USD | 2,450,000 | 2,760,562 | 0.20 |
| | | | 2,760,562 | 0.20 |
| <i>Colombia</i> | | | | |
| Empresas Publicas de Medellin ESP, Reg. S 4.25% 18/07/2029 | USD | 3,400,000 | 3,661,630 | 0.27 |
| | | | 3,661,630 | 0.27 |
| <i>Italy</i> | | | | |
| International Game Technology plc, 144A 6.25% 15/02/2022 | USD | 227,000 | 234,801 | 0.02 |
| International Game Technology plc, 144A 6.5% 15/02/2025 | USD | 3,260,000 | 3,652,895 | 0.27 |
| | | | 3,887,696 | 0.29 |
| <i>Luxembourg</i> | | | | |
| Intelsat Jackson Holdings SA, 144A 8.5% 15/10/2024 [§] | USD | 4,475,000 | 3,210,365 | 0.24 |
| Intelsat Jackson Holdings SA 8% 15/02/2024 | USD | 5,350,000 | 5,485,944 | 0.40 |
| Rede D'or Finance Sarl, Reg. S 4.95% 17/01/2028 | USD | 320,000 | 343,144 | 0.02 |
| Venator Finance Sarl, 144A 5.75% 15/07/2025 | USD | 5,055,000 | 4,735,903 | 0.35 |
| | | | 13,775,356 | 1.01 |
| <i>Malaysia</i> | | | | |
| Malaysia Government Bond 3.885% 15/08/2029 | MYR | 12,500,000 | 3,420,151 | 0.25 |
| Malaysia Government Bond 4.893% 08/06/2038 | MYR | 43,000,000 | 12,619,748 | 0.93 |
| Malaysia Government Bond 4.467% 15/09/2039 | MYR | 21,000,000 | 5,885,696 | 0.44 |
| Malaysia Government Bond 4.921% 06/07/2048 | MYR | 2,000,000 | 587,898 | 0.04 |
| | | | 22,513,493 | 1.66 |
| <i>Mexico</i> | | | | |
| Petroleos Mexicanos 4.875% 24/01/2022 | USD | 775,000 | 799,657 | 0.06 |
| Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027 | USD | 4,000,000 | 4,230,000 | 0.31 |
| Petroleos Mexicanos 6.875% 04/08/2026 | USD | 1,040,000 | 1,137,760 | 0.08 |
| | | | 6,167,417 | 0.45 |
| <i>Netherlands</i> | | | | |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 7.125% 31/01/2025 | USD | 1,490,000 | 1,649,847 | 0.12 |
| Ziggo BV, 144A 5.5% 15/01/2027 | USD | 3,178,000 | 3,322,901 | 0.25 |
| | | | 4,972,748 | 0.37 |
| <i>Paraguay</i> | | | | |
| Rutas 2 and 7 Finance Ltd., 144A 0% 30/09/2036 | USD | 3,380,000 | 2,551,900 | 0.19 |
| | | | 2,551,900 | 0.19 |

§ Security is currently in default.

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|---|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| <i>Peru</i> | | | | |
| Lima Metro Line 2 Finance Ltd., 144A 4.35% 05/04/2036 | USD | 1,835,000 | 2,038,547 | 0.15 |
| | | | 2,038,547 | 0.15 |
| <i>Thailand</i> | | | | |
| Bangkok Bank PCL, Reg. S, FRN 3.733% 25/09/2034 | USD | 2,204,000 | 2,299,089 | 0.17 |
| | | | 2,299,089 | 0.17 |
| <i>United States of America</i> | | | | |
| Advisor Group Holdings, Inc., 144A 10.75% 01/08/2027 | USD | 2,285,000 | 2,531,631 | 0.19 |
| Altera Infrastructure LP, 144A 8.5% 15/07/2023 | USD | 2,275,000 | 1,939,199 | 0.14 |
| Apache Corp. 4.375% 15/10/2028 | USD | 1,203,000 | 1,254,103 | 0.09 |
| Avis Budget Car Rental LLC, 144A 5.25% 15/03/2025 | USD | 2,050,000 | 2,064,094 | 0.15 |
| Brink's Co. (The), 144A 4.625% 15/10/2027 | USD | 1,490,000 | 1,559,844 | 0.11 |
| Brookfield Property REIT, Inc., 144A 5.75% 15/05/2026 | USD | 6,755,000 | 6,676,980 | 0.49 |
| CCO Holdings LLC, 144A 5.75% 15/02/2026 | USD | 2,405,000 | 2,484,605 | 0.18 |
| CCO Holdings LLC, 144A 4.75% 01/03/2030 | USD | 1,875,000 | 2,025,469 | 0.15 |
| Centene Corp. 4.625% 15/12/2029 | USD | 2,115,000 | 2,350,833 | 0.17 |
| CenturyLink, Inc., 144A 5.125% 15/12/2026 | USD | 1,625,000 | 1,718,299 | 0.13 |
| Cheniere Energy Partners LP 5.625% 01/10/2026 | USD | 1,675,000 | 1,749,035 | 0.13 |
| Chesapeake Energy Corp., Reg. S 11.5% 01/01/2025 [†] | USD | 2,145,000 | 378,592 | 0.03 |
| Chesapeake Energy Corp. 4.875% 15/04/2022 [†] | USD | 2,110,000 | 105,500 | 0.01 |
| Clarios Global LP, 144A 6.25% 15/05/2026 | USD | 795,000 | 853,631 | 0.06 |
| Cleveland-Cliffs, Inc. 5.875% 01/06/2027 | USD | 4,625,000 | 4,721,524 | 0.35 |
| Cleveland-Cliffs, Inc., 144A 4.875% 15/01/2024 | USD | 2,925,000 | 2,985,328 | 0.22 |
| CNX Resources Corp., 144A 7.25% 14/03/2027 | USD | 1,150,000 | 1,231,961 | 0.09 |
| CommScope, Inc., 144A 6% 01/03/2026 | USD | 3,075,000 | 3,243,864 | 0.24 |
| Compass Group Diversified Holdings LLC, 144A 8% 01/05/2026 | USD | 2,305,000 | 2,428,456 | 0.18 |
| Comstock Resources, Inc. 9.75% 15/08/2026 | USD | 567,000 | 608,958 | 0.04 |
| CVR Partners LP, 144A 9.25% 15/06/2023 | USD | 2,850,000 | 2,856,526 | 0.21 |
| Diamond Offshore Drilling, Inc. 4.875% 01/11/2043 [†] | USD | 1,615,000 | 204,774 | 0.02 |
| Dun & Bradstreet Corp. (The), 144A 6.875% 15/08/2026 | USD | 1,409,000 | 1,517,317 | 0.11 |
| Endo Finance LLC, 144A 5.75% 15/01/2022 | USD | 3,115,000 | 3,025,444 | 0.22 |
| Extraction Oil & Gas, Inc. 0% 31/03/2021 | USD | 364,975 | 364,975 | 0.03 |
| Extraction Oil & Gas, Inc., 144A 5.625% 01/02/2026 [†] | USD | 1,925,000 | 353,353 | 0.03 |
| Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC, 144A 6.5% 01/10/2025 | USD | 1,060,000 | 1,111,680 | 0.08 |
| FS Energy and Power Fund, 144A 7.5% 15/08/2023 | USD | 1,505,000 | 1,448,721 | 0.11 |
| FXI Holdings, Inc., 144A 7.875% 01/11/2024 | USD | 2,216,000 | 2,238,160 | 0.16 |
| FXI Holdings, Inc., 144A 12.25% 15/11/2026 | USD | 2,491,000 | 2,844,012 | 0.21 |
| Gogo Intermediate Holdings LLC, 144A 9.875% 01/05/2024 | USD | 15,290,000 | 16,400,283 | 1.21 |
| Hanesbrands, Inc., 144A 4.625% 15/05/2024 | USD | 675,000 | 708,328 | 0.05 |
| Hanesbrands, Inc., 144A 4.875% 15/05/2026 | USD | 2,055,000 | 2,234,813 | 0.16 |
| Hess Midstream Operations LP, 144A 5.125% 15/06/2028 | USD | 1,455,000 | 1,522,294 | 0.11 |

