

【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】	2020年8月14日提出
【発行者名】	キャピタル・インターナショナル株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役会長 クワック・ソン・ギョン
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内二丁目1番1号 明治安田生命ビル
【事務連絡者氏名】	原田 伸健
【電話番号】	03(6366)1000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	キャピタル・グローバル中期債ファンド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(2020年2月14日から2021年2月18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、2020年2月13日付け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（2019年12月30日現在）

(以下略)

< 訂正後 >

(前略)

委託会社の概況（2020年6月30日現在）

(以下略)

2【投資方針】

(2)【投資対象】

< 訂正前 >

(前略)

< 参考情報 2 > 投資対象ファンドの概要等

(中略)

上記は、2019年12月31日現在のものであり、今後、投資顧問会社等の判断その他理由により変更される場合があります。

(中略)

上記は、2019年12月31日現在のものであり、今後、委託会社の判断その他理由により変更される場合があります。

< 訂正後 >

(前略)

< 参考情報 2 > 投資対象ファンドの概要等

(中略)

上記は、2020年6月30日現在のものであり、今後、投資顧問会社等の判断その他理由により変更される場合があります。

(中略)

上記は、2020年6月30日現在のものであり、今後、委託会社の判断その他理由により変更される場合があります。

(3)【運用体制】

< 訂正前 >

（前略）

内部管理体制

（中略）

（参考情報）

キャピタル・インターナショナル株式会社の運用部門等の人員体制（2019年12月30日現在）

運用部（3名）／法務コンプライアンス部（3名）／オペレーション部（6名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

上記は2019年12月30日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

<訂正後>

（前略）

内部管理体制

（中略）

（参考情報）

キャピタル・インターナショナル株式会社の運用部門等の人員体制（2020年6月30日現在）

運用部（3名）／法務コンプライアンス部（3名）／オペレーション部（6名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

上記は2020年6月30日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

3【投資リスク】

<訂正前>

（前略）

上記は2019年12月30日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

<訂正後>

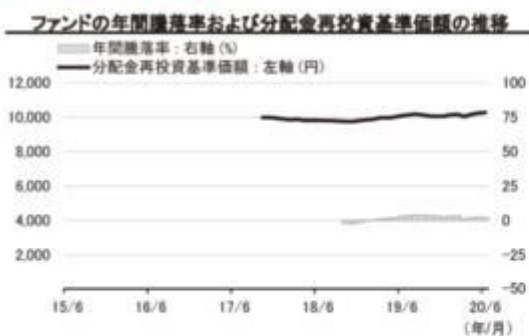
（前略）

上記は2020年6月30日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

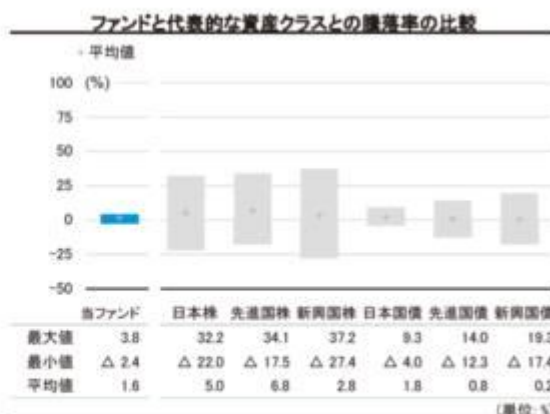
原届出書の第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 3投資リスク リスクの定量的比較につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

リスクの定量的比較



(注1) 年間騰落率は、2018年10月から2020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、2015年7月から2020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2020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、知的財産その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

「日本国債」の資産クラスはNOMURA-BPI国債を表示しております。

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社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。以下の取扱い内容は、2019年12月31日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご留意ください。また、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が以下と異なる場合があります。

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

(以下略)

< 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、2020年6月30日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご留意ください。また、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が以下と異なる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

