

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年2月16日提出
【発行者名】	キャピタル・インターナショナル株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 トーマス・クワントリル
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内二丁目1番1号 明治安田生命ビル
【事務連絡者氏名】	原田 伸健
【電話番号】	03(6366)1000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	キャピタル・グローバル中期債ファンド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】	(1)当初自己設定日(平成29年10月17日) 10万円とします。 (2)継続申込期間(平成29年10月17日から平成31年2月14日まで) 3,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出しましたので、平成29年9月29日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、「第二部ファンド情報」及び「第三部委託会社等の情報」における訂正事項を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書を以下の内容に訂正します。下線部_____は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

2017年10月17日 信託契約締結、当ファンドの設定および運用開始（予定）

<訂正後>

2017年10月17日 信託契約締結、当ファンドの設定および運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（前略）

ファミリーファンド方式

（中略）

・委託会社は、マザーファンドに投資を行なう当ファンド以外のベビーファンドの設定・運用を行なうことがあります。2017年9月29日現在、その他のベビーファンドはありません。

委託会社の概況（2017年7月31日現在）

（以下略）

<訂正後>

（前略）

ファミリーファンド方式

（中略）

・委託会社は、マザーファンドに投資を行なう当ファンド以外のベビーファンドの設定・運用を行なうことがあります。2018年2月16日現在、その他のベビーファンドはありません。

委託会社の概況（2017年12月29日現在）

（以下略）

2【投資方針】

(2)【投資対象】

< 訂正前 >

（前略）

< 参考情報 2 > 投資対象ファンドの概要等

（中略）

上記は、2017年7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、2017年7月31日現在のものであり、今後、委託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。

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

（中略）

上記は、2017年12月29日現在のものであり、今後、委託会社等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（2017年7月31日現在）

運用部（3名）／法務コンプライアンス部（2名）／オペレーション部（8名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

上記は2017年7月31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（2017年12月29日現在）

運用部（3名）／法務コンプライアンス部（2名）／オペレーション部（8名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

上記は2017年12月29日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

3【投資リスク】

<訂正前>

（前略）

<リスク管理体制>

（中略）

<参考情報> 投資対象ファンドにおけるリスク管理体制

1．キャピタル・グループのリスク管理体制

（中略）

2．三菱UFJ国際投信株式会社の投資リスクに対する管理体制

「投資リスク」をファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行なうこと、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行なうこと、を基本の考え方として、投資リスクの管理体制を構築しています。
また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行なうほか、必要に応じて改善策を審議しています。

リスク管理体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

<訂正後>

（前略）

<リスク管理体制>

（中略）

<参考情報> 投資対象ファンドにおけるリスク管理体制

1．キャピタル・グループのリスク管理体制

（中略）

2．三菱UFJ国際投信株式会社の投資リスクに対する管理体制

三菱UFJ国際投信株式会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行なうとともに運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行なっています。
また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行なうほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下のとおりです。

トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注にかかる法令等の遵守および監視・牽制を行ないます。

コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行ないます。

リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行ない、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行なっています。

内部監査担当部署

同社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行ない、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

<流動性リスクに対する管理体制>

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

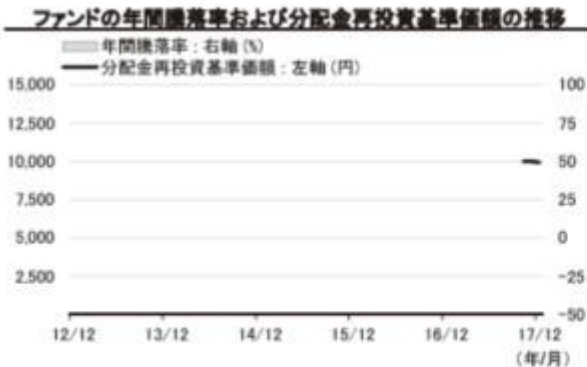
に関する会議体等に報告されます。

上記は2017年12月29日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

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

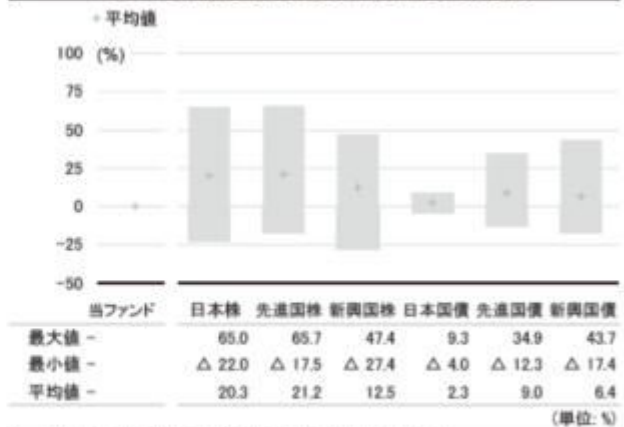
<更新・訂正後>

リスクの定量的比較



- (注1) ファンドの年間騰落率は、運用開始後1年を経過していないため、表示できません。
- (注2) 分配金再投資基準価額は、設定日(2017年10月17日)を10,000として指数化しています。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- (注1) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- (注2) 代表的な資産クラスの騰落率は、2013年1月から2017年12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、運用開始後1年を経過していないため、表示できません。

<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・ディバーシファイド(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・ディバーシファイド(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・ディバーシファイドは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが発表しており、著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しています。

4【手数料等及び税金】

(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、2017年7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。

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、2017年12月29日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご注意ください。

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

(以下略)

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

キャピタル・グローバル中期債ファンドF（米ドル売り円買い）

平成29年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	6,700,449,720	97.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		188,609,762	2.73
合計(純資産総額)		6,889,059,482	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・グローバル中期債マザーファンド（米ドル売り円買い）

平成29年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	7,000,674	0.10
投資証券	ルクセンブルク	6,693,660,340	99.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0	0.00
合計(純資産総額)		6,700,661,014	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・インターメディアイト・ボンド・ファンド（LUX）

平成29年12月29日現在

資産の種類	国/地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
債券	米国	5,156,971,810	41.35
	ドイツ	1,027,327,566	8.24
	日本	1,013,965,313	8.13
	イタリア	486,867,674	3.90
	ポーランド	476,621,243	3.82
	カナダ	451,490,078	3.62
	スペイン	436,668,024	3.50
	フランス	356,631,917	2.86
	国際機関	334,415,827	2.68
	デンマーク	305,125,980	2.45
	ポルトガル	293,682,448	2.35
	英国	271,241,669	2.18
	アイルランド	234,206,039	1.88
	オーストラリア	218,861,068	1.75
	マレーシア	210,662,100	1.69
	メキシコ	198,776,315	1.59
	オランダ	149,373,104	1.20
	ノルウェー	103,630,114	0.83
	スイス	77,863,136	0.62
	スウェーデン	73,467,280	0.59
	インド	35,130,395	0.28
	ベルギー	33,602,668	0.27
	スロベニア	28,551,585	0.23
サウジアラビア	22,220,880	0.18	

韓国	17,740,403	0.14
ブラジル	15,212,922	0.12
ウルグアイ	13,906,111	0.11
オーストリア	11,767,628	0.09
チリ	1,152,426	0.01
銀行預金、その他資産（負債控除後）	413,723,869	3.32
純資産総額	12,470,857,592	100.00

（注）投資比率は、キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド（LUX）の純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（参考）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)の投資対象である日本短期債券マザーファンド

平成29年7月24日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
特殊債券	日本	200,367,000	8.78
社債券	日本	2,018,358,000	88.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		62,550,069	2.74
合計(純資産総額)		2,281,275,069	100.00

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

（注）当該情報は委託会社が入手可能な直近日（平成29年7月24日）現在の情報です。

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

キャピタル・グローバル中期債ファンドF（米ドル売り円買い）

a. 上位30銘柄

平成29年12月29日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	キャピタル・グローバル中期債マ ザーファンド（米ドル売り円買 い）	6,729,386,081	0.9990	6,722,957,194	0.9957	6,700,449,720	97.26