[†] Security is currently in default.

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|--|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| Hexion, Inc., 144A 7.875% 15/07/2027 | USD | 2,040,000 | 2,186,625 | 0.16 |
| Hilcorp Energy I LP, 144A 5.75% 01/10/2025 | USD | 1,725,000 | 1,750,694 | 0.13 |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc. 5.125% 01/05/2026 | USD | 1,625,000 | 1,681,875 | 0.12 |
| Icahn Enterprises LP 4.75% 15/09/2024 | USD | 1,945,000 | 2,023,413 | 0.15 |
| Icahn Enterprises LP 5.25% 15/05/2027 | USD | 785,000 | 843,483 | 0.06 |
| Icahn Enterprises LP 6.25% 01/02/2022 | USD | 3,220,000 | 3,235,215 | 0.24 |
| iHeartCommunications, Inc., 144A 5.25% 15/08/2027 | USD | 1,250,000 | 1,311,487 | 0.10 |
| Jonah Energy LLC, 144A 7.25% 15/10/2025 | USD | 700,000 | 5,250 | - |
| Kraft Heinz Foods Co., 144A 4.875% 01/10/2049 | USD | 1,130,000 | 1,318,340 | 0.10 |
| Kraft Heinz Foods Co. 4.375% 01/06/2046 | USD | 550,000 | 595,094 | 0.04 |
| Kraft Heinz Foods Co. 3.95% 15/07/2025 | USD | 1,275,000 | 1,404,686 | 0.10 |
| Ladder Capital Finance Holdings LLLP, 144A 5.25% 15/03/2022 | USD | 325,000 | 327,234 | 0.02 |
| Ladder Capital Finance Holdings LLLP, 144A 5.25% 01/10/2025 | USD | 300,000 | 299,813 | 0.02 |
| Live Nation Entertainment, Inc., 144A 3.75% 15/01/2028 | USD | 600,000 | 607,740 | 0.04 |
| LPL Holdings, Inc., 144A 4.625% 15/11/2027 | USD | 1,105,000 | 1,147,128 | 0.08 |
| LSB Industries, Inc., 144A 9.625% 01/05/2023 | USD | 4,925,000 | 5,090,702 | 0.37 |
| Mattel, Inc., 144A 6.75% 31/12/2025 | USD | 2,150,000 | 2,271,410 | 0.17 |
| MDC Partners, Inc., 144A 6.5% 01/05/2024 | USD | 2,000,000 | 2,030,520 | 0.15 |
| Navient Corp. 6.5% 15/06/2022 | USD | 1,195,000 | 1,267,584 | 0.09 |
| Navient Corp. 5.5% 25/01/2023 | USD | 6,265,000 | 6,566,503 | 0.48 |
| Navient Corp. 6.125% 25/03/2024 | USD | 7,990,000 | 8,554,214 | 0.63 |
| Navient Corp. 5.875% 25/10/2024 | USD | 160,000 | 170,400 | 0.01 |
| Navient Corp. 7.25% 25/09/2023 | USD | 60,000 | 65,871 | 0.01 |
| Nielsen Co. Luxembourg SARL (The), 144A 5% 01/02/2025 | USD | 1,100,000 | 1,130,937 | 0.08 |
| Owl Rock Capital Corp. II, 144A 4.625% 26/11/2024 | USD | 1,100,000 | 1,127,643 | 0.08 |
| Par Pharmaceutical, Inc., 144A 7.5% 01/04/2027 | USD | 3,350,000 | 3,639,138 | 0.27 |
| Par Pharmaceutical, Inc., Reg. S 7.5% 01/04/2027 | USD | 1,325,000 | 1,439,361 | 0.11 |
| Parsley Energy LLC, 144A 5.25% 15/08/2025 | USD | 220,000 | 229,680 | 0.02 |
| Peabody Energy Corp., 144A 6% 31/03/2022 | USD | 1,780,000 | 1,302,738 | 0.10 |
| PetSmart, Inc., 144A 8.875% 01/06/2025 | USD | 3,420,000 | 3,516,957 | 0.26 |
| Rockies Express Pipeline LLC, 144A 4.95% 15/07/2029 | USD | 1,475,000 | 1,536,943 | 0.11 |
| Sabre Global, Inc., 144A 5.25% 15/11/2023 | USD | 200,000 | 203,000 | 0.02 |
| Scientific Games International, Inc., 144A 5% 15/10/2025 | USD | 1,295,000 | 1,337,916 | 0.10 |
| Scientific Games International, Inc., 144A 8.25% 15/03/2026 | USD | 3,220,000 | 3,475,362 | 0.26 |
| Scientific Games International, Inc., 144A 7.25% 15/11/2029 | USD | 2,465,000 | 2,709,503 | 0.20 |
| Sirius XM Radio, Inc., 144A 4.625% 15/07/2024 | USD | 2,435,000 | 2,526,312 | 0.19 |
| Sirius XM Radio, Inc., 144A 3.875% 01/08/2022 | USD | 1,725,000 | 1,753,031 | 0.13 |
| Springleaf Funding Trust 'A1', 144A 5.875% 15/10/2027 | USD | 875,000 | 947,734 | 0.07 |
| Sprint Capital Corp. 6.875% 15/11/2028 | USD | 4,300,000 | 5,677,527 | 0.42 |
| Sprint Corp. 7.625% 01/03/2026 | USD | 2,375,000 | 2,951,436 | 0.22 |
| Staples, Inc., 144A 7.5% 15/04/2026 | USD | 1,995,000 | 2,086,650 | 0.15 |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|--|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| Talen Energy Supply LLC, 144A 10.5% 15/01/2026 | USD | 130,000 | 115,964 | 0.01 |
| Talen Energy Supply LLC, 144A 7.25% 15/05/2027 | USD | 2,690,000 | 2,869,396 | 0.21 |
| Targa Resources Partners LP 5.5% 01/03/2030 | USD | 1,120,000 | 1,217,037 | 0.09 |
| Team Health Holdings, Inc., 144A 6.375% 01/02/2025 | USD | 5,700,000 | 4,930,500 | 0.36 |
| Tenet Healthcare Corp., 144A 4.875% 01/01/2026 | USD | 8,775,000 | 9,190,496 | 0.68 |
| Trilogy International Partners LLC, 144A 8.875% 01/05/2022 | USD | 9,900,000 | 9,575,924 | 0.71 |
| Triumph Group, Inc., 144A 6.25% 15/09/2024 | USD | 670,000 | 665,813 | 0.05 |