（以下略）

5【運用状況】

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

< 更新・訂正後 >

（1）【投資状況】

キャピタル・グローバル中期債ファンドF（米ドル売り円買い）

2020年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	12,471,901,351	99.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		35,398,427	0.28
合計(純資産総額)		12,507,299,778	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）

2020年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	6,979,424	0.05
投資証券	ルクセンブルク	12,446,032,644	99.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		19,000,000	0.15
合計(純資産総額)		12,472,012,068	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）

2020年6月30日現在

資産の種類	国/地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
	米国	9,468,182,108	40.70
	英国	1,390,669,056	5.98
	ドイツ	1,350,646,880	5.81
	日本	1,246,246,334	5.36
	中国	1,107,764,915	4.76

債券	国際機関	972,462,685	4.18
	メキシコ	874,261,502	3.76
	フランス	728,504,796	3.13
	カナダ	600,098,596	2.58
	オーストラリア	594,826,839	2.56
	韓国	444,265,396	1.91
	スペイン	432,745,465	1.86
	マレーシア	382,462,895	1.64
	インド	369,102,559	1.59
	デンマーク	355,249,442	1.53
	イタリア	336,293,409	1.45
	インドネシア	249,561,656	1.07
	ロシア	243,267,691	1.05
	オランダ	236,873,707	1.02
	ポーランド	194,677,271	0.84
	カタール	152,011,892	0.65
	ノルウェー	147,225,970	0.63
	ポルトガル	139,048,212	0.60
	スウェーデン	115,265,115	0.50
	ベルギー	114,552,118	0.49
	アイルランド	100,826,351	0.43
	フィリピン	98,913,367	0.43
	リトアニア	88,013,197	0.38
	タイ	53,408,818	0.23
	シンガポール	53,050,433	0.23
	スイス	50,538,043	0.22
	サウジアラビア	46,402,684	0.20
	アラブ首長国連邦	38,088,046	0.16
	パナマ	37,127,546	0.16
	ブラジル	36,221,887	0.16
香港	21,383,101	0.09	
ルクセンブルク	20,721,485	0.09	
ペルー	7,314,695	0.03	
銀行預金、その他資産（負債控除後）	365,126,470	1.57	
純資産総額	23,263,402,632	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

2020年1月22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	1,706,042,000	93.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		119,860,149	6.56

合計(純資産総額)	1,825,902,149	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(2020年1月22日)現在の情報です。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

キャピタル・グローバル中期債ファンドF(米ドル売り円買い)

a. 上位30銘柄

2020年6月30日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	キャピタル・グローバル中期債マ ザーファンド(米ドル売り円買 い)	11,972,642,173	1.0179	12,186,952,468	1.0417	12,471,901,351	99.71

(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

2020年6月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.71
合計	99.71

(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

2020年6月30日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ルクセン ブルク	投資証券	キャピタル・グループ・グローバ ル・インターミディエイト・ボン ド・ファンド(LUX)(クラス Ch-JPY)	10,371,693.87	1,173.4	12,170,145,587	1,200	12,446,032,644	99.79
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	1.0545	7,002,666	1.051	6,979,424	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

2020年6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.05

投資証券	99.79
合計	99.84

(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)