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

b. 種類別投資比率

平成29年12月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.26
合計	97.26

（参考）キャピタル・グローバル中期債マザーファンド（米ドル売り円買い）

a. 上位30銘柄

平成29年12月29日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ルクセンブルク	投資証券	キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド（LUX）（クラスCh-JPY）	5,835,798.03	1,150.82	6,715,955,192	1,147	6,693,660,340	99.89
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）	6,640,746	1.0543	7,002,002	1.0542	7,000,674	0.10

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

b. 種類別投資比率

平成29年12月29日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	0.10
投資証券	99.89
合計	100.00

（参考）キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド（LUX）

上位30銘柄

平成29年12月29日現在

順位	銘柄	利率(%) (上段) 償還日 (下段)	国/地域(上段) 資産(中段) 業種/種類(下段)	数量	評価単価(上段) 通貨(下段)	評価金額(円)	投資 比率 (%)
1	DEUTSCHLAND REP EUR REG S (B)	2.0 2022/1/4	ドイツ 債券 国債証券	4,600,000	109.5114 ユーロ	679,093,244	5.45
2	US TREASURY NOTE	2.0 2022/11/30	米国 債券 国債証券	5,650,000	99.034945 米ドル	631,617,149	5.06
3	JAPAN GVT 128 JPY BD	0.1 2021/6/20	日本 債券 国債証券	530,000,000	100.7504 日本円	533,977,120	4.28
4	FGLMC 4.0 TBA 02/18	4.0 2048/2/1	米国 債券 その他債券	3,600,000	104.320315 米ドル	423,924,378	3.40
5	US TREASURY NOTE	1.75 2021/11/30	米国 債券 国債証券	3,750,000	98.527344 米ドル	417,066,247	3.34
6	US TREASURY I/L	0.375 2027/1/15	米国 債券 国債証券	3,550,000	101.127578 米ドル	405,242,475	3.25
7	US TREASURY NOTE	2.125 2024/11/30	米国 債券 国債証券	3,000,000	98.523438 米ドル	333,639,770	2.68
8	FNCL 4.0 TBA 02/18	4.0 2048/2/1	米国 債券 その他債券	2,500,000	104.320308 米ドル	294,391,909	2.36
9	PORTUGAL GOVT EUR 144A LIFE/REG S	2.875 2025/10/15	ポルトガル 債券 国債証券	1,850,000	110.4537 ユーロ	275,463,616	2.21
10	CANADA GOVT CAD BOND	0.75 2021/3/1	カナダ 債券 国債証券	3,100,000	96.866 カナダ・ドル	269,648,190	2.16

11	JAPAN GVT 329 JPY BD	0.8 2023/6/20	日本 債券 国債証券	245,000,000	104.9121 日本円	257,034,645	2.06
12	IRELAND GOVT EUR	5.4 2025/3/13	アイルランド 債券 国債証券	1,200,000	135.3657 ユーロ	218,978,828	1.76
13	POLAND GOVT BOND PLN	5.75 2021/10/25	ポーランド 債券 国債証券	6,000,000	112.75 ポーランド・ズ ロチ	218,302,540	1.75
14	NYKREDIT DKK SR SEC SER 01E SF	2.0 2037/10/1	デンマーク 債券 その他債券	11,191,573	104.08 デンマーク・ク ローネ	210,905,410	1.69
15	SPAIN GOVT EUR	1.15 2020/7/30	スペイン 債券 国債証券	1,500,000	103.4136 ユーロ	209,113,063	1.68
16	POLAND GOVT BOND PLN	4.0 2023/10/25	ポーランド 債券 国債証券	5,900,000	106.635 ポーランド・ズ ロチ	203,021,847	1.63
17	US TREASURY I/L FRN	0.625 2024/1/15	米国 債券 国債証券	1,650,000	107.350615 米ドル	199,942,667	1.60
18	ITALY GOVT BTSP EUR	0.9 2022/8/1	イタリア 債券 国債証券	1,300,000	100.94166 ユーロ	176,899,271	1.42
19	FRANCE OAT EUR REG S	- 2021/5/25	フランス 債券 国債証券	1,250,000	101.0599 ユーロ	170,294,697	1.37
20	FNCL 4.5 TBA 02/18	4.5 2048/2/1	米国 債券 その他債券	1,250,000	106.179685 米ドル	149,819,535	1.20
21	KFW GLOBAL USD	2.125 2022/3/7	ドイツ 債券 国債証券	1,333,000	99.29853 米ドル	149,413,540	1.20
22	EUROPEAN INVT BK	2.25 2022/3/15	国際機関 債券 国債証券	1,325,000	99.579012 米ドル	148,936,345	1.19
23	FNCI 3.0 TBA 02/18	3.0 2033/2/1	米国 債券 その他債券	1,250,000	101.653953 米ドル	143,433,727	1.15
24	MALAYSIA GVT MYR	3.955 2025/9/15	マレーシア 債券 国債証券	5,100,000	99.4695 マレーシア・リ ンギット	140,748,181	1.13
25	US TREASURY NOTE	2.0 2022/10/31	米国 債券 国債証券	1,250,000	99.046875 米ドル	139,755,141	1.12
26	US TREASURY NOTE	1.125 2021/9/30	米国 債券 国債証券	1,250,000	96.414106 米ドル	136,040,304	1.09
27	US TREASURY NOTE	1.5 2019/11/30	米国 債券 国債証券	1,150,000	99.257812 米ドル	128,848,551	1.03
28	ITALY GOVT BTSP EUR (B)	0.95 2023/3/15	イタリア 債券 国債証券	900,000	100.4558 ユーロ	121,879,251	0.98
29	BONOS MEXICAN MXN	10.0 2024/12/5	メキシコ 債券 国債証券	18,000,000	112.504 メキシコ・ペソ	115,888,531	0.93
30	SPAIN GOVT EUR 144A LIFE/REG S	2.75 2024/10/31	スペイン 債券 国債証券	750,000	113.1188 ユーロ	114,368,993	0.92

(注) 投資比率は、キャピタル・グループ・グローバル・インターメディアイト・ボンド・ファンド(LUX)の純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

(参考) 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

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

平成29年7月24日現在

						評価額	投資
--	--	--	--	--	--	-----	----

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	単価 (円)	金額 (円)	比率 (%)
日本	第284回信金中金債	0.4	2018/7/27	特殊債券	100,000	100.388	100,388,000	4.40
日本	第41回東日本高速道路	0.005	2019/6/20	特殊債券	100,000	99.979	99,979,000	4.38
日本	第16回フランス相互信用連合銀行円貨社債(2015)	0.269	2018/10/15	社債券	100,000	100.148	100,148,000	4.39
日本	第1回ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー円貨社債(2016)	0.615	2021/12/15	社債券	100,000	100.899	100,899,000	4.42
日本	第9回モルガン・スタンレー円貨社債(2014)	0.557	2018/5/22	社債券	100,000	100.318	100,318,000	4.40
日本	第19回ルノー円貨社債(2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	100.008	100,008,000	4.38
日本	第11回現代キャピタル・サービズ・インク円貨社債(2015)	0.52	2017/10/30	社債券	100,000	100.023	100,023,000	4.38
日本	第1回ソシエテ・ジェネラル非上位円貨社債(2017)	0.448	2022/5/26	社債券	100,000	100.327	100,327,000	4.40
日本	第316回北海道電力	1.164	2020/6/25	社債券	100,000	102.89	102,890,000	4.51
日本	第10回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)	0.001	2020/2/28	社債券	100,000	99.769	99,769,000	4.37
日本	第9回アサヒグループホールディングス(特定社債間限定同順位特約付)	0.08	2020/6/12	社債券	100,000	99.885	99,885,000	4.38
日本	第4回富士フィルムホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.005	2020/3/3	社債券	100,000	99.675	99,675,000	4.37
日本	第50回日本電気(社債間限定同順位特約付)	0.29	2022/6/15	社債券	100,000	99.928	99,928,000	4.38
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	99.815	99,815,000	4.38
日本	第1回A号明治安田生命2012基金特定目的会社	0.85	2017/8/9	社債券	100,000	100.03	100,030,000	4.38
日本	第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	104.711	104,711,000	4.59
日本	第6回りそな銀行(劣後特約付)	2.084	2020/3/4	社債券	100,000	104.853	104,853,000	4.60

