

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年8月16日提出
【発行者名】	キャピタル・インターナショナル株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 トーマス・クワントリル
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内二丁目1番1号 明治安田生命ビル
【事務連絡者氏名】	原田 伸健
【電話番号】	03(6366)1000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	キャピタル・グローバル中期債ファンド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】	継続募集額(2019年2月15日から2020年2月13日まで) 3,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2019年2月14日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、「第二部ファンド情報」及び「第三部委託会社等の情報」における訂正事項を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(前略)

委託会社の概況(2018年12月28日現在)

(以下略)

<訂正後>

(前略)

委託会社の概況(2019年6月28日現在)

(以下略)

#### 2【投資方針】

##### (2)【投資対象】

<訂正前>

(前略)

<参考情報2>投資対象ファンドの概要等

(中略)

上記は、2018年12月28日現在のものであり、今後、投資顧問会社等の判断その他理由により変更される場合があります。

(中略)

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

<訂正後>

(前略)

<参考情報2>投資対象ファンドの概要等

(中略)

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

(中略)

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

##### (3)【運用体制】

<訂正前>

（前略）

内部管理体制

（中略）

（参考情報）

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

運用部（3名）／法務コンプライアンス部（2名）／オペレーション部（8名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

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

<訂正後>

（前略）

内部管理体制

（中略）

（参考情報）

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

運用部（3名）／法務コンプライアンス部（3名）／オペレーション部（6名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

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

### 3【投資リスク】

<訂正前>

（前略）

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

<訂正後>

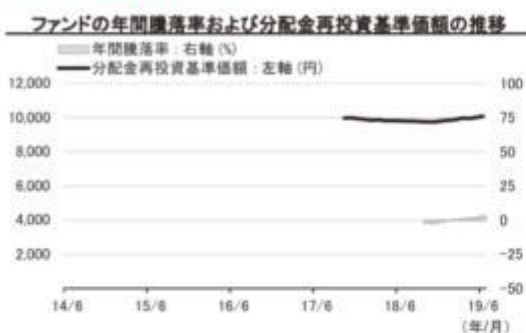
（前略）

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

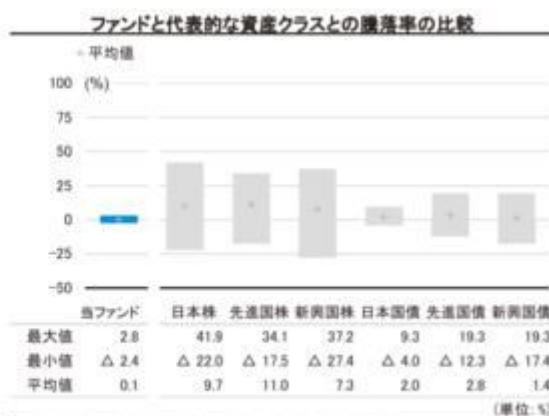
原届出書の第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 3投資リスク リスクの定量的比較につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

## リスクの定量的比較



(注1) 年間騰落率は、2018年10月から2019年6月までの各月末における1年間の騰落率を表示したもので、分配金再投資基準価額を基に算出しています。  
 (注2) 分配金再投資基準価額は、設定日(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。



(注1) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。  
 (注2) 代表的な資産クラスの騰落率は、2014年7月から2019年6月までの5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
 (注3) ファンドの騰落率は、2018年10月から2019年6月までの各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

### <各資産クラスの指数>

日本株・・・TOPIX(配当込み)  
 先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)  
 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)  
 日本国債・・・NOMURA-BPI国債  
 先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本/円ベース)  
 新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)  
 ※ 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

### 「ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数について

「日本株」の資産クラスはTOPIX(配当込み)を表示しております。

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

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

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

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

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

「日本国債」の資産クラスはNOMURA-BPI国債を表示しております。

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

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

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (3)【信託報酬等】

#### <訂正前>

信託報酬の総額(消費税等相当額を含みます。)は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対して年率0.4644%(税抜0.43%)の信託報酬率を乗じて得た額とします。

(中略)

#### <投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担>

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

投資対象とする国内投資信託の信託報酬（\*2） 年率0.007%程度

実質的な負担（\*3） **年率0.4714%程度（税込）**

（中略）

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

（以下略）

<訂正後>

信託報酬の総額（消費税等相当額を含みます。）は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対して **年率0.4644%<sup>1</sup>（税抜0.43%）**の信託報酬率を乗じて得た額とします。

（中略）

<投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担>

信託報酬 年率0.4644%<sup>1</sup>（税抜0.43%）

投資対象とする外国投資信託の信託報酬（\*1） 年率0.00%

投資対象とする国内投資信託の信託報酬（\*2） 年率0.007%程度

実質的な負担（\*3） **年率0.4714%程度（税込）<sup>2</sup>**

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

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

（中略）

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

（以下略）

## （5）【課税上の取扱い】

<訂正前>

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

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

（以下略）

<訂正後>

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

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

（以下略）

## 5【運用状況】

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

されます。

<更新・訂正後>

(1) 【投資状況】

キャピタル・グローバル中期債ファンドF（米ドル売り円買い）

2019年6月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	12,437,644,570	99.87
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		15,118,689	0.12
合計（純資産総額）		12,452,763,259	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）

2019年6月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	7,004,658	0.05
投資証券	ルクセンブルク	12,430,316,592	99.94
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		0	0.00
合計（純資産総額）		12,437,321,250	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・インターメディエイト・ボンド・ファンド（LUX）

2019年6月28日現在

資産の種類	国/地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
債券	米国	7,945,067,375	42.45
	日本	1,461,223,677	7.81
	ドイツ	1,151,613,747	6.15
	英国	933,911,136	4.99
	国際機関	864,102,380	4.62
	カナダ	746,208,023	3.99
	スペイン	696,920,279	3.72
	イタリア	671,059,034	3.59
	オーストラリア	568,714,359	3.04
	ポーランド	451,252,427	2.41
	デンマーク	352,940,336	1.89
	中国	346,054,249	1.85
	メキシコ	343,902,688	1.84
	ボルトガル	285,169,390	1.52
	フランス	226,327,282	1.21
	タイ	214,228,580	1.14

インドネシア	201,220,651	1.08
インド	174,971,832	0.93
ノルウェー	136,632,523	0.73
マレーシア	118,351,411	0.63
カタール	114,243,574	0.61
スウェーデン	110,462,262	0.59
サウジアラビア	98,214,849	0.52
オランダ	92,378,354	0.49
リトアニア	89,355,552	0.48
韓国	70,196,933	0.38
アイルランド	65,694,486	0.35
スイス	63,148,269	0.34
ベルギー	51,044,277	0.27
オーストリア	11,289,888	0.06
銀行預金、その他資産（負債控除後）	60,282,317	0.32
純資産総額	18,716,182,140	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

2019年1月23日現在

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

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

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

## （２）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

キャピタル・グローバル中期債ファンドF（米ドル売り円買い）

a. 上位30銘柄

2019年6月28日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	キャピタル・グローバル中期債マ ザーファンド（米ドル売り円買 い）	12,214,126,064	0.9816	11,989,772,282	1.0183	12,437,644,570	99.87



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

b. 種類別投資比率

2019年6月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.87
合計	99.87

(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

2019年6月28日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ルクセンブルク	投資証券	キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)	10,597,030.343	1,131.29	11,988,396,139	1,173	12,430,316,592	99.94
2	日本	投資信託受益証券	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	6,640,746	1.0548	7,004,658	1.0548	7,004,658	0.05

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

b. 種類別投資比率

2019年6月28日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.05
投資証券	99.94
合計	100.00

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

上位30銘柄

2019年6月28日現在

順位	銘柄	利率(%) (上段) 償還日 (下段)	国/地域 (上段) 資産(中 段) 業種/種類 (下段)	数量	評価単価 (上段) 通貨(下段)	評価金額(円)	投資 比率 (%)
1	FNCL UMBS 3.5 BN7830	4.0 2049/7/1	米国 債券 その他債券	8,308,199	103.3437 米ドル	925,356,616	4.94
2	US TREASURY I/L	0.375 2027/1/15	米国 債券 国債証券	4,950,000	106.4231 米ドル	567,752,617	3.03
3	SPAIN GOVT EUR 144A LIFE/REG S	2.75 2024/10/31	スペイン 債券 国債証券	3,750,000	115.3005 ユーロ	529,788,980	2.83