上位30銘柄

2020年6月30日現在

順位	銘柄	利率(%) (上段) 償還日 (下段)	国/地域 (上段) 資産(中 段) 業種/種類 (下段)	数量	評価単価 (上段) 通貨(下段)	評価金額(円)	投資 比率 (%)
1	JAPAN GVT 346 JPY BD	0.1 2027/3/20	日本 債券 国債証券	670,000,000	101.447 日本円	679,694,900	2.92
2	UMBS 15YR TBA (REG B) 2.0 UMBS TBA	2.0 2035/8/1	米国 債券 その他債券	4,750,000	103.1694 米ドル	527,372,440	2.27
3	FNCL 3.5 UMBS TBA	3.5 2050/8/1	米国 債券 その他債券	4,624,000	105.1391 米ドル	523,184,541	2.25
4	UMBS 15YR TBA (REG B) 3.0 UMBS TBA	3.0 2035/7/1	米国 債券 その他債券	4,470,519	105.1152 米ドル	505,704,037	2.17
5	US TREASURY NOTE	1.125 2022/2/28	米国 債券 国債証券	4,310,000	101.6101 米ドル	471,288,650	2.03
6	US TREASURY NOTE	1.875 2026/6/30	米国 債券 国債証券	3,500,000	108.7984 米ドル	409,791,913	1.76
7	G2SF 2.5 TBA	2.5 2050/8/1	米国 債券 その他債券	3,500,000	104.9609 米ドル	395,338,001	1.70
8	CHINA PEOPLES REP CNY	3.29 2029/5/23	中国 債券 国債証券	24,000,000	102.6626 中国元	374,631,230	1.61
9	CHINA DEV BANK CNY UNSEC	4.73 2025/4/2	中国 債券 国債証券	21,000,000	107.0023 中国元	341,659,085	1.47
10	UMBS 30YR TBA (REG A) 3.0 UMBS TBA	3.0 2050/8/1	米国 債券 その他債券	3,000,000	105.0972 米ドル	339,301,078	1.46
11	CANADA GOVT CAD BOND	2.25 2025/6/1	カナダ 債券 国債証券	3,850,000	109.224 カナダ・ドル	330,860,478	1.42
12	DEUTSCHLAND REP EUR REG S (B)	0.25 2029/2/15	ドイツ 債券 国債証券	2,500,000	107.3273 ユーロ	324,454,709	1.39
13	UMBS 30YR TBA (REG A) 2.5 UMBS TBA	2.5 2050/9/1	米国 債券 その他債券	2,900,000	103.7927 米ドル	323,919,822	1.39

14	CHINA PEOPLES REP CNY	3.25 2026/6/6	中国 債券 国債証券	20,000,000	102.5746 中国元	311,925,327	1.34
15	AUSTRALIA GOVT BD AUD REG S	2.5 2030/5/21	オーストラ リア 債券 国債証券	3,600,000	115.3229 オーストラ リア・ドル	306,667,786	1.32
16	US TREASURY NOTE	1.5 2024/10/31	米国 債券 国債証券	2,500,000	105.4184 米ドル	283,614,961	1.22
17	EFSF EUR REG S (B)	0.4 2025/2/17	国際機関 債券 国債証券	2,225,000	104.2529 ユーロ	280,493,002	1.21
18	EUROPEAN INVT BK EUR	- 2023/10/16	国際機関 債券 国債証券	2,080,000	101.9752 ユーロ	256,484,882	1.10
19	DEUTSCHLAND REP EUR REG S (B)	0.5 2028/2/15	ドイツ 債券 国債証券	1,900,000	108.8413 ユーロ	250,064,010	1.07
20	NYKREDIT DKK REG S SEC SER 01E SF	0.5 2040/10/1	デンマーク 債券 その他債券	15,244,193	98.40 デンマー ク・クロ ネ	243,400,396	1.05
21	MALAYSIA GVT MYR	3.885 2029/8/15	マレーシア 債券 国債証券	8,930,000	107.8872 マレーシ ア・リン ギット	241,959,970	1.04
22	UTD KINGDOM GILT REG S GBP	4.25 2027/12/7	英国 債券 国債証券	1,320,000	131.518 英ポンド	229,653,019	0.99
23	US TREASURY NOTE	1.75 2024/12/31	米国 債券 国債証券	2,000,000	106.6995 米ドル	229,649,269	0.99
24	SPAIN GOVT EUR 144A LIFE/REG S	2.75 2024/10/31	スペイン 債券 国債証券	1,460,000	112.8161 ユーロ	199,171,763	0.86
25	US TREASURY NOTE	1.375 2025/1/31	米国 債券 国債証券	1,740,000	105.0822 米ドル	196,766,609	0.85
26	UTD MEX ST GVT GLOBAL JPY	0.6 2023/4/20	メキシコ 債券 国債証券	200,000,000	98.3042 日本円	196,608,388	0.85
27	CITIGROUP INC SR UNSEC	3.106 2026/4/8	米国 債券 社債券	1,680,000	107.5287 米ドル	194,404,564	0.84
28	UTD KINGDOM GILT GBP REG S	2.75 2024/9/7	英国 債券 国債証券	1,310,000	111.8601 英ポンド	193,847,200	0.83