日本	第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	104.745	104,745,000	4.59
日本	第38回日産フィナンシャルサービス(社債間限定同順位特約付)	0.001	2019/6/20	社債券	100,000	99.593	99,593,000	4.37
日本	第67回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.5	2019/6/6	社債券	100,000	100.315	100,315,000	4.40
日本	第43回野村ホールディングス	0.454	2019/2/25	社債券	100,000	100.505	100,505,000	4.41
日本	第1回ファーストリテイリング(特定社債間限定同順位特約付)	0.11	2018/12/18	社債券	100,000	99.921	99,921,000	4.38

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

(注) 当該情報は委託会社が入手可能な直近日(平成29年7月24日)現在の情報です。

【投資不動産物件】

キャピタル・グローバル中期債ファンド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・グローバル中期債マザーファンド(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・グローバル中期債ファンド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・グローバル中期債マザーファンド(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・グローバル中期債ファンド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 (平成29年11月20日)	99,794	99,794	0.9979	0.9979

平成29年10月末日	99,816		0.9982	
11月末日	99,875		0.9988	
12月末日	6,889,059,482		0.9940	

(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・グローバル中期債ファンド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	平成29年10月17日～平成29年11月20日	0

【収益率の推移】

キャピタル・グローバル中期債ファンドF(米ドル売り円買い)

期	計算期間	収益率(%)
第1期	平成29年10月17日～平成29年11月20日	0.2

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

(4) 【設定及び解約の実績】

キャピタル・グローバル中期債ファンド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	平成29年10月17日～平成29年11月20日	100,000		100,000

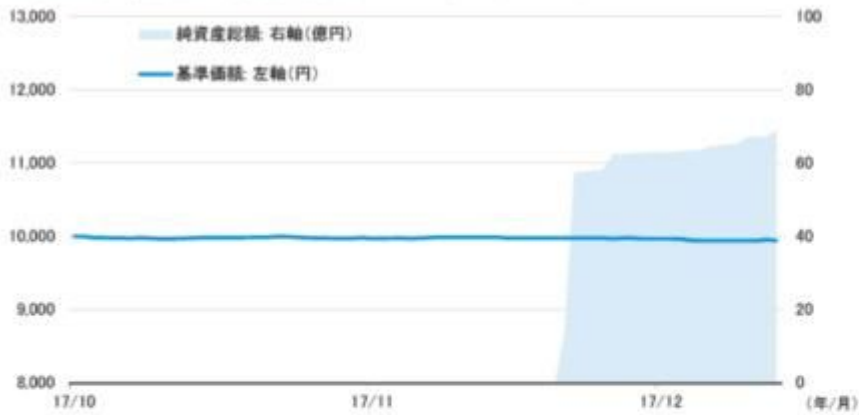
(注)第1期の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(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

2017年12月29日現在

基準価額・純資産の推移(設定～2017年12月29日)



分配金の推移

第1期	2017年11月	0円
	設定未累計	0円

分配金は1万円当たり、税引前

主要な資産の状況(2017年12月29日現在)

<キャピタル・グローバル中期債マザーファンド(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・インターミディエイト・ボンド・ファンド(LUX)(クラスC)-JPY)	99.90
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.09

<キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド(LUX)の主要な資産の状況等>

(2017年12月29日現在)

上位10銘柄

順位	銘柄名	国名/地域名	証券種別	投資比率(%)
1	DEUTSCHLAND REP EUR REG S (B) 2.0% 01-04-22	ドイツ	国債証券	5.45
2	US TREASURY NOTE 2.0% 11-30-22	米国	国債証券	5.06
3	JAPAN GVT 125 JPY BD 0.1% 06-20-21	日本	国債証券	4.28
4	FGLMC 4.0 TBA 02/18 02-01-48	米国	その他証券	3.40
5	US TREASURY NOTE 1.75% 11-30-21	米国	国債証券	3.34
6	US TREASURY I/L 0.375% 01-15-27	米国	国債証券	3.25
7	US TREASURY NOTE 2.125% 11-30-24	米国	国債証券	2.68
8	FNCL 4.0 TBA 02/16 02-01-46	米国	その他証券	2.36
9	PORTUGAL GOV'T EUR 144A LIFE/REG S 2.875% 10-15-25	ポルトガル	国債証券	2.21
10	CANADA GOV'T CAD BOND 0.75% 03-01-21	カナダ	国債証券	2.16

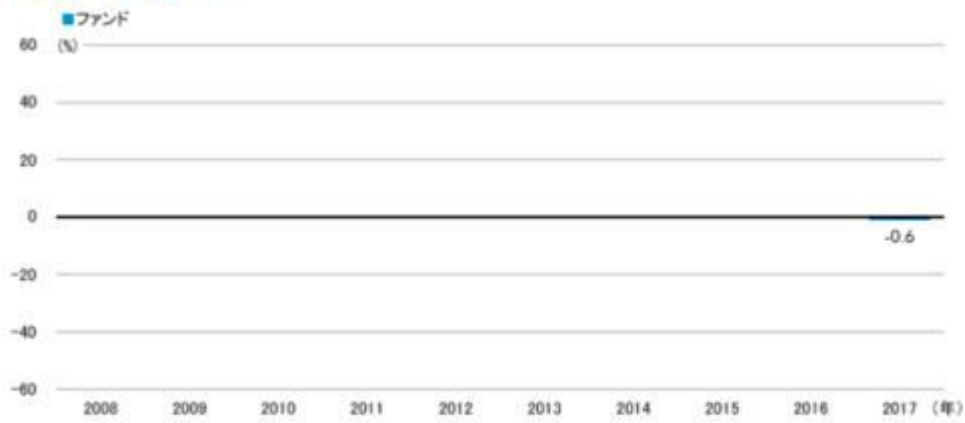
証券種別構成比率

証券種別	投資比率(%)
国債証券	66.74
社債券	16.87
その他証券	13.06
現金・その他	3.32

国別構成比率

国名	投資比率(%)
米国	41.4
ドイツ	8.24
日本	8.13
イタリア	3.90
ポーランド	3.82
その他国	31.24
現金・その他	3.32

年間収益率の推移



ファンドにはベンチマークはありません。

ファンドの年間収益率は、税引前分配金を再投資したものとして算出。

2017年は設定日から12月末までの収益率を表示。

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

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

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の第二部ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2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、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1期計算期間（平成29年10月17日から平成29年11月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【キャピタル・グローバル中期債ファンドF（米ドル売り円買い）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成29年11月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	100
親投資信託受益証券	99,729
流動資産合計	99,829
資産合計	99,829
負債の部	
流動負債	
未払委託者報酬	35
流動負債合計	35
負債合計	35
純資産の部	
元本等	
元本	100,000
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	206
元本等合計	99,794
純資産合計	99,794
負債純資産合計	99,829

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 平成29年10月17日 至 平成29年11月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	171

	第1期 自 平成29年10月17日 至 平成29年11月20日
営業収益合計	171
営業費用	
委託者報酬	35
営業費用合計	35
営業利益又は営業損失（ ）	206
経常利益又は経常損失（ ）	206
当期純利益又は当期純損失（ ）	206
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	206

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として毎年11月21日から翌年11月20日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、平成29年10月17日から平成29年11月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 平成29年11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		100,000口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	206円
3. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9979円 (9,979円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 平成29年10月17日 至 平成29年11月20日		
分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	- 円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	- 円
当ファンドの期末残存口数	F	100,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	- 円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 平成29年10月17日 至 平成29年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に基づき、有価証券等の金融商品に対して投資を行います。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(4)附属明細表」に記載しております。なお、当ファンドが実質保有する金融商品の種類から、当ファンドは、組入証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク、及びカントリーリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	委託会社において次の独立した組織によりリスク管理に取り組んでおります。 投資委員会は、運用内容が投資目的に則しているかを確認します。 法務コンプライアンス部は、運用状況についてファンドの基本方針及び運用計画等に基づくモニタリングを行い、管理徹底を図っております。 オペレーション部は、発注の適正な執行及び決済を図り、管理徹底に努めております。 なお、問題が生じた場合には、関係部署等が速やかに協議を行ない訂正処理等の必要な措置を講じます。
4. 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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	自 平成29年10月17日 至 平成29年11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	(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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期
	平成29年11月20日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	170
合計	170

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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)