4	JAPAN GVT 346 JPY BD	0.1 2027/3/20	日本 債券 国債証券	510,000,000	102.6676 日本円	523,604,760	2.80
5	FNCN UMBS 3.5 AE9138	3.5 2049/7/1	米国 債券 その他債券	4,488,820	102.3953 米ドル	495,370,673	2.65
6	FNCI UMBS 3.5 AL2058	3.0 2034/8/1	米国 債券 その他債券	4,500,000	101.9199 米ドル	494,298,877	2.64
7	ITALY GOVT EUR REG S (B)	1.45 2024/11/15	イタリア 債券 国債証券	4,000,000	100.1745 ユーロ	490,972,843	2.62
8	US TREASURY I/L FRN	0.625 2024/1/15	米国 債券 国債証券	3,650,000	111.4009 米ドル	438,227,510	2.34
9	FGLMC 4.0 G08842	4.0 2048/10/1	米国 債券 その他債券	3,329,486	103.5302 米ドル	371,502,868	1.98
10	CANADA GOVT CAD BOND	2.25 2025/6/1	カナダ 債券 国債証券	4,200,000	104.845 カナダ・ド ル	362,224,191	1.94
11	FNCL UMBS 3.5 BD9689	4.0 2048/10/1	米国 債券 その他債券	3,049,087	103.3645 米ドル	339,671,687	1.81
12	DEUTSCHLAND REP EUR REG S (B)	0.5 2028/2/15	ドイツ 債券 国債証券	2,500,000	108.0328 ユーロ	330,929,845	1.77
13	FNCL UMBS 4.5 BK7091	4.5 2049/7/1	米国 債券 その他債券	2,866,237	104.4935 米ドル	322,789,647	1.72
14	AUSTRALIA GOVT BD AUD REG S	5.5 2023/4/21	オーストラ リア 債券 国債証券	3,500,000	116.8667 オーストラ リア・ドル	308,915,689	1.65
15	EFSF EUR REG S (B)	0.4 2025/2/17	国際機関 債券 国債証券	2,225,000	103.9566 ユーロ	283,414,704	1.51
16	DEUTSCHLAND REP EUR REG S (B)	2.0 2022/1/4	ドイツ 債券 国債証券	2,100,000	107.019 ユーロ	275,372,444	1.47
17	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	117.8139 ユーロ	267,059,898	1.43
18	JAPAN GVT 329 JPY BD	0.8 2023/6/20	日本 債券 国債証券	245,000,000	104.2235 日本円	255,347,575	1.36
19	BONOS MEXICAN MXN	10.0 2024/12/5	メキシコ 債券 国債証券	38,000,000	111.1214 メキシコ・ ペソ	237,203,205	1.27
20	JAPAN GVT 134 JPY BD	0.1 2022/12/20	日本 債券 国債証券	230,000,000	101.1806 日本円	232,715,380	1.24

21	INDONESIA GOVT BOND IDR FR77	8.125 2024/5/15	インドネシ ア 債券 国債証券	25,000,000,000	105.60 インドネシ ア・ルピー	201,220,651	1.08
22	CANADA GOVT CAD BOND	1.0 2022/9/1	カナダ 債券 国債証券	2,450,000	98.759 カナダ・ド ル	199,032,136	1.06
23	US TREASURY NOTE	2.0 2022/11/30	米国 債券 国債証券	1,750,000	100.8633 米ドル	190,234,545	1.02
24	POLAND GOVT BOND PLN	5.75 2021/10/25	ポーランド 債券 国債証券	6,000,000	109.489 ポーラン ド・ズロチ	189,360,815	1.01
25	POLAND GOVT BOND PLN	4.0 2023/10/25	ポーランド 債券 国債証券	5,900,000	108.691 ポーラン ド・ズロチ	184,847,666	0.99
26	CHINA DEV BANK (BOND CONNECT) CNY UNSEC	4.73 2025/4/2	中国 債券 国債証券	11,000,000	105.6657 中国元	182,156,949	0.97
27	NYKREDIT DKK SR SEC SER 01E SF COVERED	1.5 2040/10/1	デンマーク 債券 その他債券	10,376,449	103.45 デンマー ク・クロー ネ	176,213,595	0.94
28	UTD KINGDOM GILT REG S GBP	4.25 2027/12/7	英国 債券 国債証券	1,000,000	128.906 英ポンド	176,057,063	0.94
29	US TREASURY I/L	0.875 2029/1/15	米国 債券 国債証券	1,500,000	106.4541 米ドル	172,096,425	0.92
30	US TREASURY NOTE	2.875 2023/11/30	米国 債券 国債証券	1,500,000	104.7676 米ドル	169,369,962	0.90

(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銘柄の評価金額の比率をいいます。

(参考) 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

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

2019年1月23日現在

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	
日本	第4回クレディ・ア グリコル・エス・ エー円貨社債 (2014)	0.425	2019/11/28	社債券	100,000	100.208	100,208,000	5.39
日本	第19回ルノー円貨社 債(2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	99.503	99,503,000	5.35

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

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

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

#### 【投資不動産物件】

キャピタル・グローバル中期債ファンド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 (2017年11月20日)	99,794	99,794	0.9979	0.9979
第2期 (2018年11月20日)	11,637,358,366	11,637,358,366	0.9743	0.9743
2018年 6月末日	11,187,988,649		0.9814	
7月末日	11,408,659,266		0.9809	
8月末日	11,521,931,459		0.9805	
9月末日	11,604,075,484		0.9776	
10月末日	11,629,847,770		0.9755	
11月末日	11,614,374,549		0.9751	
12月末日	11,690,637,333		0.9799	
2019年 1月末日	11,851,992,812		0.9854	
2月末日	11,789,308,977		0.9876	
3月末日	12,334,165,407		0.9976	
4月末日	12,417,183,617		0.9964	
5月末日	12,495,550,442		1.0002	
6月末日	12,452,763,259		1.0093	

(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	2017年10月17日～2017年11月20日	0
第2期	2017年11月21日～2018年11月20日	0

#### 【収益率の推移】

#### キャピタル・グローバル中期債ファンドF（米ドル売り円買い）

期	計算期間	収益率（％）
第1期	2017年10月17日～2017年11月20日	0.2
第2期	2017年11月21日～2018年11月20日	2.4
第3中間計算期間末	2018年11月21日～2019年 5月20日	2.5

(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	2017年10月17日～2017年11月20日	100,000		100,000
第2期	2017年11月21日～2018年11月20日	14,018,168,207	2,073,999,319	11,944,268,888
第3中間計算期間末	2018年11月21日～2019年 5月20日	1,414,782,693	926,963,670	12,432,087,911

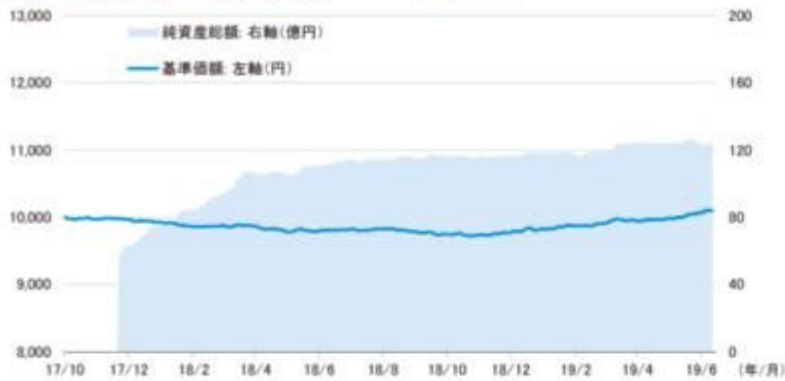
(注)第1期の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 参考情報

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移(設定～2019年6月28日)



## 分配金の推移

第1期	2017年11月	0円
第2期	2018年11月	0円
	設定来累計	0円

分配金は1万口当たり、税引前

## 主要な資産の状況(2019年6月28日現在)

&lt;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&gt;

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Ch-JPY)	99.94
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.05

&lt;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&gt;

(2019年6月28日現在)

## 上位10銘柄

順位	銘柄名	国名/地域名	証券種別	投資比率(%)
1	FNCL UMBS 3.5 BN7830 03-01-49	米国	その他証券	4.94
2	US TREASURY 1/L 0.375% 01-15-27	米国	国債証券	3.03
3	SPAIN GOVT EUR 144A LIFE/REG S 2.75% 10-31-24	スペイン	国債証券	2.83
4	JAPAN GVT 346 JPY BD 0.1% 03-20-27	日本	国債証券	2.80
5	FNCN UMBS 3.5 AE9138 12-01-20	米国	その他証券	2.65
6	FNCI UMBS 3.5 AL2058 02-01-26	米国	その他証券	2.54
7	ITALY GOVT EUR REG S (B) 1.45% 11-15-24	イタリア	国債証券	2.62
8	US TREASURY 1/L FRN 0.625% 01-15-24	米国	国債証券	2.34
9	FGLMC 4.0 G08942 10-01-48	米国	その他証券	1.98
10	CANADA GOVT CAD BOND 2.25% 06-01-25	カナダ	国債証券	1.94