29	FNCL UMBS 3.0 CA5333	3.0 2050/3/1	米国 債券 その他債券	1,474,324	106.633 米ドル	169,183,277	0.73
30	FHMS K733 A2 (MF)	3.75 2025/8/25	米国 債券 その他債券	1,250,000	113.3463 米ドル	152,472,053	0.66

(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

2020年1月22日現在

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	
日本	第29回フランス相互 信用連合銀行(BF CM)円貨社債 (2019)	0.25	2024/10/10	社債券	100,000	99.829	99,829,000	5.47
日本	第2回マラヤン・バン キング・ベルハッ ド円貨社債(2015)	0.509	2020/4/30	社債券	100,000	100.08	100,080,000	5.48
日本	第1回バンコ・サン タンデール・エセ・ ア - 円貨社債 (2019)	0.463	2024/12/5	社債券	100,000	99.766	99,766,000	5.46
日本	第17回シティグルー プ・インク 円貨社 債(2005)	2.04	2020/9/16	社債券	100,000	101.21	101,210,000	5.54
日本	第19回ルノー円貨社 債(2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	99.859	99,859,000	5.47
日本	第8回ケーティー円 貨社債(2018)	0.3	2020/11/13	社債券	100,000	99.957	99,957,000	5.47
日本	第1回明治安田生命 2019基金特定目的会 社特定社債(一般担 保付)	0.29	2024/8/2	社債券	100,000	99.857	99,857,000	5.47
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	99.941	99,941,000	5.47
日本	第28回三菱東京UF J銀行(劣後特約 付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	101.45	101,450,000	5.56
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	101.348	101,348,000	5.55
日本	第19回みずほ銀行 (劣後特約付)	1.67	2022/2/24	社債券	100,000	103.207	103,207,000	5.65

日本	第22回芙蓉総合リース(社債間限定同順位特約付)	0.04	2022/10/28	社債券	100,000	99.648	99,648,000	5.46
日本	第5回イオンフィナンシャルサービス(社債間限定同順位特約付)	0.23	2022/5/27	社債券	100,000	99.949	99,949,000	5.47
日本	第75回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.309	2023/2/28	社債券	100,000	100.049	100,049,000	5.48
日本	第74回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付)	0.09	2023/1/23	社債券	100,000	99.931	99,931,000	5.47
日本	第2回野村ホールディングス(担保提供制限等財務上特約無)	0.29	2024/9/3	社債券	100,000	99.628	99,628,000	5.46
日本	第29回相鉄ホールディングス(相模鉄道株式会社保証付)	0.91	2020/6/25	社債券	100,000	100.333	100,333,000	5.49

(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(2020年1月22日)現在の情報です。

【投資不動産物件】

キャピタル・グローバル中期債ファンド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
第3期 (2019年11月20日)	12,089,202,053	12,089,202,053	1.0073	1.0073
2019年 6月末日	12,452,763,259		1.0093	
7月末日	12,529,087,776		1.0131	
8月末日	12,289,128,526		1.0179	
9月末日	12,300,813,087		1.0132	
10月末日	12,126,751,200		1.0076	
11月末日	12,282,324,117		1.0063	
12月末日	12,233,024,154		1.0050	
2020年 1月末日	12,854,015,867		1.0130	
2月末日	13,117,465,833		1.0170	
3月末日	12,963,605,217		1.0036	
4月末日	13,247,997,249		1.0161	
5月末日	13,124,078,172		1.0225	
6月末日	12,507,299,778		1.0272	