当ファンドの計算期間における元本額の変動

項目	第1期
	自 平成29年10月17日 至 平成29年11月20日
設定元本額	100,000円
期中追加設定元本額	0円
期中一部解約元本額	0円

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表
株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	キャピタル・グローバル中期債マザーファンド（米ドル売り円買い）	99,899	99,729	
	合計	99,899	99,729	

(注) 券面総額の数値は受益証券の口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

キャピタル・グローバル中期債マザーファンド（米ドル売り円買い）

当ファンドは、「キャピタル・グローバル中期債マザーファンド（米ドル売り円買い）」受益証券を主要投資対象としており、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計算期間末日（以下「計算日」という。）における同マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

平成29年11月20日現在

資産の部	
流動資産	
投資信託受益証券	2,002
投資証券	97,727
流動資産合計	99,729
資産合計	99,729

平成29年11月20日現在

負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	99,899
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	170
元本等合計	99,729
純資産合計	99,729
負債純資産合計	99,729

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年11月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数		99,899口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	170円
3. 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	0.9983円
	(1万口当たり純資産額)	(9,983円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年10月17日 至 平成29年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に基づき、有価証券等の金融商品に対して投資を行います。

項目	自 平成29年10月17日 至 平成29年11月20日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。なお、当ファンドが実質保有する金融商品の種類から、当ファンドは、組入証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク、及びカントリーリスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>委託会社において次の独立した組織によりリスク管理に取り組んでおります。投資委員会は、運用内容が投資目的に則しているかを確認します。</p> <p>法務コンプライアンス部は、運用状況についてファンドの基本方針及び運用計画等に基づくモニタリングを行い、管理徹底を図っております。</p> <p>オペレーション部は、発注の適正な執行及び決済を図り、管理徹底に努めております。</p> <p>なお、問題が生じた場合には、関係部署等が速やかに協議を行ない訂正処理等の必要な措置を講じます。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>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。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	自 平成29年10月17日 至 平成29年11月20日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) 投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成29年11月20日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	2
投資証券	169
合計	167

(注)「当計算期間の損益に含まれた評価差額」の欄には、当親投資信託の期首から計算日までの期間の評価差額を記載しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

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計算期間における当該親投資信託の元本額の変動及び計算日の元本の内訳

項目	平成29年11月20日現在
同計算期間の期首元本額	100,000円
同計算期間の追加設定元本額	- 円
同計算期間の一部解約元本額	101円
計算日の元本額	99,899円
元本額の内訳	
キャピタル・グローバル中期債ファンドF（米ドル売り円買い）	99,899円

附属明細表

第1 有価証券明細表
株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
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）	1,899.00	2,002	
投資信託受益証券 合計		1,899.00	2,002	

投資証券	キャピタル・グループ・グローバル・インターミ ディエイト・ボンド・ファンド(LUX)(クラス Ch-JPY)	84.98	97,727	
投資証券 合計		84.98	97,727	
	合計	1,983.98	99,729	

(注)券面総額の数値は受益証券の口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド(LUX)

「キャピタル・グローバル中期債マザーファンド(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・インターミディエイト・ボンド・ファンド(LUX)(クラスCh JPY)」(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、2016年12月31日付けで、ルクセンブルクにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務書類が作成されております。この財務書類は独立監査人であるプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コオペラティブの監査を受けております。以下の「投資明細表」「純資産価額計算書」「損益および純資産変動計算書」および「投資証券口数変動計算書」等は、原文の財務書類から委託会社が抜粋・翻訳したものでありますが、これらは監査意見の対象外であります。

キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド(LUX)

投資明細表

2016年12月31日現在

投資銘柄	通貨	数量/額面	評価額 USD	投資比率 (%)
公的な市場に上場している譲渡可能な有価証券と短期金融商品				
債券				
オーストラリア				
Australia Government Bond, Reg. S 5.75% 15/05/2021	AUD	700,000	581,260	2.35
Scentre Group Trust 1, REIT, Reg. S 2.375% 08/04/2022	GBP	100,000	128,742	0.52
			710,002	2.87
ベルギー				
Belgium Government Bond, Reg. S, 144A 1.125% 03/08/2019	USD	200,000	196,947	0.79
			196,947	0.79
チリ				
Enel Americas SA 4% 25/10/2026	USD	10,000	9,581	0.04
			9,581	0.04
デンマーク				
Nykredit Realkredit A/S 2% 01/10/2037	DKK	4,000,000	576,667	2.33
			576,667	2.33
フランス				
AXA SA, Reg. S, FRN 5.25% 16/04/2040	EUR	100,000	117,371	0.47
BPCE SA, Reg. S 4.625% 18/07/2023	EUR	100,000	124,355	0.50

France Government Bond, Reg. S 0% 25/05/2021	EUR	150,000	160,473	0.65
Veolia Environnement SA 4.247% 06/01/2021	EUR	100,000	122,881	0.50
			525,080	2.12
ドイツ				
Allianz SE, Reg. S, FRN 4.75% Perpetual	EUR	100,000	116,902	0.47
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 2% 04/01/2022	EUR	750,000	891,422	3.60
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1% 07/09/2018	USD	350,000	347,755	1.41
Landwirtschaftliche Rentenbank 2% 06/12/2021	USD	140,000	138,662	0.56
Merck Financial Services GmbH, Reg. S 1.375% 01/09/2022	EUR	100,000	111,517	0.45
			1,606,258	6.49
ハンガリー				
Hungary Government Bond 4% 25/03/2019	USD	100,000	103,677	0.42
Hungary Government Bond 7.5% 12/11/2020	HUF	70,000,000	294,855	1.19
			398,532	1.61
アイルランド				
CRH Finance DAC, Reg. S 3.125% 03/04/2023	EUR	100,000	120,964	0.49
Ireland Government Bond 5.4% 13/03/2025	EUR	200,000	292,949	1.18
			413,913	1.67
イタリア				
Intesa Sanpaolo SpA, Reg. S 6.625% 13/09/2023	EUR	100,000	125,195	0.51
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.75% 01/05/2021	EUR	250,000	300,736	1.21
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 15/09/2022	EUR	200,000	217,810	0.88
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA, Reg. S 0.875% 02/02/2022	EUR	100,000	107,543	0.43
			751,284	3.03

キャピタル・グループ・グローバル・インターメディエイト・ボンド・ファンド(LUX)(続き)

投資明細表

2016年12月31日現在

投資銘柄	通貨	数量/ 額面	評価額 USD	投資比率 (%)
日本				
American Honda Finance Corp. 1.375% 10/11/2022	EUR	100,000	110,969	0.45
Japan Government Five Year Bond 0.3% 20/06/2018	JPY	80,000,000	690,626	2.79
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/06/2021	JPY	100,000,000	864,706	3.49
Japan Government Ten Year Bond 0.8% 20/06/2023	JPY	45,000,000	407,324	1.65
Toyota Motor Credit Corp. 1.55% 18/10/2019	USD	100,000	98,967	0.40
			2,172,592	8.78
メキシコ				
Mexican Bonos 6.5% 10/06/2021	MXN	8,000,000	378,497	1.53
Mexican Udibonos 4% 13/06/2019	MXN	1,000,000	281,103	1.14
Mexico Government Bond 3.625% 15/03/2022	USD	200,000	200,940	0.81
			860,540	3.48
オランダ				
Cooperatieve Rabobank UA, Reg. S 3.875% 25/07/2023	EUR	100,000	121,468	0.49
			121,468	0.49
ノルウェー				
Norway Government Bond, Reg. S, 144A 3.75% 25/05/2021	NOK	4,000,000	517,726	2.09
Statoil ASA 2.75% 10/11/2021	USD	250,000	252,191	1.02
			769,917	3.11
ポーランド				