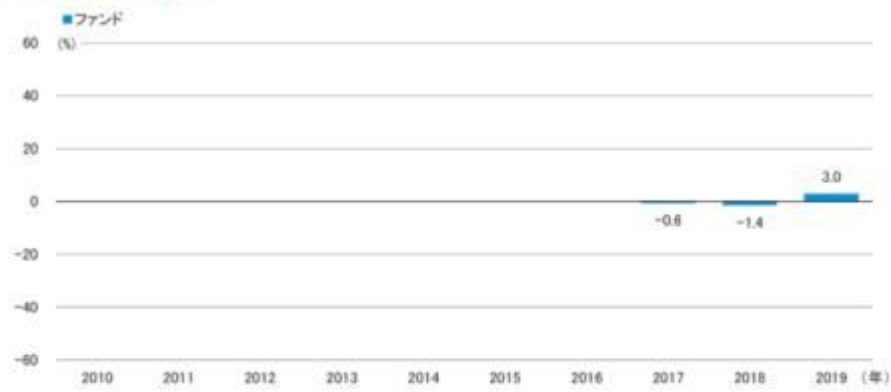
## 証券種別構成比率

証券種別	投資比率(%)
国債証券	51.67
社債券	26.16
その他証券	21.85
現金・その他	0.32

## 国別構成比率

国名	投資比率(%)
米国	42.45
日本	7.81
ドイツ	6.15
英国	4.99
カナダ	3.99
その他国	34.29
現金・その他	0.32

## 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年は設定日から年末までの収益率を表示。2019年は6月末までの収益率を表示。

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

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



## 第3【ファンドの経理状況】

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

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間（2018年11月21日から2019年5月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【キャピタル・グローバル中期債ファンドF（米ドル売り円買い）】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年11月20日現在	第3期中間計算期間 2019年5月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	135,700,815	50,943,286
親投資信託受益証券	11,633,458,189	12,410,231,598
流動資産合計	11,769,159,004	12,461,174,884
資産合計	11,769,159,004	12,461,174,884
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	85,000,000	-
未払解約金	19,414,099	17,561,952
未払受託者報酬	1,240,121	1,281,068
未払委託者報酬	25,422,369	26,261,833
未払利息	371	146
その他未払費用	723,678	879,660
流動負債合計	131,800,638	45,984,659
負債合計	131,800,638	45,984,659
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	11,944,268,888	12,432,087,911
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	306,910,522	16,897,686
元本等合計	11,637,358,366	12,415,190,225
純資産合計	11,637,358,366	12,415,190,225
負債純資産合計	11,769,159,004	12,461,174,884

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	第2期中間計算期間 自 2017年11月21日 至 2018年5月20日	第3期中間計算期間 自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	162,932,825	321,292,409
<b>営業収益合計</b>	<b>162,932,825</b>	<b>321,292,409</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	153,595	20,410
受託者報酬	849,043	1,281,068
委託者報酬	17,405,299	26,261,833
その他費用	1,005,570	879,660
<b>営業費用合計</b>	<b>19,413,507</b>	<b>28,442,971</b>
営業利益又は営業損失( )	182,346,332	292,849,438
経常利益又は経常損失( )	182,346,332	292,849,438
中間純利益又は中間純損失( )	182,346,332	292,849,438
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( )	7,496,408	10,012,317
期首剰余金又は期首欠損金( )	206	306,910,522
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,704,401	23,423,951
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,704,401	23,423,951
中間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	69,863,508	16,248,236
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	69,863,508	16,248,236
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	241,009,237	16,897,686

## (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年11月20日現在	第3期中間計算期間 2019年5月20日現在
1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 11,944,268,888口	1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数 12,432,087,911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 306,910,522円	2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損 16,897,686円
3. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9743円 (1万口当たり純資産額) (9,743円)	3. 当該中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9986円 (1万口当たり純資産額) (9,986円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 自 2017年11月21日 至 2018年11月20日	第3期中間計算期間 自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

当ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第2期 自 2017年11月21日 至 2018年11月20日	第3期中間計算期間 自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
期首元本額	100,000円	11,944,268,888円
期中追加設定元本額	14,018,168,207円	1,414,782,693円
期中一部解約元本額	2,073,999,319円	926,963,670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）

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、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

開示対象ファンドの中間計算期間末日（以下「計算日」という。）における同マザーファンドの状況は次に示すとおりであります。それらは監査意見の対象外であります。

#### 貸借対照表

（単位：円）

2019年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
投資信託受益証券	6,998,018
投資証券	12,403,174,731
流動資産合計	12,410,172,749
資産合計	12,410,172,749
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	12,323,963,852
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	86,208,897
元本等合計	12,410,172,749
純資産合計	12,410,172,749
負債純資産合計	12,410,172,749

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2019年5月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数		12,323,963,852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	1.0070円
	(1万口当たり純資産額)	(10,070円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) 投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2019年5月20日現在
同計算期間の期首元本額	11,869,664,513円
同計算期間の追加設定元本額	922,075,613円
同計算期間の一部解約元本額	467,776,274円
計算日の元本額	12,323,963,852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）	12,323,963,852円

## 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C（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、2018年12月31日付けで、ルクセンブルクにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務書類が作成されております。この財務書類は独立監査人であるプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コオペラティブの監査を受けております。以下の「投資明細表」および「損益および純資産変動計算書」は、原文の財務書類から委託会社が抜粋・翻訳したものでありますが、これらは監査意見の対象外であります。

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

#### 投資明細表

2018年12月31日現在

投資銘柄	通貨	数量/額面	評価額 (USD)	投資比率 (%)
公的な市場に上場している譲渡可能な有価証券と短期金融商品				
債券				
<i>Australia</i>				
Australia Government Bond, Reg. S 5.5% 21/04/2023	AUD	3,500,000	2,829,146	1.64
Australia Government Bond, Reg. S 5.75% 15/07/2022	AUD	800,000	638,748	0.37
Scentre Group Trust 1, REIT, Reg. S 2.375% 08/04/2022	GBP	100,000	128,766	0.07
Scentre Group Trust 1, REIT, Reg. S 2.25% 16/07/2024	EUR	100,000	121,746	0.07
			3,718,406	2.15
<i>Austria</i>				
Oesterreichische Kontrollbank AG 1.75% 24/01/2020	USD	105,000	104,076	0.06
			104,076	0.06
<i>Belgium</i>				
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. 2.65% 01/02/2021	USD	49,000	48,186	0.03
Belgium Government Bond, Reg. S, 144A 1.125% 03/08/2019	USD	200,000	198,413	0.11
			246,599	0.14
<i>Canada</i>				
Canada Government Bond 2.25% 01/06/2025	CAD	1,100,000	822,051	0.48
Enbridge, Inc. 4.25% 01/12/2026	USD	25,000	24,775	0.01
Export Development Canada 2.5% 24/01/2023	USD	1,000,000	992,825	0.57