(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
第3期	2018年11月21日～2019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期	2018年11月21日～2019年11月20日	3.4
第4中間計算期間末	2019年11月21日～2020年 5月20日	1.1

(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期	2018年11月21日～2019年11月20日	2,942,323,671	2,885,541,964	12,001,050,595
第4中間計算期間末	2019年11月21日～2020年5月20日	2,000,560,757	1,124,962,429	12,876,648,923

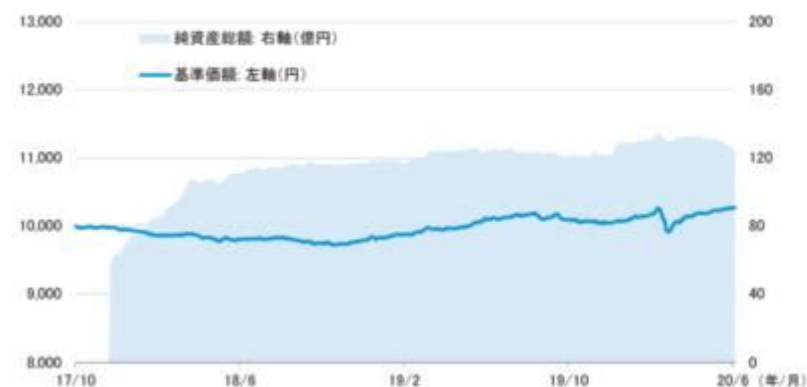
(注)第1期の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(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

2020年6月30日現在

基準価額・純資産の推移(設定～2020年6月30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
第3期	2019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(2020年6月30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・インターメディアイト・ボンド・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)	99.79
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.05

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

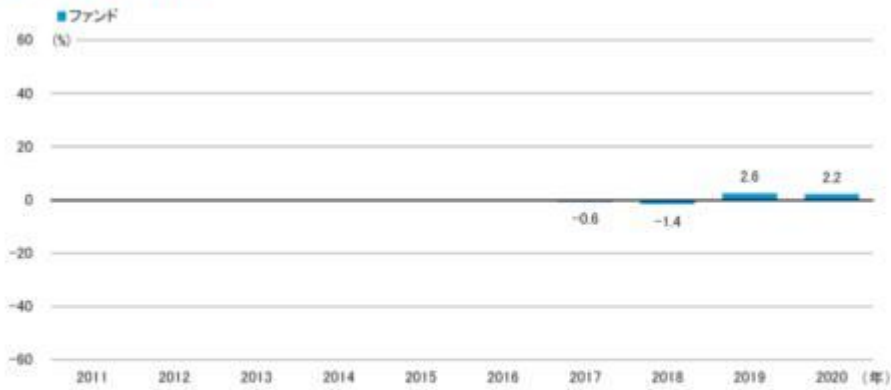
(2020年6月30日現在)

上位10銘柄				
順位	銘柄名	国名/地域名	証券種別	投資比率(%)
1	JAPAN GVT 346 JPY BD 0.1% 03-20-27	日本	国債証券	2.92
2	UMBS 15YR TBA(REG B) 2.0 UMBS TBA 08-01-35	米国	その他証券	2.27
3	FNCL 3.5 UMBS TBA 08-01-50	米国	その他証券	2.25
4	UMBS 15YR TBA(REG B) 3.0 UMBS TBA 07-01-35	米国	その他証券	2.17
5	US TREASURY NOTE 1.125% 02-28-22	米国	国債証券	2.03
6	US TREASURY NOTE 1.875% 06-30-26	米国	国債証券	1.76
7	G2SF 2.5 TBA 08-01-50	米国	その他証券	1.70
8	CHINA PEOPLES REP CNY 3.29% 05-23-29	中国	国債証券	1.61
9	CHINA DEV BANK CNY UNSEC 4.73% 04-02-25	中国	国債証券	1.47
10	UMBS 30YR TBA(REG A) 3.0 UMBS TBA 08-01-50	米国	その他証券	1.48