Poland Government Bond 5.75% 25/10/2021	PLN	2,500,000	675,001	2.73
			675,001	2.73
スロベニア				
Slovenia Government Bond, Reg. S 4.75% 10/05/2018	USD	250,000	259,341	1.05
			259,341	1.05
スペイン				
BBVA Subordinated Capital SAU, Reg. S, FRN 3.5% 11/04/2024	EUR	100,000	110,181	0.44
CaixaBank SA, Reg. S, FRN 5% 14/11/2023	EUR	100,000	111,323	0.45
Iberdrola International BV, Reg. S 2.875% 11/11/2020	EUR	100,000	116,289	0.47
Spain Government Bond 1.15% 30/07/2020	EUR	750,000	822,040	3.32
			1,159,833	4.68
国際機関				
European Investment Bank 1.375% 15/09/2021	USD	250,000	240,518	0.97
			240,518	0.97
スウェーデン				
Sweden Government Bond 3.5% 01/06/2022	SEK	2,000,000	264,383	1.07
			264,383	1.07
英国				
Barclays Bank plc, Reg. S 10% 21/05/2021	GBP	50,000	79,055	0.32
HSBC Holdings plc, Reg. S, FRN 3.375% 10/01/2024	EUR	100,000	110,584	0.45
National Grid Gas Finance plc, Reg. S 1.125% 22/09/2021	GBP	100,000	123,289	0.50

キャピタル・グループ・グローバル・インターメディエイト・ボンド・ファンド(LUX)(続き)

投資明細表

2016年12月31日現在

投資銘柄	通貨	数量/額面	評価額 USD	投資比率 (%)
RSA Insurance Group plc, FRN 9.375% 20/05/2039	GBP	50,000	71,812	0.29
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 1.9% 23/09/2019	USD	150,000	148,091	0.60
UK Treasury, Reg. S 1% 07/09/2017	GBP	150,000	187,017	0.75
UK Treasury, Reg. S 3.75% 07/09/2021	GBP	250,000	356,417	1.44
UK Treasury, Reg. S 2.25% 07/09/2023	GBP	150,000	203,295	0.82
			1,279,560	5.17
米国				
AbbVie, Inc. 2.5% 14/05/2020	USD	100,000	100,386	0.41
Actavis Funding SCS 3% 12/03/2020	USD	150,000	152,111	0.62
Altria Group, Inc. 4.75% 05/05/2021	USD	50,000	54,436	0.22
AT&T, Inc. 2.8% 17/02/2021	USD	100,000	99,342	0.40
Bank of America Corp. 2.625% 19/04/2021	USD	100,000	99,392	0.40
Consumers Energy Co. 5.65% 15/04/2020	USD	1,000	1,101	-
Exelon Corp. 2.45% 15/04/2021	USD	100,000	98,507	0.40
Ford Motor Credit Co. LLC 1.897% 12/08/2019	USD	200,000	196,738	0.80
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 2.35% 15/11/2021	USD	100,000	97,221	0.39
J.P Morgan Chase & Co. 2.4% 07/06/2021	USD	100,000	98,891	0.40
Kimco Realty Corp., REIT 2.7% 01/03/2024	USD	20,000	19,163	0.08
Morgan Stanley 2.5% 21/04/2021	USD	100,000	98,747	0.40
Newell Brands, Inc. 3.15% 01/04/2021	USD	100,000	101,965	0.41
NV Energy, Inc. 6.25% 15/11/2020	USD	100,000	113,381	0.46
Prologis LP 1.375% 13/05/2021	EUR	100,000	109,514	0.44
Public Service Enterprise Group, Inc. 1.6% 15/11/2019	USD	100,000	98,544	0.40

Reynolds American, Inc. 3.25% 12/06/2020	USD	100,000	102,459	0.41
US Treasury 0.75% 31/10/2018	USD	250,000	248,140	1.00
US Treasury 0.875% 15/09/2019	USD	500,000	493,320	1.99
US Treasury 1.125% 30/09/2021	USD	1,750,000	1,685,605	6.81
US Treasury Inflation Indexed 0.125% 15/04/2021	USD	600,000	614,772	2.48
Verizon Communications, Inc. 1.75% 15/08/2021	USD	100,000	95,831	0.39
Williams Partners LP 4.5% 15/11/2023	USD	100,000	102,618	0.42
Xcel Energy, Inc. 2.6% 15/03/2022	USD	100,000	99,563	0.40
			4,981,747	20.13

債券合計 **17,973,164** **72.61**

公的な市場に上場している譲渡可能な有価証券と短期金融商品の合計 **17,973,164** **72.61**

その他の規制のある市場で取引されている譲渡可能な有価証券と短期金融商品

債券

カナダ

Canada Government Bond 0.75% 01/03/2021	CAD	900,000	661,188	2.67
Enbridge, Inc. 4.25% 01/12/2026	USD	25,000	25,541	0.10
			686,729	2.77

フランス

BNP Paribas SA 5% 15/01/2021	USD	50,000	54,351	0.22
			54,351	0.22

キャピタル・グループ・グローバル・インターメディエイト・ボンド・ファンド(LUX)(続き)

投資明細表

2016年12月31日現在

投資銘柄	通貨	数量/ 額面	評価額 USD	投資比率 (%)
マレーシア				
Malaysia Government Bond 4.24% 07/02/2018	MYR	223,000	50,155	0.20
Malaysia Government Bond 3.58% 28/09/2018	MYR	1,829,000	407,318	1.65
Malaysia Government Bond 3.659% 15/10/2020	MYR	452,000	100,721	0.41
			558,194	2.26
米国				
Amgen, Inc. 1.85% 19/08/2021	USD	150,000	144,331	0.58
Celgene Corp. 2.875% 15/08/2020	USD	100,000	101,053	0.41
FHLMC G08730 4.5% 01/10/2046	USD	764,400	821,646	3.32
FHLMC Q44363 4.5% 01/11/2046	USD	799,015	859,914	3.47
Gilead Sciences, Inc. 3.25% 01/09/2022	USD	50,000	51,037	0.21
Microsoft Corp. 1.1% 08/08/2019	USD	150,000	148,081	0.60
US Treasury Inflation Indexed 0.625% 15/01/2024	USD	1,000,000	1,051,408	4.25
			3,177,470	12.84
債券合計			4,476,744	18.09
その他の規制のある市場で取引されている譲渡可能な有価証券と短期金融商品の合計			4,476,744	18.09

新規発行証券

債券

スウェーデン

Nordea Bank AB, Reg. S 1.625% 30/09/2019	USD	200,000	197,208	0.80
			197,208	0.80

スイス

Roche Holdings, Inc., Reg. S 1.75% 28/01/2022	USD	200,000	192,720	0.78
			192,720	0.78

米国					
Metropolitan Life Global Funding I, Reg. S 1.75%	19/12/2018	USD	150,000	150,103	0.60
				150,103	0.60
債券合計				540,031	2.18
新規発行証券合計				540,031	2.18

UCITS準拠ファンド、もしくは他の譲渡可能証券への集合投資事業

集団投資スキーム- UCITS

ルクセンブルク

JPMorgan US Dollar Treasury Liquidity - Institutional (dist.)	USD	1,590,162	1,590,162	6.42	
				1,590,162	6.42

キャピタル・グループ・グローバル・インターメディアイト・ボンド・ファンド(LUX)(続き)

投資明細表

2016年12月31日現在

投資銘柄	通貨	数量/ 額面	評価額 USD	投資比率 (%)
集団投資スキーム合計- UCITS			1,590,162	6.42
UCITS準拠ファンド、もしくは他の譲渡可能証券への集合投資事業合計			1,590,162	6.42
投資総額			24,580,101	99.30
銀行預金			(35,996)	(0.15)
その他の純資産/(負債)			208,691	0.85
純資産総額			24,752,796	100.00

TBA

国	投資銘柄	通貨	額面	評価額 USD	未実現利益/(損失) USD	投資比率 %
米国	FNMA, 3.50%, 25/01/2046	USD	800,000	818,375	(1,875)	3.31
TBA ロングポジションの合計				818,375	(1,875)	3.31
TBA 総額				818,375	(1,875)	3.31

金利スワップ

額面	通貨	カウンター・ パーティ	投資銘柄	決済日	評価額 USD	未実現利 益/(損 失) USD	投資比率 %
500,000	USD	Citigroup	Pay fixed 1.577% Receive floating LIBOR 3 month	17/10/2026	34,132	34,132	0.14
750,000	EUR	Citigroup	Pay fixed 0.105% Receive floating EURIBOR 6month	17/10/2023	9,060	9,060	0.03