| Tronox, Inc., 144A 6.5% 15/04/2026 | USD | 1,930,000 | 2,012,025 | 0.15 |
| Uniti Group LP, REIT, 144A 6% 15/04/2023 | USD | 2,025,000 | 2,069,297 | 0.15 |
| UPC Holding BV, 144A 5.5% 15/01/2028 | USD | 575,000 | 607,703 | 0.04 |
| Valvoline, Inc. 4.375% 15/08/2025 | USD | 605,000 | 625,128 | 0.05 |
| ViaSat, Inc., 144A 5.625% 15/04/2027 | USD | 350,000 | 368,156 | 0.03 |
| VICI Properties LP, REIT, 144A 4.625% 01/12/2029 | USD | 1,365,000 | 1,462,857 | 0.11 |
| Warrior Met Coal, Inc., 144A 8% 01/11/2024 | USD | 3,399,000 | 3,478,129 | 0.26 |
| Weatherford International Ltd. 8.75% 01/09/2024 | USD | 3,586,589 | 3,600,039 | 0.27 |
| Weatherford International Ltd., 144A 11% 01/12/2024 | USD | 3,349,000 | 2,620,593 | 0.19 |
| Western Midstream Operating LP 4.5% 01/03/2028 | USD | 2,900,000 | 3,016,000 | 0.22 |
| Wolverine Escrow LLC, 144A 9% 15/11/2026 | USD | 535,000 | 507,407 | 0.04 |
| Wyndham Hotels & Resorts, Inc., 144A 5.375% 15/04/2026 | USD | 425,000 | 440,672 | 0.03 |
| Wynn Las Vegas LLC, 144A 4.25% 30/05/2023 | USD | 2,225,000 | 2,261,546 | 0.17 |
| | | | 213,724,417 | 15.74 |
| Total Bonds | | | 326,902,963 | 24.07 |
| Total Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market | | | 326,902,963 | 24.07 |
| Recently issued securities | | | | |
| Bonds | | | | |
| <i>Canada</i> | | | | |
| Bausch Health Cos., Inc., 144A 5.25% 15/02/2031 | USD | 1,605,000 | 1,679,785 | 0.12 |
| First Quantum Minerals Ltd., 144A 6.875% 15/10/2027 | USD | 2,120,000 | 2,302,850 | 0.17 |
| | | | 3,982,635 | 0.29 |
| <i>Chile</i> | | | | |
| Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA, Reg. S 4.7% 07/05/2050 | USD | 2,190,000 | 2,759,685 | 0.20 |
| Engie Energia Chile SA, Reg. S 3.4% 28/01/2030 | USD | 1,353,000 | 1,468,005 | 0.11 |
| | | | 4,227,690 | 0.31 |
| <i>Hong Kong</i> | | | | |
| Sands China Ltd., 144A 3.8% 08/01/2026 | USD | 1,450,000 | 1,552,167 | 0.11 |
| | | | 1,552,167 | 0.11 |
| <i>Ireland</i> | | | | |
| Ardagh Packaging Finance plc, 144A 5.25% 30/04/2025 | USD | 722,000 | 762,681 | 0.06 |
| | | | 762,681 | 0.06 |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|---|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| <i>Italy</i> | | | | |
| International Game Technology plc, 144A 5.25% 15/01/2029 | USD | 950,000 | 1,025,150 | 0.08 |
| | | | 1,025,150 | 0.08 |
| <i>Luxembourg</i> | | | | |
| Rede D'or Finance Sarl, Reg. S 4.5% 22/01/2030 | USD | 3,080,000 | 3,217,060 | 0.24 |
| Venator Finance Sarl, 144A 9.5% 01/07/2025 | USD | 300,000 | 328,500 | 0.02 |
| | | | 3,545,560 | 0.26 |
| <i>Mexico</i> | | | | |
| Industrias Penoles SAB de CV, Reg. S 4.75% 06/08/2050 | USD | 1,570,000 | 1,822,856 | 0.13 |
| | | | 1,822,856 | 0.13 |
| <i>Panama</i> | | | | |
| AES Panama Generation Holdings SRL, Reg. S 4.375% 31/05/2030 | USD | 3,555,000 | 3,850,598 | 0.28 |
| ENA Master Trust, 144A 4% 19/05/2048 | USD | 3,152,000 | 3,400,220 | 0.25 |
| | | | 7,250,818 | 0.53 |
| <i>United Kingdom</i> | | | | |
| Fresnillo plc, 144A 4.25% 02/10/2050 | USD | 1,545,000 | 1,699,114 | 0.13 |
| | | | 1,699,114 | 0.13 |
| <i>United States of America</i> | | | | |
| Adient US LLC, 144A 9% 15/04/2025 | USD | 472,000 | 526,870 | 0.04 |
| AG Issuer LLC, 144A 6.25% 01/03/2028 | USD | 2,194,000 | 2,224,167 | 0.16 |
| Albertsons Cos., Inc., 144A 3.5% 15/03/2029 | USD | 675,000 | 682,763 | 0.05 |
| Allison Transmission, Inc., 144A 3.75% 30/01/2031 | USD | 1,450,000 | 1,486,250 | 0.11 |
| Antero Midstream Partners LP, 144A 7.875% 15/05/2026 | USD | 197,000 | 203,911 | 0.01 |
| Associated Materials LLC, 144A 9% 01/09/2025 | USD | 1,701,000 | 1,807,313 | 0.13 |
| AssuredPartners, Inc., 144A 5.625% 15/01/2029 | USD | 2,860,000 | 2,988,700 | 0.22 |
| Avaya, Inc., 144A 6.125% 15/09/2028 | USD | 1,060,000 | 1,134,343 | 0.08 |
| Avis Budget Car Rental LLC, 144A 5.75% 15/07/2027 | USD | 1,300,000 | 1,330,062 | 0.10 |
| Avis Budget Car Rental LLC, 144A 10.5% 15/05/2025 | USD | 1,625,000 | 1,920,547 | 0.14 |
| Caesars Entertainment, Inc., 144A 6.25% 01/07/2025 | USD | 2,500,000 | 2,665,637 | 0.20 |
| Carnival Corp., 144A 11.5% 01/04/2023 | USD | 4,005,000 | 4,636,889 | 0.34 |
| CCO Holdings LLC, 144A 4.5% 15/08/2030 | USD | 3,075,000 | 3,267,203 | 0.24 |
| CCO Holdings LLC, 144A 4.25% 01/02/2031 | USD | 2,825,000 | 2,980,686 | 0.22 |