Province of Quebec Canada 2.375% 31/01/2022	USD	114,000	112,687	0.07
			1,952,338	1.13
<i>Chile</i>				
Enel Americas SA 4% 25/10/2026	USD	10,000	9,366	0.01
			9,366	0.01
<i>China</i>				
China Development Bank 4.69% 23/03/2023	CNY	10,000,000	1,528,277	0.89
			1,528,277	0.89
<i>Denmark</i>				
Danske Bank A/S, 144A 3.875% 12/09/2023	USD	500,000	481,815	0.28
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 1.5% 01/10/2040	DKK	16,827,745	2,568,772	1.48
Nykredit Realkredit A/S 2% 01/10/2037	DKK	4,315,402	689,709	0.40
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 2.5% 01/10/2047	DKK	3,952,914	634,504	0.37
			4,374,800	2.53
<i>France</i>				
AXA SA, Reg. S, FRN 5.25% 16/04/2040	EUR	300,000	362,590	0.21
BPCE SA, Reg. S 4.625% 18/07/2023	EUR	300,000	390,331	0.23
France Government Bond OAT, Reg. S 0% 25/05/2021	EUR	450,000	521,339	0.30
RCI Banque SA, Reg. S 0.75% 26/09/2022	EUR	100,000	112,249	0.06
Sanofi, Reg. S 1% 21/03/2026	EUR	500,000	581,393	0.34
Veolia Environnement SA, Reg. S 0% 23/11/2020	EUR	200,000	229,282	0.13
Veolia Environnement SA, Reg. S 4.247% 06/01/2021	EUR	100,000	124,010	0.07
Veolia Environnement SA, Reg. S 0.314% 04/10/2023	EUR	200,000	225,137	0.13
			2,546,331	1.47
<i>Germany</i>				
Allianz SE, Reg. S, FRN 4.75% Perpetual	EUR	200,000	252,240	0.15
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.5% 15/02/2028	EUR	3,500,000	4,128,833	2.39
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 2% 04/01/2022	EUR	2,100,000	2,592,974	1.50
Deutsche Telekom International Finance BV, Reg. S 0.625% 13/12/2024	EUR	200,000	225,267	0.13
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.125% 07/03/2022	USD	1,333,000	1,313,058	0.76
Landwirtschaftliche Rentenbank 2% 06/12/2021	USD	140,000	137,581	0.08
Merck Financial Services GmbH, Reg. S 1.375% 01/09/2022	EUR	100,000	118,990	0.07
Volkswagen Leasing GmbH, Reg. S 1.125% 04/04/2024	EUR	350,000	387,661	0.22
			9,156,604	5.30
<i>India</i>				
India Government Bond 7.35% 22/06/2024	INR	100,000,000	1,431,784	0.83
India Government Bond 6.97% 06/09/2026	INR	10,000,000	139,774	0.08
			1,571,558	0.91
<i>Ireland</i>				
Abbott Ireland Financing DAC, Reg. S 0.875% 27/09/2023	EUR	410,000	469,866	0.27
CRH Finance DAC, Reg. S 3.125% 03/04/2023	EUR	100,000	126,499	0.07
Ireland Government Bond 5.4% 13/03/2025	EUR	2,200,000	3,294,923	1.91
			3,891,288	2.25
<i>Italy</i>				
Intesa Sanpaolo SpA, Reg. S 6.625% 13/09/2023	EUR	300,000	390,417	0.23
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 0.9% 01/08/2022	EUR	200,000	225,505	0.13
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA, Reg. S 0.875% 02/02/2022	EUR	100,000	115,318	0.07
UniCredit SpA, Reg. S 1% 18/01/2023	EUR	250,000	268,338	0.15
UniCredit SpA, Reg. S 6.95% 31/10/2022	EUR	200,000	257,120	0.15
			1,256,698	0.73

*Japan*

American Honda Finance Corp. 1.375% 10/11/2022	EUR	200,000	237,084	0.14
Japan Bank for International Cooperation 2.125% 16/11/2020	USD	300,000	296,236	0.17
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/12/2022	JPY	230,000,000	2,119,322	1.23
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/06/2021	JPY	635,000,000	5,829,411	3.37
Japan Government Ten Year Bond 0.8% 20/06/2023	JPY	245,000,000	2,330,005	1.35
Japan Government Ten Year Bond 0.3% 20/12/2024	JPY	150,000,000	1,404,753	0.81
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., Reg. S 2.25% 21/11/2026	EUR	350,000	410,134	0.24
Toyota Motor Credit Corp. 1.55% 18/10/2019	USD	100,000	98,807	0.06
Toyota Motor Credit Corp. 2.15% 08/09/2022	USD	130,000	125,006	0.07
			12,850,758	7.44

*Lithuania*

Lithuania Government Bond, 144A 6.625% 01/02/2022	USD	750,000	818,756	0.47
			818,756	0.47

*Mexico*

Mexican Bonos 10% 05/12/2024	MXN	38,000,000	2,055,704	1.19
Mexican Bonos 5.75% 05/03/2026	MXN	21,000,000	903,732	0.52
Mexico Government Bond 4% 02/10/2023	USD	700,000	697,609	0.41
			3,657,045	2.12

*Netherlands*

BNG Bank NV, Reg. S 1.75% 05/10/2020	USD	200,000	196,770	0.11
BNG Bank NV, Reg. S 2.375% 01/02/2022	USD	450,000	445,046	0.26
Cooperatieve Rabobank UA, Reg. S 3.875% 25/07/2023	EUR	250,000	320,779	0.18
Enel Finance International NV, Reg. S 1% 16/09/2024	EUR	350,000	396,578	0.23
NN Group NV, Reg. S, FRN 4.625% 08/04/2044	EUR	300,000	362,018	0.21
Unilever NV, Reg. S 0.375% 14/02/2023	EUR	100,000	114,707	0.07
			1,835,898	1.06

*Norway*

Equinor ASA 2.75% 10/11/2021	USD	250,000	248,073	0.14
Norway Government Bond, Reg. S, 144A 3.75% 25/05/2021	NOK	5,000,000	613,953	0.36
			862,026	0.50

*Poland*

Poland Government Bond 4% 22/01/2024	USD	220,000	225,550	0.13
Poland Government Bond 5.75% 25/10/2021	PLN	6,000,000	1,779,871	1.03
Poland Government Bond 5.75% 23/09/2022	PLN	1,500,000	455,778	0.26
Poland Government Bond 4% 25/10/2023	PLN	5,900,000	1,710,320	0.99
Poland Government Bond 3.25% 06/04/2026	USD	25,000	24,524	0.02
			4,196,043	2.43

*Portugal*

Portugal Government Bond, Reg. S 5.125% 15/10/2024	USD	150,000	157,391	0.09
Portugal Obrigaçoes do Tesouro OT, Reg. S, 144A 2.875% 15/10/2025	EUR	1,850,000	2,361,147	1.37
			2,518,538	1.46

*Qatar*

Qatar Government Bond, Reg. S 3.875% 23/04/2023	USD	1,010,000	1,023,058	0.59
			1,023,058	0.59

*Saudi Arabia*

Saudi Government Bond, Reg. S 2.875% 04/03/2023	USD	400,000	385,212	0.22
Saudi Government Bond, Reg. S 4% 17/04/2025	USD	475,000	471,826	0.28
			857,038	0.50

*South Korea*

Hyundai Capital Services, Inc., 144A 3.75% 05/03/2023	USD	250,000	246,942	0.14
---	-----	---------	---------	------



*Spain*

Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Reg. S, FRN 3.5% 11/04/2024	EUR	500,000	576,477	0.33
Banco Santander SA, Reg. S 1.375% 09/02/2022	EUR	100,000	116,080	0.07
Iberdrola International BV, Reg. S 2.875% 11/11/2020	EUR	200,000	241,379	0.14
Spain Government Bond 1.15% 30/07/2020	EUR	1,500,000	1,759,308	1.02
Spain Government Bond, Reg. S, 144A 2.75% 31/10/2024	EUR	2,750,000	3,530,423	
				2.04
			6,223,667	3.60

*Supra National*

Asian Development Bank 2.75% 17/03/2023	USD	641,000	643,430	0.37
European Financial Stability Facility, Reg. S 0.4% 17/02/2025	EUR	2,225,000	2,566,236	1.49
European Investment Bank 0% 16/10/2023	EUR	1,000,000	1,146,856	0.67
European Investment Bank 1.375% 15/09/2021	USD	250,000	242,131	0.14
European Investment Bank 2.25% 15/03/2022	USD	825,000	815,533	0.47
European Stability Mechanism, Reg. S 2.125% 03/11/2022	USD	938,000	917,192	0.53
Inter-American Development Bank 2.5% 18/01/2023	USD	1,500,000	1,491,443	0.86
International Bank for Reconstruction & Development 1.375% 20/09/2021	USD	1,000,000	968,412	0.56
International Finance Corp. 2.25% 25/01/2021	USD	750,000	745,277	0.43
			9,536,510	5.52

*Sweden*

Swedbank AB, 144A 2.375% 27/02/2019	USD	500,000	500,033	0.29
Sweden Government Bond, 144A 2.375% 15/02/2023	USD	365,000	360,784	0.21
			860,817	0.50

*Switzerland*

Credit Suisse Group AG, Reg. S, FRN 2.125% 12/09/2025	GBP	100,000	121,159	0.07
			121,159	0.07

*Thailand*

Bank of Thailand 1.5% 21/03/2019	THB	35,350,000	1,085,447	0.63
Bank of Thailand 1.49% 28/08/2019	THB	6,650,000	203,952	0.12
			1,289,399	0.75