250,000	GBP	Citigroup	Pay fixed Receive floating LIBOR 6 month	0.846%	09/11/2021	171	171	-
金利スワップの未実現益合計						43,363	43,363	0.17
250,000	GBP	Citigroup	Pay fixed 1.430% Receive floating LIBOR 6 month		18/11/2026	(6,564)	(6,564)	(0.03)
2,800,000	USD	Citigroup	Pay floating LIBOR 3 month Receive fixed 1.376%		16/12/2018	(4,173)	(4,173)	(0.02)
500,000	EUR	Citigroup	Pay fixed 0.703% Receive floating EURIBOR 6 month		22/11/2026	(4,042)	(4,042)	(0.01)
300,000	USD	Citigroup	Pay fixed 2.471% Receive floating LIBOR 3 month		19/12/2026	(2,653)	(2,653)	(0.01)
金利スワップの未実現損合計						(17,432)	(17,432)	(0.07)
金利スワップの未実現損益総額						25,931	25,931	0.10

キャピタル・グループ・グローバル・インターメディエイト・ボンド・ファンド(LUX)(続き)

投資明細表

2016年12月31日現在

先物為替予約

買通貨	購入総額	売通貨	売却総額	決済日	カウンター・ パーティ	未実現利益 /(損失) USD	投資比率 %
USD	295,749	NOK	2,500,000	06/01/2017	Bank of America	5,369	0.02
USD	2,207,700	JPY	250,000,000	12/01/2017	BNY Mellon	64,488	0.26
USD	474,845	MYR	2,100,000	13/01/2017	Credit Suisse	6,719	0.03
USD	1,625,007	GBP	1,300,000	19/01/2017	Citibank	14,285	0.06
USD	1,010,630	CAD	1,350,000	20/01/2017	Bank of America	5,355	0.02
USD	871,080	AUD	1,200,000	23/01/2017	Bank of America	4,111	0.02
先物為替予約の未実現益						100,327	0.41
先物為替予約の未実現益合計						100,327	0.41
USD	277,071	HUF	81,650,000	06/01/2017	Credit Suisse	(1,613)	(0.01)
USD	594,898	PLN	2,500,000	09/01/2017	Credit Suisse	(3,291)	(0.01)
USD	163,159	SEK	1,500,000	09/01/2017	BNY Mellon	(2,568)	(0.01)
USD	521,550	EUR	500,000	19/01/2017	Bank of America	(6,494)	(0.03)
USD	4,282,926	EUR	4,100,000	19/01/2017	Citibank	(47,035)	(0.19)
USD	580,223	MXN	12,000,000	19/01/2017	Credit Suisse	(65)	-
USD	534,278	DKK	3,800,000	23/01/2017	Bank of America	(5,686)	(0.02)
先物為替予約の未実現損						(66,752)	(0.27)
先物為替予約の未実現損合計						(66,752)	(0.27)
先物為替予約の未実現損益総額						33,575	0.14

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド（LUX）

純資産価額計算書

2016年12月31日現在

（USD）

資産	
投資有価証券（時価）(注記2b)	24,580,101
TBA取引に係る投資有価証券（時価）（注記2f）	818,375
銀行預金	24,712
投資証券引受に係る未収入金	
未収配当金および未収利息（源泉徴収税額控除後）(注記2d,5b)	154,137
前払費用およびその他未収入金	26,774
ヘッジ・エクイバレント・クラスの為替予約取引に係る未実現益（注記7）	
投資有価証券売却に係る未収入金	
先物為替予約取引に係る未実現益（注記6）	33,575
スワップ取引に係る未実現益（注記8,9）	25,931
TBA取引に係る未収入金（注記2f）	
先物為替予約取引に係る未収入金	8,292
資産合計	25,671,897
負債	
投資有価証券買入に係る未払金	
TBA取引に係る未払金（注記2f）	820,250
未払費用およびその他未払金	28,048
未払運用報酬（注記3a）	10,095
投資証券買戻に係る未払金	
ヘッジ・エクイバレント・クラスの為替予約取引に係る未実現損（注記7）	
当座貸越 ¹	60,708
先物為替予約取引に係る未実現損（注記6）	
先物為替予約取引に係る未払金	
負債合計	919,101

純資産合計	24,752,796
投資簿価金額	26,350,887

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

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

キャピタル・グループ・グローバル・インターメディアイト・ボンド・ファンド(LUX)

損益および純資産変動計算書

2016年12月31日現在

(USD)

収益 (注記2d)	
受取配当金 (源泉徴収税額控除後) (注記5b)	531
債券および転換社債に係る利息 (源泉徴収税額控除後) (注記5b)	66,148
その他収益 (注記5b)	
銀行預金利息	13
収益小計	66,692
費用	
運用報酬 (注記3a)	26,359
管理手数料 (注記3b)	4,940
専門家サービス	16,131
年次税 (注記5a)	2,637
デポジタリー・カストディ費用およびファンド管理手数料(注記3b)	1,585
印刷費用	958
その他費用	4,835
スワップ取引 (注記8、9)	
費用小計	57,445
費用の払戻し (注記3d)	26,749
投資純利益 / (損失) (a)	35,996
実現純利益 / (損失)	
投資有価証券の売却取引に係る実現純(損)益 (注記2e)	(35,186)
為替取引に係る実現純(損)益 (注記2c)	666,626
スワップ取引に係る実現純(損)益 (注記8)	1,000
当期実現純利益 / (損失) (b)	632,440
未実現評価利益 / (損失)の増減	
投資有価証券に係る未実現評価(損)益の増減	(952,411)
為替取引に係る未実現評価(損)益の増減 (注記2c)	31,729
当期末実現評価利益 / (損失)の増減 : (c)	(920,682)
当期損益 (a+b+c)	(252,246)

配当金の分配（注記4）

当期投資証券の差引増減額	25,005,042
期首純資産総額	
期末純資産総額	24,752,796

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

キャピタル・グループ・グローバル・インターメディアイト・ボンド・ファンド（LUX）

投資証券口数変動計算書

2016年12月31日現在

クラスC

期首投資証券口数	
引受投資証券口数	5,000
買戻し投資証券口数	
期末投資証券口数	5,000

クラスZ

期首投資証券口数	
引受投資証券口数	2,495,505
買戻し投資証券口数	
期末投資証券口数	2,495,505

期末投資証券口数 総合計	2,500,505
---------------------	------------------

キャピタル・インターナショナル・ファンド

財務書類に関する注記

2016年12月31日現在

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

a. 法制

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

b. ファンド

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

- キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（LUX）
- キャピタル・グループ・ジャパン・エクイティ・ファンド（LUX）
- キャピタル・グループ・アジア・パシフィック（除く日本）・エクイティ・ファンド（LUX）
- キャピタル・グループ・ワールド・ディビデンド・グロウーズ（LUX）
- キャピタル・グループ・グローバル・グロース・アンド・インカム・ファンド（LUX）
- キャピタル・グループ・ヨーロピアン・グロース・アンド・インカム・ファンド（LUX）
- キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド（LUX）
- キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（LUX）
- キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド（LUX）
- キャピタル・グループ・ユーロ・ボンド・ファンド（LUX）
- キャピタル・グループ・ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド（LUX）
- キャピタル・グループ・ニューパースペクティブ・ファンド（LUX）
- キャピタル・グループ・グローバル・アブソリュート・インカム・グロワー（LUX）（設定日2016年4月1日）
- キャピタル・グループ・インベストメント・カンパニー・オブ・アメリカ（LUX）（設定日2016年6月17日）

キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド(LUX)(設定日 2016年10月28日)

キャピタル・グループ・グローバル・インターメディエイト・ボンド・ファンド(LUX)(設定日2016年10月13日)

2016年1月25日付で、キャピタル・グループ・ユーロ・クレジット・ファンド(LUX)はキャピタル・グループ・ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド(LUX)に名称変更された。

2016年3月31日付で、キャピタル・インターナショナル・ポートフォリオ 2-キャピタル・グループ・グローバル・アブソリュート・インカム・グロワー(LUX)は定款第26条および目論見書に従い、キャピタル・グループ・グローバル・アブソリュート・インカム・グロワー(LUX)へ統合された。

2016年6月17日付で、キャピタル・グループ・US・グロース・アンド・インカム・ファンド(LUX)はキャピタル・グループ・インベストメント・カンパニー・オブ・アメリカ(LUX)に統合された。

c. 投資証券クラスおよび通貨

各ファンドは、A、A2、A4、A7、A9、A11、B、C、N、T、X、Z、Z Lのクラスに分かれる。また、いくつかのクラスはエクイバレント・クラスにさらに分かれる。