| CCO Holdings LLC, 144A 4.5% 01/05/2032 | USD | 1,225,000 | 1,309,488 | 0.10 |
| CenturyLink, Inc., 144A 4% 15/02/2027 | USD | 575,000 | 594,475 | 0.04 |
| Cheniere Energy, Inc., 144A 4.625% 15/10/2028 | USD | 3,085,000 | 3,243,106 | 0.24 |
| Cleveland-Cliffs, Inc., 144A 9.875% 17/10/2025 | USD | 825,000 | 971,438 | 0.07 |
| Cleveland-Cliffs, Inc., 144A 6.75% 15/03/2026 | USD | 1,840,000 | 1,989,500 | 0.15 |
| CNX Resources Corp., 144A 6% 15/01/2029 | USD | 405,000 | 415,676 | 0.03 |
| Continental Resources, Inc., 144A 5.75% 15/01/2031 | USD | 1,405,000 | 1,562,156 | 0.11 |
| Delta Air Lines, Inc., 144A 4.75% 20/10/2028 | USD | 3,890,000 | 4,249,138 | 0.31 |
| Diebold Nixdorf, Inc., 144A 9.375% 15/07/2025 | USD | 3,525,000 | 3,954,609 | 0.29 |
| DPL, Inc., 144A 4.125% 01/07/2025 | USD | 885,000 | 956,526 | 0.07 |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|--|----------|----------------------------|---------------------|--------------------|
| Endo Dac, Reg. S 9.5% 31/07/2027 | USD | 3,533,000 | 3,950,336 | 0.29 |
| EQM Midstream Partners LP, 144A 6.5% 01/07/2027 | USD | 1,895,000 | 2,136,518 | 0.16 |
| Frontier Communications Corp., 144A 5.875% 15/10/2027 | USD | 1,000,000 | 1,083,125 | 0.08 |
| Frontier Communications Corp., 144A 5% 01/05/2028 | USD | 2,175,000 | 2,271,516 | 0.17 |
| Frontier Communications Corp., 144A 6.75% 01/05/2029 | USD | 1,775,000 | 1,902,578 | 0.14 |
| Gartner, Inc., 144A 4.5% 01/07/2028 | USD | 600,000 | 633,750 | 0.05 |
| Hanesbrands, Inc., 144A 5.375% 15/05/2025 | USD | 626,000 | 663,103 | 0.05 |
| Harvest Midstream LP, 144A 7.5% 01/09/2028 | USD | 650,000 | 693,062 | 0.05 |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc., 144A 4% 01/05/2031 | USD | 985,000 | 1,041,130 | 0.08 |
| Howard Hughes Corp. (The), 144A 5.375% 01/08/2028 | USD | 1,650,000 | 1,777,669 | 0.13 |
| Iron Mountain, Inc., 144A 5.25% 15/07/2030 | USD | 2,350,000 | 2,540,937 | 0.19 |
| Iron Mountain, Inc., 144A 4.5% 15/02/2031 | USD | 1,935,000 | 2,029,331 | 0.15 |
| Joseph T Ryerson & Son, Inc., 144A 8.5% 01/08/2028 | USD | 1,102,000 | 1,250,081 | 0.09 |
| Kraft Heinz Foods Co., 144A 5.5% 01/06/2050 | USD | 790,000 | 997,638 | 0.07 |
| Kraft Heinz Foods Co., 144A 3.875% 15/05/2027 | USD | 1,475,000 | 1,590,675 | 0.12 |
| Ladder Capital Finance Holdings LLLP, REIT, 144A 4.25% 01/02/2027 | USD | 1,941,000 | 1,911,885 | 0.14 |
| LifePoint Health, Inc., 144A 5.375% 15/01/2029 | USD | 1,060,000 | 1,060,583 | 0.08 |
| Ligado Networks LLC, 144A 15.5% 01/11/2023 | USD | 2,850,000 | 2,778,750 | 0.20 |
| Lithia Motors, Inc., 144A 4.375% 15/01/2031 | USD | 1,000,000 | 1,074,375 | 0.08 |
| Macy's, Inc., 144A 8.375% 15/06/2025 | USD | 1,660,000 | 1,845,256 | 0.14 |
| Mallinckrodt International Finance SA, 144A 10% 15/04/2025 ¹ | USD | 4,735,000 | 5,149,312 | 0.38 |
| MasTec, Inc., 144A 4.5% 15/08/2028 | USD | 1,350,000 | 1,419,187 | 0.10 |
| Meritor, Inc., 144A 4.5% 15/12/2028 | USD | 700,000 | 718,813 | 0.05 |
| MGM Growth Properties Operating Partnership LP, 144A 4.625% 15/06/2025 | USD | 725,000 | 777,200 | 0.06 |
| MGM Growth Properties Operating Partnership LP, 144A 3.875% 15/02/2029 | USD | 1,170,000 | 1,198,519 | 0.09 |
| Mileage Plus Holdings LLC, 144A 6.5% 20/06/2027 | USD | 1,500,000 | 1,615,313 | 0.12 |
| Molina Healthcare, Inc., 144A 3.875% 15/11/2030 | USD | 705,000 | 757,875 | 0.06 |
| New Fortress Energy, Inc., 144A 6.75% 15/09/2025 | USD | 17,000 | 18,036 | - |
| Nexstar Broadcasting, Inc., 144A 4.75% 01/11/2028 | USD | 1,325,000 | 1,388,766 | 0.10 |
| Post Holdings, Inc., 144A 4.625% 15/04/2030 | USD | 3,585,000 | 3,775,758 | 0.28 |
| QualityTech LP, 144A 3.875% 01/10/2028 | USD | 1,325,000 | 1,353,156 | 0.10 |
| Quicken Loans LLC, 144A 3.625% 01/03/2029 | USD | 1,025,000 | 1,047,422 | 0.08 |
| Rattler Midstream LP, 144A 5.625% 15/07/2025 | USD | 340,000 | 359,762 | 0.03 |
| Rayonier AM Products, Inc., 144A 7.625% 15/01/2026 | USD | 1,740,000 | 1,816,560 | 0.13 |
| Royal Caribbean Cruises Ltd., 144A 11.5% 01/06/2025 | USD | 825,000 | 965,497 | 0.07 |
| Sabre GLBL, Inc., 144A 9.25% 15/04/2025 | USD | 925,000 | 1,101,906 | 0.08 |
| Sally Holdings LLC, 144A 8.75% 30/04/2025 | USD | 1,625,000 | 1,809,844 | 0.13 |
| Scientific Games International, Inc., 144A 8.625% 01/07/2025 | USD | 985,000 | 1,079,806 | 0.08 |