*United Kingdom*

AstraZeneca plc 3.5% 17/08/2023	USD	700,000	697,021	0.40
Barclays Bank plc, Reg. S 10% 21/05/2021	GBP	50,000	73,433	0.04
BAT Capital Corp. 2.764% 15/08/2022	USD	330,000	311,974	0.18
Cadent Finance plc, Reg. S 1.125% 22/09/2021	GBP	100,000	125,730	0.07
HSBC Holdings plc, FRN 4.292% 12/09/2026	USD	350,000	345,936	0.20
HSBC Holdings plc, FRN 3.033% 22/11/2023	USD	550,000	532,612	0.31
HSBC Holdings plc, Reg. S, FRN 3.375% 10/01/2024	EUR	100,000	114,655	0.07
Lloyds Bank plc, Reg. S 6.5% 24/03/2020	EUR	50,000	61,110	0.03
Lloyds Banking Group plc 4.45% 08/05/2025	USD	600,000	596,850	0.35
Shell International Finance BV 3.5% 13/11/2023	USD	874,000	884,272	0.51
Shell International Finance BV 1.875% 10/05/2021	USD	100,000	97,428	0.06
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 1.9% 23/09/2019	USD	150,000	147,926	0.09
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/09/2021	USD	448,000	433,472	0.25
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23/09/2023	USD	532,000	503,423	0.29
UK Treasury, Reg. S 3.75% 07/09/2021	GBP	1,000,000	1,375,593	0.80
UK Treasury, Reg. S 2.75% 07/09/2024	GBP	500,000	700,083	0.40
			7,001,518	4.05

## United States of America

3M Co. 3.25% 14/02/2024	USD	500,000	503,370	0.29
3M Co. 2.25% 15/03/2023	USD	168,000	162,890	0.09
Abbott Laboratories 2.9% 30/11/2021	USD	200,000	198,148	0.11
Abbott Laboratories 3.75% 30/11/2026	USD	124,000	122,735	0.07
AbbVie, Inc. 2.5% 14/05/2020	USD	100,000	99,069	0.06
Allergan Funding SCS 3% 12/03/2020	USD	200,000	199,261	0.11
Allergan Funding SCS 0.5% 01/06/2021	EUR	100,000	114,434	0.07
Allergan Funding SCS 3.8% 15/03/2025	USD	189,000	184,837	0.11
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 3.5% 12/01/2024	USD	215,000	210,293	0.12
Bank of America Corp. 2.625% 19/04/2021	USD	100,000	98,669	0.06
Berkshire Hathaway Energy Co. 2.4% 01/02/2020	USD	660,000	655,719	0.38
Chevron Corp. 2.498% 03/03/2022	USD	120,000	117,733	0.07
CMS Energy Corp. 3.45% 15/08/2027	USD	250,000	241,135	0.14
Conagra Brands, Inc. 4.3% 01/05/2024	USD	360,000	358,224	0.21
Consolidated Edison, Inc. 2% 15/03/2020	USD	200,000	197,375	0.11
CVS Health Corp. 3.7% 09/03/2023	USD	750,000	742,641	0.43
Duke Energy Corp. 3.75% 15/04/2024	USD	250,000	250,663	0.14
Edison International 2.125% 15/04/2020	USD	200,000	194,723	0.11
Exelon Corp. 2.45% 15/04/2021	USD	100,000	97,854	0.06
Exelon Corp. 3.497% 01/06/2022	USD	50,000	48,896	0.03
FirstEnergy Corp. 4.25% 15/03/2023	USD	100,000	101,686	0.06
FirstEnergy Corp. 3.9% 15/07/2027	USD	250,000	242,704	0.14
Ford Motor Credit Co. LLC 1.897% 12/08/2019	USD	200,000	198,064	0.11
Johnson & Johnson 2.625% 15/01/2025	USD	285,000	274,748	0.16
JPMorgan Chase & Co. 2.4% 07/06/2021	USD	100,000	97,841	0.06
Kinder Morgan, Inc. 3.05% 01/12/2019	USD	150,000	149,171	0.09
McDonald's Corp. 2.625% 15/01/2022	USD	100,000	97,855	0.06
Medtronic Global Holdings SCA 1.7% 28/03/2019	USD	200,000	199,493	0.12
Morgan Stanley 2.5% 21/04/2021	USD	100,000	98,021	0.06
Morgan Stanley 2.75% 19/05/2022	USD	200,000	194,660	0.11
NV Energy, Inc. 6.25% 15/11/2020	USD	100,000	105,092	0.06
Pacific Gas & Electric Co. 3.3% 01/12/2027	USD	250,000	205,381	0.12
Philip Morris International, Inc. 2% 21/02/2020	USD	55,000	54,316	0.03
Philip Morris International, Inc. 2.625% 18/02/2022	USD	65,000	62,942	0.04
Prologis LP, REIT 1.375% 13/05/2021	EUR	100,000	117,115	0.07
Public Service Enterprise Group, Inc. 2% 15/11/2021	USD	50,000	48,046	0.03
Reynolds American, Inc. 3.25% 12/06/2020	USD	100,000	99,405	0.06
Reynolds American, Inc. 4.45% 12/06/2025	USD	250,000	241,495	0.14
South Carolina Electric & Gas Co. 3.5% 15/08/2021	USD	475,000	476,609	0.28
United Technologies Corp. 3.35% 16/08/2021	USD	800,000	798,299	0.46
United Technologies Corp. 3.65% 16/08/2023	USD	500,000	498,534	0.29
US Treasury 1.75% 31/05/2022	USD	750,000	732,623	0.42
US Treasury 1.875% 31/07/2022	USD	500,000	489,911	0.28
US Treasury 2% 30/11/2022	USD	3,550,000	3,487,378	2.02
US Treasury Inflation Indexed 0.625% 15/01/2024	USD	3,650,000	3,896,295	2.25
US Treasury Inflation Indexed 0.25% 15/01/2025	USD	1,000,000	1,022,389	0.59
US Treasury Inflation Indexed 0.375% 15/01/2027	USD	3,950,000	3,928,645	2.27
US Treasury Inflation Indexed, FRN 0.125% 15/04/2022	USD	3,000,000	3,018,853	1.75
Walmart, Inc. 3.4% 26/06/2023	USD	566,000	572,146	0.33
Wells Fargo & Co. 2.625% 22/07/2022	USD	500,000	482,348	0.28
			26,790,734	15.51

債券合計

111,046,247

64.28

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			111,046,247	64.28
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				
<b>債券</b>				
<i>Canada</i>				
Canada Government Bond 0.75% 01/03/2021	CAD	3,100,000	2,217,367	1.28
Canada Government Bond 1% 01/09/2022	CAD	2,450,000	1,738,384	1.01
Enbridge, Inc. 2.9% 15/07/2022	USD	44,000	42,615	0.02
			3,998,366	2.31
<i>Denmark</i>				
Danske Bank A/S, 144A 2.8% 10/03/2021	USD	500,000	488,729	0.28
			488,729	0.28
<i>France</i>				
BNP Paribas SA 5% 15/01/2021	USD	50,000	51,800	0.03
			51,800	0.03
<i>Germany</i>				
Daimler Finance North America LLC, Reg. S 2.45% 18/05/2020	USD	650,000	642,308	0.37
Deutsche Telekom International Finance BV, 144A 2.485% 19/09/2023	USD	150,000	141,787	0.08
EMD Finance LLC, 144A 3.25% 19/03/2025	USD	350,000	336,293	0.20
			1,120,388	0.65
<i>Japan</i>				
American Honda Finance Corp. 2.65% 12/02/2021	USD	750,000	741,753	0.43
Toyota Motor Credit Corp. 2.7% 11/01/2023	USD	330,000	320,982	0.19
			1,062,735	0.62
<i>Malaysia</i>				
Malaysia Government Bond 3.955% 15/09/2025	MYR	4,450,000	1,072,087	0.62
			1,072,087	0.62
<i>Netherlands</i>				
Cooperatieve Rabobank UA 2.25% 14/01/2019	USD	500,000	499,841	0.29
			499,841	0.29
<i>Norway</i>				
DNB Bank ASA, 144A 2.125% 02/10/2020	USD	400,000	392,146	0.23
			392,146	0.23
<i>South Korea</i>				
Hyundai Capital America, 144A 3.25% 20/09/2022	USD	333,000	324,115	0.19
Hyundai Capital America, Reg. S 2.55% 03/04/2020	USD	40,000	39,501	0.02
Hyundai Capital America, Reg. S 2.75% 18/09/2020	USD	68,000	66,970	0.04
Hyundai Capital America, Reg. S 3.25% 20/09/2022	USD	50,000	48,666	0.03
			479,252	0.28
<i>Sweden</i>				
Nordea Bank Abp, Reg. S 1.625% 30/09/2019	USD	200,000	197,815	0.12
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A 2.375% 25/03/2019	USD	500,000	499,278	0.29
Skandinaviska Enskilda Banken AB 2.8% 11/03/2022	USD	250,000	245,056	0.14
Svenska Handelsbanken AB 2.25% 17/06/2019	USD	500,000	497,964	0.29
Swedbank AB, 144A 2.2% 04/03/2020	USD	600,000	593,136	0.34
Swedbank AB, Reg. S 2.8% 14/03/2022	USD	200,000	196,962	0.11
			2,230,211	1.29
<i>Switzerland</i>				
Roche Holdings, Inc., 144A 3.35% 30/09/2024	USD	550,000	552,122	0.32
Roche Holdings, Inc., Reg. S 1.75% 28/01/2022	USD	200,000	192,008	0.11
			744,130	0.43
<i>United Kingdom</i>				