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

ファンドの会計通貨(財務会計用の通貨であり、基準通貨とは異なることもある)は、米ドルであるキャピタル・グループ・ニューパースペクティブ・ファンド、キャピタル・グループ・グローバル・アブソリュート・インカム・グロワー、キャピタル・グループ・インベストメント・カンパニー・オブ・アメリカ、キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド、およびキャピタル・グループ・グローバル・インターメディエイト・ボンド・ファンドを除き、ユーロである。基準通貨はファンドが投資目的に保有する現金の通貨である。

連結純資産価額計算書、並びに連結損益および純資産変動計算書は、各サブ・ファンドの純資産価額計算書、並びに損益および純資産変動計算書を、2016年12月31日現在の為替レートで会計通貨に換算し合計したものである。

d. 配当方針

・クラスA、A2、A4、A7、A9、A11、B、C、N、T、X、Z、Z L並びにヘッジ・エクイバレント・クラスは、現在配当金の分配を行なわないクラスである。

・分配型エクイバレント・クラス、並びに分配型ヘッジ・エクイバレント・クラスは、取締役会により配当金を分配するよう推奨されているクラスである。

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

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

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

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

詳細については、財務書類に関する注記4に開示している。

e. 会計年度

CIFの会計年度は1月1日に開始し、12月31日に終了する。

2) 重要な会計方針

a. 基本事項

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

b. 投資有価証券の評価

下記()に該当する場合を除き、公的な証券取引所に上場している有価証券またはその他の規制のある市場で取引されている有価証券は、ファンドの純資産計算日における各有価証券の主要取引市場で発表される直近の相場もしくはその時点で入手可能な価格、または取締役会が承認した価格情報会社より提供される直近の相場もしくはその時点で入

手可能な価格を用いて評価される。また、その他の有価証券は、一もしくは複数のディーラーまたは価格情報会社から提供された価格、もしくは同等の利回り相当額により評価される。

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

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

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

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

c. 外貨

ユーロ以外の通貨建て資産および負債は、2016年12月31日現在の為替レートでユーロに換算されている。また、ユーロ以外の通貨での期中取引は、取引時の為替レートでユーロに換算されている。2015年12月31日から2016年12月31日までの期間の、未決済の先物為替予約並びにその他資産および負債に係る未実現純利益または損失の変動は、「為替取引に係る未実現評価(損)益の増減」に開示されている。当期中に満期となった先物為替予約を含め、為替に係る実現純利益または損失は、「為替取引に係る実現純(損)益」に開示されている。

2016年12月31日の適用為替レートは1.055019966米ドル/ユーロ、キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド(LUX)は1.052649984米ドル/ユーロが適用された。

d. 収益

配当金は、当該有価証券の配当落ち日に計上され、受取利息は日割計算で計上されている。2016年1月1日より、転換社債、減債基金付社債、減債基金付コーラブル債、インデックス連動債、インフレ連動債、利付債、ユニタイズド・ボンドのプレミアムおよびディスカウントは実効金利法で償却される。その他の確定利付証券のプレミアムおよびディスカウントは引き続き定額法で償却される。

e. 投資有価証券の売却に係る実現利益または損失

投資有価証券の売却に係る実現利益または損失は平均取得原価に基づき算出されている。2016年1月1日付けで確定利付証券の売却による利益および損失の計算方法を平均取得原価法から先入先出法に変更した。

f. モーゲージ証券-To Be Announced取引(TBA取引)

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

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

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

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

g. スイング・プライシング調整

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

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

3) 費用

a. 運用報酬

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

投資証券クラス

	A, エクイバレン ト・クラス	A2, エクイバレン ト・クラス	A4, エクイバレン ト・クラス	A7, エクイバレン ト・クラス	A9, エクイバレン ト・クラス	A11, エクイバレン ト・クラス	B, エクイバレン ト・クラス	C, エクイバレン ト・クラス ²	N, エクイバレン ト・クラス	T, エクイバレン ト・クラス	X, エクイバレン ト・クラス	Z, エクイバレン ト・クラス	ZL, エクイバレン ト・クラス
キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ファンド (LUX)	- ¹	- ¹	0.375%	0.35%	0.29%	0.25%	1.00%	-	1.50%	1.15%	- ¹	0.50%	- ¹

¹ 無効なシェア・クラス。

² クラスC、並びにエクイバレント・クラスへの投資は、運用報酬に関する個別契約の締結が必須となる。

b. デポジタリー・カストディ費用およびファンド管理手数料

ファンドは、デポジタリー・カストディアンおよび管理会社としてJ.P. Morgan Bank Luxembourg S.A.を任命している。デポジタリー・カストディ費用およびファンド管理手数料はファンドの総資産に応じて異なるほか、カストディ費用はポートフォリオの国別構成比に応じて異なる。

CIFは以下の年間実効料率にてカストディ・デポジタリー費用およびファンド管理手数料を支出した。なお、料率は期中平均純資産額に基づいて算出されている。

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

c. 関係会社との取引

損益および純資産変動計算書上の「専門家サービス」は、2016年12月31日で終了する年度に受けた管理サービス料として管理会社から請求された総額819,148ユーロを含む。

d. 費用の払戻し

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

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

年率0.06% - クラスA、A2、A4、A7、A9並びに各エクイバレント・クラス

年率0.39% - クラスB、T、N、X並びに各エクイバレント・クラス

年率0.15% - 以下のファンドにおけるクラスC、Z、ZL並びに各エクイバレント・クラス

キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド (LUX)、キャピタル・グループ・ユーロ・ボンド・ファンド (LUX)、キャピタル・グループ・ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド (LUX)、キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド (LUX) を除く全てのファンド

年率0.10% - 以下のファンドにおけるクラスC、Z並びに各エクイバレント・クラス

キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド (LUX)、キャピタル・グループ・ユーロ・ボンド・ファンド (LUX)、キャピタル・グループ・ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド (LUX)、キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド (LUX)

年率0.00% - キャピタル・グループ・ニューパースペクティブ・ファンド (LUX)のクラスC ad並びに各エクイバレント・クラス

2016年12月31日現在、ファンドで日々発生し、管理会社によって払戻される金額の合計は以下に示すとおりである。また、この払戻に係る方針は管理会社の決定により随時変更または取り下げることができる。

(USD)

キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド (LUX)	26,749
--	--------

4) 配当金の分配

配当方針の詳細は、財務書類に関する注記の1) dに記載がある。

5) 税金

a. 年次税

ルクセンブルクにおいて、CIFは、各ファンドの各投資証券クラスの純資産総額に対して課される年率0.05%のみが年次税として徴収される。しかし、機関投資家専用の投資証券クラスについては、ルクセンブルクの法律で規定されるように、年率0.01%の軽減税率が2016年12月31日決算のクラスA、A2、A4、A7、A9、C、並びに各エクイバレント・クラスに適用された。この軽減税率の適用が今後否認されないという保証はなく、また一度適用されたことが将来にわたる継

続を保証するものではない。年次税は日割で計上され、四半期ごとに支払われ、四半期末の各クラスの純資産総額を基に算定されている。

b. 外国税額

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

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

一定条件の下、CIFは、適用される租税措置において申請価値があると見なした場合は、各国の税務当局へ還付申請を行うことがある。これらの申請は性質として複雑であり、各地域の手続規定および判例法が適用される。不確実性が見込まれた場合、ルクセンブルクで適用される会計原則に従い、CIFは見込みでの税還付を未収計上しない。還付が確定すると、源泉徴収税やキャピタルゲイン税還付金は確定通知に基づき「その他収益」、あるいは「投資有価証券の売却取引に係る実現純益」として計上される。

6) 先物為替予約

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

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

7) ヘッジ・エクイバレント・クラス

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

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

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

これらのクラスは "h" およびヘッジされている通貨が記載されている。

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

8) クレジット・デフォルト・スワップ

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

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

9) 金利スワップ

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

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

10) リスクエクスポージャーの算出方法

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

11) 取引費用

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

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

日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

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

なお、同ファンド(「日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)」)は、三菱UFJ国際投信株式会社の委嘱に基づき、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に準じて、設定日(平成19年9月26日)より各計算期間の財務諸表について、監査を受けております。なお、直近の計算期間は平成28年7月23日から平成29年7月24日までとなっております。ただし、同マザーファンド(「日本短期債券マザーファンド」)は当該監査の対象ではありません。