¹ Security is currently in default.

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Investments | Currency | Quantity/ Nominal Value | Market Value USD | % of Net Assets |
|---|----------|----------------------------|----------------------|--------------------|
| Scripps Escrow II, Inc., 144A 3.875% 15/01/2029 | USD | 475,000 | 496,076 | 0.04 |
| Sinclair Television Group, Inc., 144A 4.125% 01/12/2030 | USD | 1,175,000 | 1,205,556 | 0.09 |
| Starwood Property Trust, Inc., 144A 5.5% 01/11/2023 | USD | 1,015,000 | 1,061,944 | 0.08 |
| Talen Energy Supply LLC, 144A 7.625% 01/06/2028 | USD | 960,000 | 1,036,200 | 0.08 |
| Tallgrass Energy Partners LP, 144A 7.5% 01/10/2025 | USD | 540,000 | 583,991 | 0.04 |
| Targa Resources Partners LP, 144A 4.875% 01/02/2031 | USD | 1,020,000 | 1,108,230 | 0.08 |
| TEGNA, Inc., 144A 4.75% 15/03/2026 | USD | 1,850,000 | 1,977,743 | 0.15 |
| TEGNA, Inc., 144A 4.625% 15/03/2028 | USD | 300,000 | 307,313 | 0.02 |
| Triumph Group, Inc., 144A 8.875% 01/06/2024 | USD | 925,000 | 1,016,922 | 0.07 |
| Unisys Corp., 144A 6.875% 01/11/2027 | USD | 725,000 | 793,875 | 0.06 |
| Univision Communications, Inc., 144A 6.625% 01/06/2027 | USD | 6,825,000 | 7,342,164 | 0.54 |
| Veritas US, Inc., 144A 7.5% 01/09/2025 | USD | 3,145,000 | 3,231,487 | 0.24 |
| VICI Properties LP, REIT, 144A 3.5% 15/02/2025 | USD | 1,645,000 | 1,685,549 | 0.12 |
| VICI Properties LP, REIT, 144A 3.75% 15/02/2027 | USD | 300,000 | 307,266 | 0.02 |
| VICI Properties LP, REIT, 144A 4.125% 15/08/2030 | USD | 500,000 | 528,440 | 0.04 |
| Virgin Media Secured Finance plc, 144A 4.5% 15/08/2030 | USD | 1,800,000 | 1,882,800 | 0.14 |
| WESCO Distribution, Inc., 144A 7.125% 15/06/2025 | USD | 1,100,000 | 1,211,270 | 0.09 |
| WESCO Distribution, Inc., 144A 7.25% 15/06/2028 | USD | 1,050,000 | 1,195,630 | 0.09 |
| Wyndham Hotels & Resorts, Inc., 144A 4.375% 15/08/2028 | USD | 1,255,000 | 1,306,361 | 0.10 |
| Xerox Holdings Corp., 144A 5.5% 15/08/2028 | USD | 1,550,000 | 1,647,689 | 0.12 |
| XPO Logistics, Inc., 144A 6.25% 01/05/2025 | USD | 600,000 | 646,809 | 0.05 |
| | | | 137,259,798 | 10.11 |
| Total Bonds | | | 163,128,469 | 12.01 |
| Total Recently issued securities | | | 163,128,469 | 12.01 |
| Other transferable securities and money market instruments | | | | |
| Equities | | | | |
| <i>United States of America</i> | | | | |
| ACR III LSC Holdings LLC* | USD | 234 | 352,187 | 0.03 |
| Associated Materials Group Inc* | USD | 679,843 | 4,269,414 | 0.31 |
| Rotech Healthcare, Inc.* | USD | 153,793 | 10,919,303 | 0.80 |
| Sable Permian Resources Land LLC* | USD | 9,523,800 | 1 | - |
| | | | 15,540,905 | 1.14 |
| Total Equities | | | 15,540,905 | 1.14 |
| Total Other transferable securities and money market instruments | | | 15,540,905 | 1.14 |
| Total Investments | | | 1,263,837,918 | 93.04 |
| Cash | | | 74,201,369 | 5.46 |
| Other assets/(liabilities) | | | 20,280,187 | 1.50 |
| Total net assets | | | 1,358,319,474 | 100.00 |