BAT Capital Corp. 2.297% 14/08/2020	USD	475,000	463,862	0.27
			463,862	0.27
<i>United States of America</i>				
Amazon.com, Inc. 3.3% 05/12/2021	USD	500,000	506,299	0.29
Amazon.com, Inc. 2.8% 22/08/2024	USD	280,000	272,338	0.16
Apple, Inc. 2.5% 09/02/2022	USD	70,000	68,923	0.04
Arroyo Mortgage Trust, FRN, Series 2018-1 'A1', 144A 3.763% 25/04/2048	USD	661,011	668,668	0.39
Bank of America Corp., FRN 3.55% 05/03/2024	USD	502,000	496,186	0.29
BMW US Capital LLC, Reg. S 2.15% 06/04/2020	USD	200,000	197,686	0.11
Cascade Funding Mortgage Trust, FRN, Series 2018- RM2 'A', 144A 4% 25/10/2068	USD	142,869	143,614	0.08
Comcast Corp. 3.7% 15/04/2024	USD	510,000	513,439	0.30
Comcast Corp. 3.95% 15/10/2025	USD	165,000	167,174	0.10
CPS Auto Receivables Trust, Series 2018-D 'B', 144A 3.06% 17/01/2022	USD	118,959	118,862	0.07
CPS Auto Receivables Trust, Series 2018-D 'B', 144A 3.61% 15/11/2022	USD	275,000	276,675	0.16
CPS Auto Receivables Trust, Series 2017-D 'C', 144A 3.01% 17/10/2022	USD	150,000	149,166	0.09
CVS Health Corp. 3.35% 09/03/2021	USD	430,000	428,787	0.25
Drive Auto Receivables Trust, Series 2017-2 'C' 2.75% 15/09/2023	USD	75,000	74,858	0.04
DT Auto Owner Trust, Series 2018-1A 'A', 144A 2.59% 17/05/2021	USD	232,603	232,192	0.13
DT Auto Owner Trust, Series 2017-4A 'B', 144A 2.44% 15/01/2021	USD	100,000	99,806	0.06
DT Auto Owner Trust, Series 2018-3A 'B', 144A 3.02% 15/02/2022	USD	231,696	231,299	0.13
Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2018-1A 'A', 144A 2.21% 17/05/2021	USD	137,546	137,326	0.08
Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2018-4A 'B', 144A 3.05% 15/12/2021	USD	378,515	377,852	0.22
FHLMC, FRN, Series K733 'A2' 3.75% 25/08/2025	USD	1,250,000	1,296,320	0.75
FHLMC G08842 4% 01/10/2048	USD	3,599,999	3,672,444	2.13
FHLMC Q44363 4.5% 01/11/2046	USD	535,071	555,518	0.32
Finance of America Structured Securities Trust, FRN, Series 2017-HB1 'B', 144A 2.321% 25/11/2027	USD	33,200	33,124	0.02
Finance of America Structured Securities Trust, FRN, Series 2018-HB1 'B', 144A 3.375% 25/09/2028	USD	342,634	343,574	0.20
FNMA MA3495 4% 01/10/2048	USD	2,404,961	2,454,736	1.42
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2018-1 'A', 144A 3.19% 15/07/2031	USD	445,000	442,193	0.26
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2018-2 'A', 144A 3.47% 15/01/2030	USD	460,000	464,668	0.27
Galton Funding Mortgage Trust, FRN, Series 2018-2 'A42', 144A 4% 25/10/2058	USD	236,019	237,567	0.14
Gilead Sciences, Inc. 1.85% 20/09/2019	USD	50,000	49,559	0.03
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN 2.905% 24/07/2023	USD	250,000	238,296	0.14
Homeward Opportunities Fund I Trust, FRN, Series 2018-1 'A1', 144A 3.766% 25/06/2048	USD	88,304	88,723	0.05
JPMorgan Chase Bank NA, FRN 2.604% 01/02/2021	USD	600,000	595,260	0.34
loanDepot Station Place Agency Securitization Trust, FRN, Series 2017-LD1 'A', 144A 3.306% 25/11/2050	USD	120,000	119,935	0.07
Microsoft Corp. 1.1% 08/08/2019	USD	150,000	148,522	0.09
Microsoft Corp. 2.4% 06/02/2022	USD	70,000	69,221	0.04
Nationstar HECM Loan Trust, FRN, Series 2018-1A 'A', 144A 2.76% 25/02/2028	USD	128,021	128,169	0.07
Nationstar HECM Loan Trust, FRN, Series 2018-3A 'A', 144A 3.555% 25/11/2028	USD	230,488	230,488	0.13

Nationstar HECM Loan Trust, FRN, Series 2017-2A 'A1', 144A 2.038% 25/09/2027	USD	111,485	111,276	0.06
Nationstar HECM Loan Trust, FRN, Series 2018-1A 'M1', 144A 3.238% 25/02/2028	USD	170,000	169,872	0.10
New York Life Global Funding, 144A 2% 13/04/2021	USD	410,000	399,621	0.23
New York Life Global Funding, Reg. S 2% 13/04/2021	USD	100,000	97,469	0.06
PNC Bank NA 2.5% 22/01/2021	USD	1,000,000	987,002	0.57
PNC Financial Services Group, Inc. (The), STEP 2.854% 09/11/2022	USD	100,000	98,044	0.06
Public Service Co. of Colorado 2.25% 15/09/2022	USD	100,000	96,380	0.06
RMF Buyout Issuance Trust, FRN, Series 2018-1 'A', 144A 3.436% 25/11/2028	USD	93,511	93,586	0.05
Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2016- 3 'C' 2.46% 15/03/2022	USD	90,000	89,416	0.05
Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2017- 1 'C' 2.58% 16/05/2022	USD	75,000	74,597	0.04
Schlumberger Holdings Corp., 144A 4% 21/12/2025	USD	130,000	128,569	0.07
Sequoia Mortgage Trust, FRN, Series 2018-CH1 'A1', 144A 4% 25/02/2048	USD	363,660	367,876	0.21
Starbucks Corp. 2.2% 22/11/2020	USD	90,000	88,540	0.05
Starwood Mortgage Residential Trust, FRN, Series 2018-IMC1 ' A1', 144A 3.793% 25/03/2048	USD	87,312	87,068	0.05
Synchrony Card Issuance Trust, Series 2018-A1 'A' 3.38% 15/09/2024	USD	500,000	504,739	0.29
Union Pacific Corp. 3.2% 08/06/2021	USD	620,000	623,161	0.36
US Treasury 2.875% 30/11/2023	USD	2,500,000	2,544,043	1.47
World Financial Network Credit Card Master Trust, Series 2012- A 'A' 3.14% 17/01/2023	USD	105,000	104,993	0.06
World Financial Network Credit Card Master Trust, Series 2012- D 'A' 2.15% 17/04/2023	USD	150,000	149,375	0.09
World Financial Network Credit Card Master Trust, Series 2016- C 'A' 1.72% 15/08/2023	USD	100,000	98,935	0.06
World Financial Network Credit Card Master Trust, Series 2017- B 'A' 1.98% 15/06/2023	USD	145,000	144,200	0.08
World Financial Network Credit Card Master Trust, Series 2018- B 'A' 3.46% 15/07/2025	USD	470,000	475,194	0.28
			23,863,423	13.81
<b>債券合計</b>			<b>36,466,970</b>	<b>21.11</b>
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			<b>36,466,970</b>	<b>21.11</b>
<b>新規発行証券</b>				
<b>債券</b>				
<i>France</i>				
BNP Paribas SA, 144A 3.375% 09/01/2025	USD	425,000	400,662	0.23
			400,662	0.23
<i>Germany</i>				
Daimler Finance North America LLC, 144A 3% 22/02/2021	USD	500,000	494,682	0.29
Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A 4% 12/11/2021	USD	440,000	441,177	0.25
Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A 4.25% 13/11/2023	USD	410,000	407,056	0.24
			1,342,915	0.78
<i>United States of America</i>				
Bayer US Finance II LLC, 144A 3.875% 15/12/2023	USD	300,000	294,866	0.17
BMW US Capital LLC, 144A 3.1% 12/04/2021	USD	1,000,000	990,605	0.58
Cigna Corp., 144A 4.125% 15/11/2025	USD	280,000	280,151	0.16
Keurig Dr Pepper, Inc., 144A 3.551% 25/05/2021	USD	550,000	549,458	0.32
Keurig Dr Pepper, Inc., 144A 4.417% 25/05/2025	USD	329,000	328,071	0.19
Nestle Holdings, Inc., 144A 3.35% 24/09/2023	USD	500,000	505,241	0.29
			2,948,392	1.71