「日本短期債券マザーファンド」の組入る有価証券の状況

(有価証券明細表)

(平成29年7月24日現在)

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額	
						単価(円)	評価金額 (円)
日本	第284回信金中金債	0.4	2018/7/27	特殊債券	100,000	100.388	100,388,000
日本	第41回東日本高速道路	0.005	2019/6/20	特殊債券	100,000	99.979	99,979,000
日本	第16回フランス相互信用連合銀行円貨社債(2015)	0.269	2018/10/15	社債券	100,000	100.148	100,148,000
日本	第1回ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー円貨社債(2016)	0.615	2021/12/15	社債券	100,000	100.899	100,899,000
日本	第9回モルガン・スタンレー円貨社債(2014)	0.557	2018/5/22	社債券	100,000	100.318	100,318,000
日本	第19回ルノー円貨社債(2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	100.008	100,008,000
日本	第11回現代キャピタル・サービス・インク円貨社債(2015)	0.52	2017/10/30	社債券	100,000	100.023	100,023,000
日本	第1回ソシエテ・ジェネラル非上位円貨社債(2017)	0.448	2022/5/26	社債券	100,000	100.327	100,327,000
日本	第316回北海道電力	1.164	2020/6/25	社債券	100,000	102.89	102,890,000
日本	第10回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)	0.001	2020/2/28	社債券	100,000	99.769	99,769,000

日本	第9回アサヒグループホールディングス(特定社債間限定同順位特約付)	0.08	2020/6/12	社債券	100,000	99.885	99,885,000
日本	第4回富士フイルムホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.005	2020/3/3	社債券	100,000	99.675	99,675,000
日本	第50回日本電気(社債間限定同順位特約付)	0.29	2022/6/15	社債券	100,000	99.928	99,928,000
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	99.815	99,815,000
日本	第1回A号明治安田生命2012基金特定目的会社	0.85	2017/8/9	社債券	100,000	100.03	100,030,000
日本	第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	104.711	104,711,000
日本	第6回りそな銀行(劣後特約付)	2.084	2020/3/4	社債券	100,000	104.853	104,853,000
日本	第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	104.745	104,745,000
日本	第38回日産フィナンシャルサービス(社債間限定同順位特約付)	0.001	2019/6/20	社債券	100,000	99.593	99,593,000
日本	第67回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.5	2019/6/6	社債券	100,000	100.315	100,315,000
日本	第43回野村ホールディングス	0.454	2019/2/25	社債券	100,000	100.505	100,505,000
日本	第1回ファーストリテイリング(特定社債間限定同順位特約付)	0.11	2018/12/18	社債券	100,000	99.921	99,921,000
合 計					2,200,000		2,218,725,000

2【ファンドの現況】

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

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

キャピタル・グローバル中期債ファンドF(米ドル売り円買い)

平成29年12月29日現在

資産総額	7,179,371,048円
負債総額	290,311,566円
純資産総額(-)	6,889,059,482円

発行済口数	6,930,658,085口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9940円

（参考）キャピタル・グローバル中期債マザーファンド（米ドル売り円買い）

平成29年12月29日現在

資産総額	6,978,939,014円
負債総額	278,278,000円
純資産総額（ - ）	6,700,661,014円
発行済口数	6,729,386,081口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9957円

（参考）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

平成29年7月24日現在

資産総額	153,926,448円
負債総額	98,345円
純資産総額（ - ）	153,828,103円
発行済口数	146,051,273口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0532円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

(1) 資本金の額（2017年7月31日現在）

（中略）

過去5年間における資本金の額の増減

2012年7月 資本金の額46億6,500万円から9,000万円に減資

（中略）

(2) 会社の機構（2017年7月31日現在）

会社の意思決定機構

（中略）



（以下略）

<訂正後>

(1) 資本金の額（2017年12月29日現在）

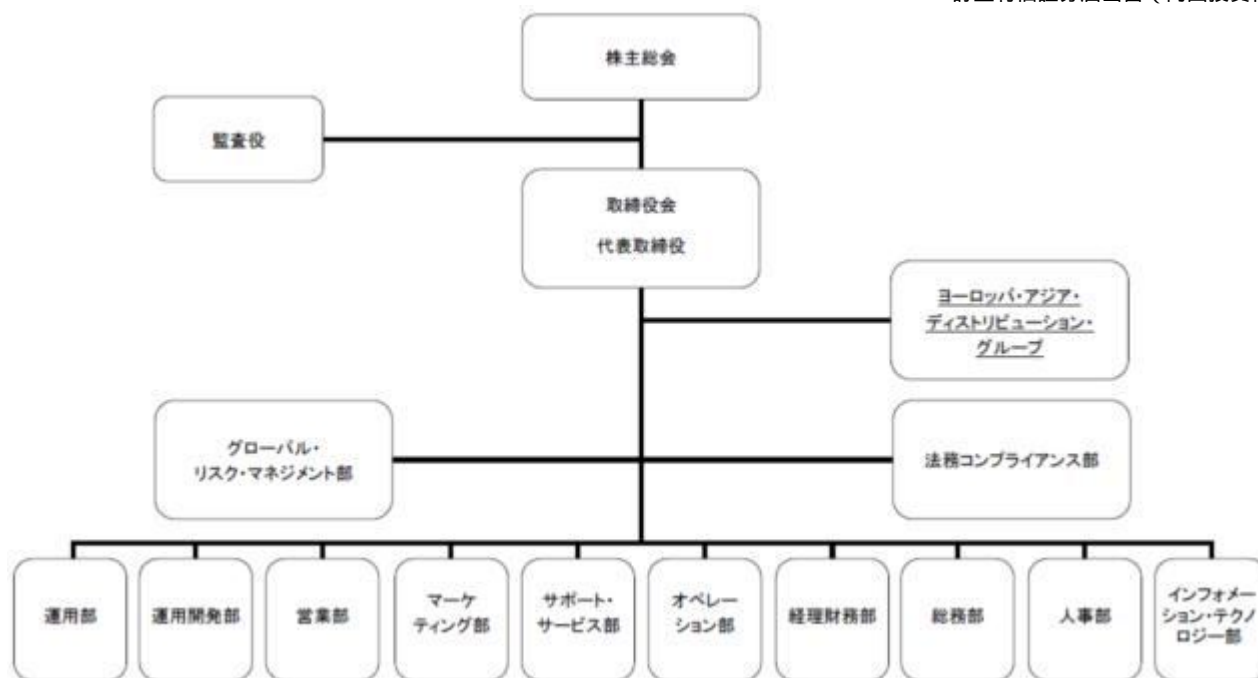
（中略）

過去5年間における資本金の額の増減

（中略）

(2) 会社の機構（2017年12月29日現在）

（中略）



(以下略)

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

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

委託会社の運用する証券投資信託は2017年7月31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	20	257,418
合計	20	257,418

<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」に定める投資助言業務を行なっています。

委託会社の運用する証券投資信託は2017年12月29日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	22	388,271
合計	22	388,271

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

< 訂正前 >

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額：324,279百万円（2017年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（2017年3月31日現在）

事業の内容：金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社資本金の額：324,279百万円（2017年3月31日現在）事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。三菱UFJ信託銀行株式会社は、委託会社による当初自己設定にかかる取得申込等の取扱いのみを行いません。

< 再信託受託会社の概要 >

名称：日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額：10,000百万円（2017年3月31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（2017年9月30日現在）

（中略）

(2) 販売会社

名称：みずほ証券株式会社

資本金の額：125,167百万円（2017年9月30日現在）

事業の内容：金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

< 再信託受託会社の概要 >

名称：日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額：10,000百万円（2017年9月30日現在）

（以下略）

独立監査人の監査報告書

平成30年1月22日

キャピタル・インターナショナル株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 中島紀子 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているキャピタル・グローバル中期債ファンドF（米ドル売り円買い）の平成29年10月17日から平成29年11月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に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財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、キャピタル・グローバル中期債ファンドF（米ドル売り円買い）の平成29年11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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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