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

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Financial Futures Contracts | | | | | |
|---|---------------------|----------|---------------------|----------------------------|-----------------|
| Security Description | Number of Contracts | Currency | Global Exposure USD | Unrealised Gain/(Loss) USD | % of Net Assets |
| US 10 Year Ultra Bond, 22/03/2021 | (250) | USD | (39,089,844) | 89,256 | 0.01 |
| Total Unrealised Gain on Financial Futures Contracts | | | | 89,256 | 0.01 |
| Euro-Bund, 08/03/2021 | (113) | EUR | (24,522,571) | (105,800) | (0.01) |
| US 5 Year Note, 31/03/2021 | (218) | USD | (27,503,766) | (57,560) | — |
| US Ultra Bond, 22/03/2021 | 74 | USD | 15,803,625 | (99,687) | (0.01) |
| Total Unrealised Loss on Financial Futures Contracts | | | | (263,047) | (0.02) |
| Net Unrealised Loss on Financial Futures Contracts | | | | (173,791) | (0.01) |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Forward Currency Exchange Contracts | | | | | | | |
|---|------------------|---------------|---------------|---------------|--------------------|----------------------------|-----------------|
| Currency Purchased | Amount Purchased | Currency Sold | Amount Sold | Maturity Date | Counterparty | Unrealised Gain/(Loss) USD | % of Net Assets |
| EUR | 7,074,000 | USD | 8,405,660 | 06/01/2021 | Morgan Stanley | 236,545 | 0.02 |
| ZAR | 51,900,000 | USD | 3,376,780 | 06/01/2021 | Barclays | 154,397 | 0.01 |
| CZK | 37,000,000 | USD | 1,694,154 | 08/01/2021 | Citibank | 28,617 | - |
| EUR | 1,230,000 | USD | 1,478,786 | 08/01/2021 | Morgan Stanley | 23,975 | - |
| USD | 848,981 | PLN | 3,150,000 | 08/01/2021 | Barclays | 5,736 | - |
| ZAR | 45,100,000 | USD | 2,944,960 | 08/01/2021 | Standard Chartered | 122,453 | 0.01 |
| KRW | 11,334,800,000 | USD | 10,433,838 | 14/01/2021 | Citibank | 2,486 | - |
| TRY | 36,400,000 | USD | 4,569,363 | 14/01/2021 | Goldman Sachs | 314,615 | 0.03 |
| TRY | 14,000,000 | USD | 1,875,971 | 14/01/2021 | UBS | 2,482 | - |
| CNH | 29,900,000 | USD | 4,568,525 | 19/01/2021 | Goldman Sachs | 25,108 | - |
| MXN | 15,500,000 | USD | 765,767 | 19/01/2021 | Morgan Stanley | 11,853 | - |
| CNH | 29,800,000 | USD | 4,569,588 | 21/01/2021 | Goldman Sachs | 8,076 | - |
| MXN | 79,120,000 | USD | 3,953,186 | 21/01/2021 | Bank of America | 15,281 | - |
| USD | 75,236 | BRL | 385,000 | 22/01/2021 | Goldman Sachs | 1,121 | - |
| EUR | 4,405,000 | USD | 5,376,376 | 25/01/2021 | HSBC | 7,737 | - |
| USD | 7,112,941 | PLN | 26,040,000 | 25/01/2021 | Citibank | 141,391 | 0.01 |
| Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts | | | | | | 1,101,873 | 0.08 |
| AUD Hedged Share Class | | | | | | | |
| AUD | 50,103,945 | USD | 37,777,528 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | 855,358 | 0.06 |
| CHF Hedged Share Class | | | | | | | |
| CHF | 1,874,320 | USD | 2,116,274 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | 1,583 | - |
| CNH Hedged Share Class | | | | | | | |
| CNH | 697,721 | USD | 106,690 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | 532 | - |
| EUR Hedged Share Class | | | | | | | |
| EUR | 96,416,783 | USD | 117,267,048 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | 552,920 | 0.04 |
| USD | 142,632 | EUR | 116,297 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | 519 | - |
| GBP Hedged Share Class | | | | | | | |
| GBP | 17,535,045 | USD | 23,387,317 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | 594,288 | 0.05 |
| JPY Hedged Share Class | | | | | | | |
| JPY | 6,376,042,187 | USD | 61,336,607 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | 422,089 | 0.03 |
| SGD Hedged Share Class | | | | | | | |
| SGD | 45,687,009 | USD | 34,236,253 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | 333,579 | 0.03 |
| Unrealised Gain on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts | | | | | | 2,760,868 | 0.21 |
| Total Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts | | | | | | 3,862,741 | 0.29 |
| USD | 707,769 | MXN | 14,300,000 | 06/01/2021 | HSBC | (10,753) | - |
| USD | 9,181,983 | CNH | 60,400,000 | 08/01/2021 | HSBC | (104,325) | (0.01) |
| USD | 9,728,424 | EUR | 8,000,000 | 08/01/2021 | Bank of America | (45,633) | - |
| USD | 22,863,056 | EUR | 18,800,000 | 12/01/2021 | Standard Chartered | (108,664) | (0.01) |
| USD | 343,569 | EUR | 283,000 | 14/01/2021 | Bank of America | (2,245) | - |
| USD | 391,084 | COP | 1,344,900,000 | 15/01/2021 | Citibank | (2,684) | - |
| USD | 26,110,157 | EUR | 21,490,000 | 19/01/2021 | Goldman Sachs | (152,791) | (0.01) |
| BRL | 47,700,000 | USD | 9,325,513 | 22/01/2021 | Citibank | (142,869) | (0.01) |
| BRL | 21,830,000 | USD | 4,294,201 | 22/01/2021 | Morgan Stanley | (91,746) | (0.01) |
| CZK | 223,950,000 | USD | 10,445,848 | 25/01/2021 | UBS | (18,507) | - |
| PLN | 87,780,000 | USD | 24,108,007 | 25/01/2021 | Goldman Sachs | (607,137) | (0.05) |
| Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts | | | | | | (1,287,354) | (0.10) |

Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

| Forward Currency Exchange Contracts | | | | | | | |
|--|------------------|---------------|-------------|---------------|--------------|----------------------------|-----------------|
| Currency Purchased | Amount Purchased | Currency Sold | Amount Sold | Maturity Date | Counterparty | Unrealised Gain/(Loss) USD | % of Net Assets |
| AUD Hedged Share Class | | | | | | | |
| USD | 25,598 | AUD | 33,727 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | (408) | — |
| CHF Hedged Share Class | | | | | | | |
| CHF | 21,795 | USD | 24,653 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | (26) | — |
| EUR Hedged Share Class | | | | | | | |
| EUR | 2,189,904 | USD | 2,686,116 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | (10,084) | — |
| USD | 3,703,514 | EUR | 3,031,157 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | (518) | — |
| GBP Hedged Share Class | | | | | | | |
| USD | 60,048 | GBP | 44,553 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | (884) | — |
| JPY Hedged Share Class | | | | | | | |
| JPY | 88,531,895 | USD | 858,688 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | (1,163) | — |
| USD | 2,885 | JPY | 300,000 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | (20) | — |
| SGD Hedged Share Class | | | | | | | |
| SGD | 5,016 | USD | 3,798 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | (2) | — |
| USD | 136,869 | SGD | 182,212 | 15/01/2021 | J.P. Morgan | (1,005) | — |
| Unrealised Loss on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts | | | | | | (14,110) | — |
| Total Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts | | | | | | (1,301,464) | (0.10) |
| Net Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts | | | | | | 2,561,277 | 0.19 |

Credit Default Swap Contracts

| Nominal Amount | Currency | Counterparty | Reference Entity | Buy/Sell | Interest (Paid)/Received Rate | Maturity Date | Market Value USD | Unrealised Gain/(Loss) USD | % of Net Assets |
|---|----------|---------------|------------------|----------|-------------------------------|---------------|------------------|----------------------------|-----------------|
| 15,000,000 | USD | Goldman Sachs | CDX.NA.EM.34-V1 | Buy | (1.00)% | 20/12/2025 | 355,634 | 355,634 | 0.03 |
| Total Unrealised Gain on Credit Default Swap Contracts | | | | | | | 355,634 | 355,634 | 0.03 |
| Net Unrealised Gain on Credit Default Swap Contracts | | | | | | | 355,634 | 355,634 | 0.03 |