債券合計					<b>4,691,969</b>	<b>2.72</b>
新規発行証券合計					<b>4,691,969</b>	<b>2.72</b>
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						
<i>Luxembourg</i>						
JPMorgan US Dollar Treasury Liquidity Fund - JPM US Dollar Treasury Liquidity Institutional (dist.)	USD		11,790,646		11,790,646	6.82
					11,790,646	6.82
集団投資スキーム合計- UCITS					<b>11,790,646</b>	<b>6.82</b>
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					<b>11,790,646</b>	<b>6.82</b>
投資総額					<b>163,995,832</b>	<b>94.93</b>
銀行預金					<b>4,298,307</b>	<b>2.49</b>
その他の純資産 / (負債)					<b>4,456,307</b>	<b>2.58</b>
純資産総額					<b>172,750,446</b>	<b>100.00</b>

## 追加的記載事項

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 (%)
United States of America	FHLMC, 4.50%, 15/01/2048	USD	575,000	595,449	2,467	0.35
United States of America	FNMA, 4.50%, 25/01/2048	USD	3,050,000	3,160,249	44,910	1.83
United States of America	FNMA, 4.00%, 25/01/2049	USD	8,645,037	8,816,089	161,167	5.10
追加的記載事項の合計				<b>12,571,787</b>	<b>208,544</b>	<b>7.28</b>
TBA 総額				<b>12,571,787</b>	<b>208,544</b>	<b>7.28</b>

## 金利スワップ

額面	通貨	カウンター・ パーティ	銘柄	決済日	評価額 (USD)	未実現利益/ (損失) (USD)	投資比率 (%)
2,200,000	USD	Goldman Sachs	Pay fixed 2.351% Receive floating LIBOR 3 month	11/12/2027	57,956	57,956	0.03
15,000,000	EUR	Goldman Sachs	Pay floating EONIA 1 day Receive fixed (0.025)%	03/12/2021	43,963	43,963	0.03
金利スワップの未実現利益合計					<b>101,919</b>	<b>101,919</b>	<b>0.06</b>
4,440,217	USD	Goldman Sachs	Pay fixed 2.454% Receive floating FEDERAL_FUNDS_H15 1D	20/12/2023	(35,440)	(35,440)	(0.02)
2,000,000	USD	Goldman Sachs	Pay fixed 2.872% Receive floating LIBOR 3 month	20/04/2028	(30,662)	(30,662)	(0.02)

495,679	USD	Goldman Sachs	Pay fixed 2.444% Receive floating FEDERAL_FUNDS_H15 1D	20/12/2023	(3,716)	(3,716)	
金利スワップの未実現損合計					<b>(69,818)</b>	<b>(69,818)</b>	<b>(0.04)</b>
金利スワップの未実現損益総額					<b>32,101</b>	<b>32,101</b>	<b>0.02</b>

## 金融先物取引

銘柄	契約口数	通貨	グローバル・エクス ポージャー (USD)	未実現利益/(損 失) (USD)	投資比率 (%)
US 2 Year Note, 29/03/2019	58	USD	12,314,125	39,746	0.02
US 5 Year Note, 29/03/2019	256	USD	29,360,000	472,387	0.28
金融先物取引の未実現益合計				<b>512,133</b>	<b>0.30</b>
US 10 Year Ultra Bond, 20/03/2019	(16)	USD	(2,081,250)	(66,475)	(0.04)
US Ultra Bond, 20/03/2019	(26)	USD	(4,177,062)	(218,278)	(0.13)
金融先物取引の未実現損合計				<b>(284,753)</b>	<b>(0.17)</b>
金融先物取引の未実現損益総額				<b>227,380</b>	<b>0.13</b>

## 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	1,594,448	CAD	2,100,000	11/01/2019	Bank of America	55,871	0.03
USD	1,705,619	AUD	2,360,000	14/01/2019	BNY Mellon	42,962	0.03
JPY	189,000,000	AUD	2,334,104	15/01/2019	Morgan Stanley	81,720	0.05
USD	1,184,568	AUD	1,650,000	18/01/2019	J.P. Morgan	22,016	0.01
USD	1,134,915	CAD	1,500,000	18/01/2019	Goldman Sachs	35,718	0.02
USD	2,660,531	AUD	3,680,000	25/01/2019	HSBC	67,297	0.04
USD	1,440,460	AUD	2,000,000	25/01/2019	UBS	31,093	0.02
USD	3,955,681	CAD	5,280,000	25/01/2019	Goldman Sachs	85,756	0.05

## 先物為替予約の未実現益

						<b>422,433</b>	<b>0.25</b>
--	--	--	--	--	--	----------------	-------------

## GBP Hedged Share Class

GBP	5,031,030	USD	6,333,841	18/01/2019	J.P. Morgan	83,664	0.05
-----	-----------	-----	-----------	------------	-------------	--------	------

## JPY Hedged Share Class

JPY	11,706,352,543	USD	103,768,989	18/01/2019	J.P. Morgan	3,172,451	1.83
-----	----------------	-----	-------------	------------	-------------	-----------	------

## ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現益

						<b>3,256,115</b>	<b>1.88</b>
--	--	--	--	--	--	------------------	-------------

## 先物為替予約の未実現益合計

						<b>3,678,548</b>	<b>2.13</b>
--	--	--	--	--	--	------------------	-------------

USD	2,735,076	CNH	19,000,000	08/01/2019	HSBC	(31,342)	(0.02)
USD	341,828	EUR	300,000	08/01/2019	Citibank	(2,038)	
USD	7,033,406	JPY	795,000,000	11/01/2019	Bank of America	(225,165)	(0.13)
USD	2,390,994	PLN	9,000,000	11/01/2019	Citibank	(14,127)	(0.01)
AUD	2,316,662	JPY	189,000,000	15/01/2019	Goldman Sachs	(94,008)	(0.05)
USD	268,267	INR	19,000,000	15/01/2019	HSBC	(3,502)	
NOK	6,831,850	USD	800,000	17/01/2019	Bank of America	(9,337)	(0.01)
USD	5,043,120	GBP	4,000,000	17/01/2019	HSBC	(58,943)	(0.03)
USD	4,326,341	JPY	488,180,000	17/01/2019	Bank of America	(132,994)	(0.08)
NOK	2,138,925	USD	250,000	25/01/2019	HSBC	(2,360)	
USD	5,723,317	DKK	37,500,000	25/01/2019	Citibank	(43,186)	(0.02)
USD	29,159,322	EUR	25,600,000	25/01/2019	Goldman Sachs	(228,715)	(0.13)
USD	1,128,987	INR	80,000,000	25/01/2019	J.P. Morgan	(13,919)	(0.01)
USD	645,491		13,100,000	25/01/2019	BNY Mellon	(18,728)	

		MXN					(0.01)
USD	3,738,570	EUR	3,300,000	28/01/2019	Bank of America	(50,765)	(0.03)
USD	1,483,886	EUR	1,300,000	29/01/2019	HSBC	(9,018)	(0.01)
先物為替予約の未実現損						<b>(938,147)</b>	<b>(0.54)</b>
<b>JPY Hedged Share Class</b>							
USD	29,409	JPY	3,318,000	18/01/2019	J.P. Morgan	(902)	
ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現損						<b>(902)</b>	
先物為替予約の未実現損合計						<b>(939,049)</b>	<b>(0.54)</b>
先物為替予約の未実現損益総額						<b>2,739,499</b>	<b>1.59</b>

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・インターメディアート・ボンド・ファンド(LUX)

損益および純資産変動計算書

2018年12月31日現在

(USD)

<b>収益</b>	
受取配当金(源泉徴収税額控除後)	
債券および転換社債に係る利息(源泉徴収税額控除後)	3,206,257
銀行預金利息	37,732
スワップ取引	
収益小計	3,243,989
<b>費用</b>	
運用報酬	120,465
管理手数料	156,294
専門家サービス	64,452
年次税	24,581
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	29,523
印刷費用	12,021
その他費用	8,068
当座貸越利息*	
スワップ取引	30,779
費用小計	446,183
費用の払戻し	134,646
投資純利益/(損失)(a)	2,932,452
<b>実現純利益/(損失)</b>	
投資有価証券の売却取引	-1,429,169
スワップ取引	194,647
金融先物取引	-47,587
為替取引	180,794
当期実現純利益/(損失)(b)	-1,101,315
<b>未実現評価利益/(損失)の増減</b>	
投資有価証券	-3,405,467
スワップ取引	-4,977
為替取引	2,966,506
金融先物取引	229,790