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

キャピタル・グループ・グローバル・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

2020年12月31日現在

（USD）

収益

債券および転換社債に係る利息（源泉徴収税額控除後）

67,520,402

受取配当金（源泉徴収税額控除後）

-

その他収益

62,278

| | |
|----------------------------|---------------|
| 銀行預金利息 | 151,517 |
| スワップ取引 | 281,320 |
| 収益小計 | 68,015,517 |
| 費用 | |
| 運用報酬 | 9,208,278 |
| 管理手数料 | 527,513 |
| 年次税 | 376,648 |
| 専門家サービス | 331,987 |
| 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 | 384,585 |
| 印刷費用 | 93,488 |
| その他費用 | 63,339 |
| スワップ取引 | 166,224 |
| 当座貸越利息 * | - |
| 費用小計 | 11,152,062 |
| 費用の払戻し | 345,501 |
| 投資純利益 / (損失) (a) | 57,208,956 |
| 実現純利益 / (損失) | |
| 投資有価証券の売却取引 | -19,881,407 |
| 金融先物取引 | 1,804,544 |
| 為替取引 | 11,020,863 |
| スワップ取引 | 280,627 |
| 当期実現純利益 / (損失) (b) | -6,775,373 |
| 未実現評価利益 / (損失)の増減 | |
| 投資有価証券 | 56,150,503 |
| 金融先物取引 | -49,971 |
| スワップ取引 | 186,910 |
| 為替取引 | 2,288,616 |
| 当期末実現評価利益 / (損失)の増減 (c) | 58,576,058 |
| 当期損益 (a+b+c) | 109,009,641 |
| 配当金の分配 | -26,755,641 |
| 当期投資証券の差引増減額 | 234,452,399 |
| 期首純資産総額 | 1,041,613,075 |
| 期末純資産総額 | 1,358,319,474 |

*主に中央銀行が実施するマイナス金利政策によるものです。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

「キャピタル・グローバル・ハ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2020年7月23日から2021年1月22日までとなっております。ただし、同マザーファンド（「日本短期債券マザーファンド」）は当該監査の対象ではありません。

「日本短期債券マザーファンド」の組入有価証券の状況

（有価証券明細表）

（2021年1月22日現在）

| 国名 | 銘柄名 | 利率 (%) | 償還日 | 種類 | 額面 (千円) | 評価額 | |
|----|---|-----------|------------|------|------------|-----------|-------------|
| | | | | | | 単価 (円) | 評価金額(円) |
| 日本 | 第958回国庫短期債券 | 0 | 2021/3/22 | 国債証券 | 60,000 | 100.0158 | 60,009,480 |
| 日本 | 第48回韓国産業銀行円貨債券(2018) | 0.23 | 2021/9/3 | 特殊債券 | 100,000 | 100.031 | 100,031,000 |
| 日本 | 第6回マラヤン・バンキング・ベルハッド円貨社債(2020) | 0.224 | 2023/2/13 | 社債券 | 100,000 | 99.765 | 99,765,000 |
| 日本 | 第14回アサヒグループホールディングス(特定社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド) | 0.12 | 2025/10/15 | 社債券 | 100,000 | 100.113 | 100,113,000 |
| 日本 | 第14回セブン&アイ・ホールディングス(社債間限定同順位特約付) | 0.19 | 2025/12/19 | 社債券 | 100,000 | 100.336 | 100,336,000 |
| 日本 | 第15回Zホールディングス(社債間限定同順位特約付) | 0.35 | 2023/6/9 | 社債券 | 100,000 | 99.945 | 99,945,000 |
| 日本 | 第18回日立製作所(社債間限定同順位特約付) | 0.06 | 2023/3/10 | 社債券 | 100,000 | 99.871 | 99,871,000 |
| 日本 | 第46回IHI(社債間限定同順位特約付) | 0.22 | 2023/9/1 | 社債券 | 100,000 | 100.015 | 100,015,000 |
| 日本 | 第1回明治安田生命2019基金特定目的会社特定社債(一般担保付) | 0.29 | 2024/8/2 | 社債券 | 100,000 | 100.015 | 100,015,000 |
| 日本 | 第37回丸井グループ(社債間限定同順位特約付) | 0.12 | 2023/12/1 | 社債券 | 100,000 | 99.802 | 99,802,000 |
| 日本 | 第19回みずほ銀行(劣後特約付) | 1.67 | 2022/2/24 | 社債券 | 100,000 | 101.542 | 101,542,000 |
| 日本 | 第22回芙蓉総合リース(社債間限定同順位特約付) | 0.04 | 2022/10/28 | 社債券 | 100,000 | 99.838 | 99,838,000 |
| 日本 | 第16回東京センチュリーリース(社債間限定同順位特約付) | 0.2 | 2021/4/14 | 社債券 | 100,000 | 100.024 | 100,024,000 |
| 日本 | 第5回イオンフィナンシャルサービス(社債間限定同順位特約付) | 0.23 | 2022/5/27 | 社債券 | 100,000 | 99.991 | 99,991,000 |
| 日本 | 第75回アコム(特定社債間限定同順位特約付) | 0.309 | 2023/2/28 | 社債券 | 100,000 | 100.055 | 100,055,000 |
| 日本 | 第74回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付) | 0.09 | 2023/1/23 | 社債券 | 100,000 | 99.955 | 99,955,000 |

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

2【ファンドの現況】

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

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）

2021年6月30日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 9,399,281,172円 |
| 負債総額 | 8,210,880円 |
| 純資産総額（ - ） | 9,391,070,292円 |
| 発行済口数 | 6,871,213,624口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3667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）

2021年6月30日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 9,566,180,088円 |
| 負債総額 | 351,000,997円 |
| 純資産総額（ - ） | 9,215,179,091円 |
| 発行済口数 | 6,327,016,536口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.4565円 |

（参考）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

2021年1月22日現在

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

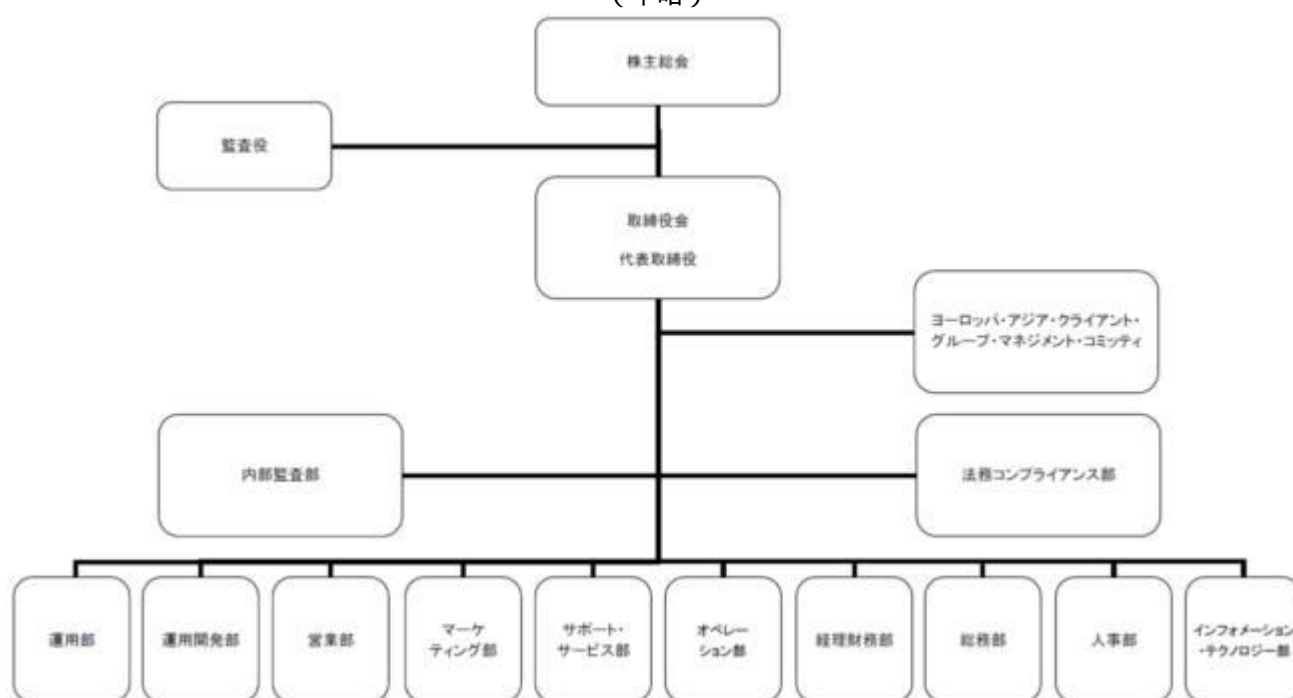
<訂正前>

(1) 資本金の額（2020年12月30日現在）

（中略）

(2) 会社の機構（2020年12月30日現在）

（中略）



（以下略）

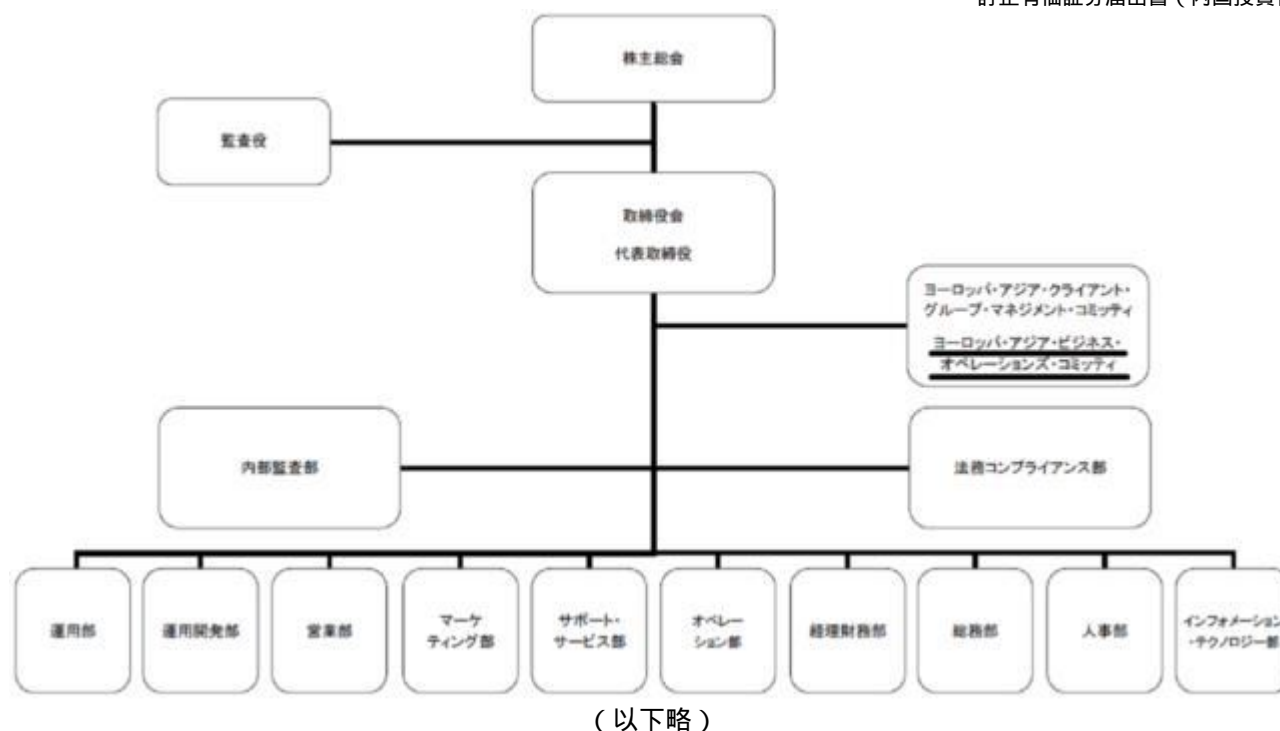
<訂正後>

(1) 資本金の額（2021年6月30日現在）

（中略）

(2) 会社の機構（2021年6月30日現在）

（中略）



2【事業の内容及び営業の概況】

< 訂正前 >

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

委託会社の運用する証券投資信託は2020年12月30日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

| 種類 | 本数 | 純資産総額（百万円） |
|-----------|----|------------|
| 追加型株式投資信託 | 28 | 412,501 |
| 合計 | 28 | 412,501 |

< 訂正後 >

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

委託会社の運用する証券投資信託は2021年6月30日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

| 種類 | 本数 | 純資産総額（百万円） |
|-----------|----|------------|
| 追加型株式投資信託 | 29 | 577,957 |
| 合計 | 29 | 577,957 |

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

< 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（2020年 9 月30日現在）
（中略）

（２）販売会社

名称：みずほ証券株式会社
資本金の額：125,167百万円（2020年 9 月30日現在）
（中略）

< 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（2020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（2021年 3 月31日現在）
（中略）

（２）販売会社

名称：みずほ証券株式会社
資本金の額：125,167百万円（2021年 3 月31日現在）
（中略）

< 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（2021年 3 月31日現在）
（以下略）

独立監査人の中間監査報告書

2021年7月13日

キャピタル・インターナショナル株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 山田信之

印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているキャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）の2020年11月21日から2021年5月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）の2021年5月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年11月21日から2021年5月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、キャピタル・インターナショナル株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

１．上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

２．XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。