当期末実現評価利益/(損失)の増減(c)	-214,148
当期損益(a+b+c)	1,616,989
配当金の分配	
当期投資証券の差引増減額	60,486,718
期首純資産総額	110,646,739
期末純資産総額	172,750,446

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

\*主に中央銀行が実施するマイナス金利政策によるものです。

### 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

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

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

#### 「日本短期債券マザーファンド」の組入有価証券の状況

(有価証券明細表)

(2019年1月23日現在)

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額	
						単価 (円)	評価金額(円)
日本	第4回クレディ・アグリ コル・エス・エー円貨社 債(2014)	0.425	2019/11/28	社債券	100,000	100.208	100,208,000
日本	第19回ルノー円貨社債 (2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	99.503	99,503,000
日本	第11回ウエストパック・ バンキング・コーポレー ション円貨社債(2016)	0.3	2021/1/22	社債券	100,000	100.213	100,213,000
日本	第3回ソシエテ・ジェネ ラル非上位円貨社債 (2018)	0.804	2023/10/12	社債券	100,000	98.616	98,616,000
日本	第488回中部電力	1.562	2019/2/25	社債券	100,000	100.127	100,127,000
日本	第521回関西電力	0.18	2023/9/20	社債券	100,000	99.863	99,863,000
日本	第4回富士フィルムホー ルディングス(社債間限 定同順位特約付)	0.005	2020/3/3	社債券	100,000	99.949	99,949,000
日本	第50回日本電気(社債間 限定同順位特約付)	0.29	2022/6/15	社債券	100,000	100.151	100,151,000
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	100.277	100,277,000

日本	第1回三井住友トラス ト・パナソニックファイ ナンス(社債間限定同順 位特約付)	0.12	2020/10/30	社債券	100,000	100.148	100,148,000
日本	第22回あおぞら銀行(社 債間限定同順位特約付)	0.1	2021/12/10	社債券	100,000	99.968	99,968,000
日本	第28回三菱東京UFJ銀 行(劣後特約付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	102.834	102,834,000
日本	第6回りそな銀行(劣後 特約付)	2.084	2020/3/4	社債券	100,000	102.197	102,197,000
日本	第23回三井住友銀行(劣 後特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	102.859	102,859,000
日本	第22回東京センチュリー リース(社債間限定同順 位特約付)	0.06	2021/4/13	社債券	100,000	99.898	99,898,000
日本	第75回アコム(特定社債 間限定同順位特約付)	0.309	2023/2/28	社債券	100,000	99.826	99,826,000
日本	第69回日立キャピタル (社債間限定同順位特約 付)	0.08	2020/12/18	社債券	100,000	100.026	100,026,000
日本	第33回三菱UFJリース (社債間限定同順位特約 付)	0.297	2020/6/4	社債券	100,000	100.321	100,321,000
合 計					1,800,000		1,806,984,000

## 2【ファンドの現況】

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

<更新・訂正後>

### 【純資産額計算書】

キャピタル・グローバル中期債ファンドF（米ドル売り円買い）

2019年6月28日現在

資産総額	12,509,561,093円
負債総額	56,797,834円
純資産総額（ - ）	12,452,763,259円
発行済口数	12,338,077,390口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0093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）

2019年6月28日現在

資産総額	12,485,536,250円
------	-----------------

負債総額	48,215,000円
純資産総額( - )	12,437,321,250円
発行済口数	12,214,126,064口
1口当たり純資産額( / )	1.0183円

(参考) 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

2019年1月23日現在

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

<訂正前>

- (1) 資本金の額（2018年12月28日現在）  
（中略）
- (2) 会社の機構（2018年12月28日現在）  
（以下略）

<訂正後>

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

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

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

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

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

<訂正後>

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

委託会社の運用する証券投資信託は2019年6月28日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

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

### 3【委託会社等の経理状況】

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

#### < 訂正前 >

##### 1．財務諸表の作成方法について

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

財務諸表に記載している金額は、千円未満の端数を切捨てて表示しております。

##### 2．監査証明について

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

#### < 訂正後 >

##### 1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

##### 2．監査証明について

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

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

#### < 中間財務諸表 >

### (3)【株主資本等変動計算書】

#### (1) 中間貸借対照表

当中間会計期間

(2018年12月31日現在)

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

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

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

## (2) 中間損益計算書

当中間会計期間

(自 2018年 7月 1日 至 2018年 12月31日)

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

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自2018年7月1日 至2018年12月31日)

(単位:千円)

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

[重要な会計方針]



## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

## その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 2．固定資産の減価償却の方法

## (1)有形固定資産

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

## (2)無形固定資産

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

## 3．外貨建資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 4．引当金の計上基準

## (1)賞与引当金

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

## (2)役員賞与引当金

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

## (3)退職給付引当金

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

## 5．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## [表示方法の変更]

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更

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

## [注記事項]

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間  
(2018年12月31日現在)

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

## (中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自2018年7月1日 至2018年12月31日)	
*1. 減価償却実施額	
有形固定資産	10,034千円
無形固定資産	531千円
*2. 当社はキャピタル・グループの日本拠点として、キャピタル・リサーチ・アンド・マネージメント・カンパニー（以下「CRMC社」という。）との役務提供契約に基づき、当社の最終の親会社であるキャピタル・グループ・カンパニーズ・インクの各グループ会社（以下「各グループ会社」という。）との間で各種投資運用サービスを相互に提供しております。	
<p>当社の主要な事業は、当社が各グループ会社に対して提供している各種投資運用サービス（市場調査業務、投資運用関連業務、マーケティング業務、顧客リレーションサポート業務など）であり、当該サービスに係る対価は、営業費用及び一般管理費の合計額から一定の支払手数料を差引いた金額を基準に一定の利益率を加味して算定し、その他営業収益に計上しております。</p> <p>当社が各グループ会社から提供を受けている各種投資運用サービスは、市場調査業務、投資運用関連業務、ITサービスなどであり、当該サービスに係る対価は、当社の委託者報酬及び運用受託報酬を基準に算定し、支払手数料に含めて計上しております。</p>	
*3. 共通発生経費負担額は、各グループ会社の利益規模に応じて負担しております。	

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自2018年7月1日 至2018年12月31日)				
発行済株式の種類及び総数				
株式の種類	当事業年度期首 (株)	増加 (株)	減少 (株)	当中間会計期間末 (株)
普通株式	56,400	-	-	56,400

## [リース取引関係]

当中間会計期間 (自2018年7月1日 至2018年12月31日)	
--------------------------------------	--

## 1. 所有権移転外ファイナンス・リース取引

当中間会計期間末現在、該当するリース取引はありません。

## 2. オペレーティング・リース取引

（借主側）

未経過リース料

1年以内 329,780千円

1年超 1,264,159千円

合計 1,593,939千円

## [金融商品関係]

当中間会計期間

（自2018年7月1日 至2018年12月31日）

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

## (1)現金・預金、未収入金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬

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

## (2)投資有価証券

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

## (3)長期差入保証金

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

負債

## (1)未払金

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

(注2)金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

## [有価証券関係]

当中間会計期間  
(2018年12月31日現在)

(その他有価証券)

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

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

[デリバティブ取引関係]

当中間会計期間  
(自2018年7月1日 至2018年12月31日)

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

[資産除去債務関係]

当中間会計期間  
(2018年12月31日現在)

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減

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

[セグメント情報等]

当中間会計期間  
(自2018年7月1日 至2018年12月31日)

## （セグメント情報）

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## （関連情報）

## 1. サービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

（注）営業収益は、顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## [1株当たり情報]

## 当中間会計期間

（自2018年7月1日 至2018年12月31日）

1株当たり純資産額 48,161.56円

1株当たり中間純利益金額 4,418.88円

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

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

## (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額：324,279百万円（2018年9月30日現在）

（中略）

## (2) 販売会社

名称：みずほ証券株式会社

資本金の額：125,167百万円（2018年9月30日現在）  
（中略）

< 再信託受託会社の概要 >

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

< 訂正後 >

（1）受託会社

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

（2）販売会社

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

< 再信託受託会社の概要 >

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

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年7月16日

キャピタル・インターナショナル株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 中島紀子 印  
業務執行社員

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

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

## 利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年3月18日

キャピタル・インターナショナル株式会社  
取締役 会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐藤 誠 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 水野 龍也 印



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

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

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

#### 利害関係

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

以 上

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