証券種別構成比率	
証券種別	投資比率(%)
国債証券	45.02
社債券	34.70
その他証券	18.71
現金・その他	1.57

国別構成比率	
国名	投資比率(%)
米国	40.70
英国	5.98
ドイツ	5.81
日本	5.36
中国	4.76
その他国	-35.83
現金・その他	1.57

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として算出しています。

2017年は設定日から年末までの収益率を表示、2020年は6月末までの収益率を表示しています。

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

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

第3【ファンドの経理状況】

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

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間（2019年11月21日から2020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3期 2019年11月20日現在	第4期中間計算期間 2020年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	44,401,312	73,051,293
親投資信託受益証券	12,084,240,450	13,092,707,001
未収入金	17,500,000	27,000,000
流動資産合計	12,146,141,762	13,192,758,294
資産合計	12,146,141,762	13,192,758,294
負債の部		
流動負債		
未払解約金	27,092,642	48,082,346
未払受託者報酬	1,348,931	1,406,504
未払委託者報酬	27,653,023	28,833,277
未払利息	121	200
その他未払費用	844,992	865,592
流動負債合計	56,939,709	79,187,919
負債合計	56,939,709	79,187,919
純資産の部		
元本等		
元本	12,001,050,595	12,876,648,923
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	88,151,458	236,921,452
元本等合計	12,089,202,053	13,113,570,375
純資産合計	12,089,202,053	13,113,570,375
負債純資産合計	12,146,141,762	13,192,758,294

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	第3期中間計算期間 自 2018年11月21日 至 2019年5月20日	第4期中間計算期間 自 2019年11月21日 至 2020年5月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	321,292,409	173,959,551
営業収益合計	321,292,409	173,959,551
営業費用		
支払利息	20,410	35,691
受託者報酬	1,281,068	1,406,504
委託者報酬	26,261,833	28,833,277
その他費用	879,660	865,882
営業費用合計	28,442,971	31,141,354
営業利益又は営業損失()	292,849,438	142,818,197
経常利益又は経常損失()	292,849,438	142,818,197
中間純利益又は中間純損失()	292,849,438	142,818,197
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()	10,012,317	2,622,459
期首剰余金又は期首欠損金()	306,910,522	88,151,458
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,423,951	16,915,026
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	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	-	16,915,026
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,248,236	8,340,770
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	8,340,770
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,248,236	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	16,897,686	236,921,452

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年11月20日現在	第4期中間計算期間 2020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 12,001,050,595口	1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数 12,876,648,923口
2. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0073円 (1万口当たり純資産額) (10,073円)	2. 当該中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0184円 (1万口当たり純資産額) (10,184円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 自 2018年11月21日 至 2019年11月20日	第4期中間計算期間 自 2019年11月21日 至 2020年5月20日
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることもあります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

当ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第3期	第4期中間計算期間
	自 2018年11月21日 至 2019年11月20日	自 2019年11月21日 至 2020年5月20日
期首元本額	11,944,268,888円	12,001,050,595円
期中追加設定元本額	2,942,323,671円	2,000,560,757円
期中一部解約元本額	2,885,541,964円	1,124,962,429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）

2020年5月20日現在	
資産の部	
流動資産	
投資信託受益証券	6,974,775
投資証券	13,060,285,269
未収入金	52,000,000
流動資産合計	13,119,260,044
資産合計	13,119,260,044
負債の部	
流動負債	
未払解約金	27,000,000
流動負債合計	27,000,000
負債合計	27,000,000
純資産の部	
元本等	
元本	12,684,273,398
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	407,986,646
元本等合計	13,092,260,044
純資産合計	13,092,260,044
負債純資産合計	13,119,260,044

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	2020年5月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数		12,684,273,398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	1.0322円
	(1万口当たり純資産額)	(10,322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 2019年11月21日 至 2020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	2020年5月20日現在
同計算期間の期首元本額	11,867,073,014円
同計算期間の追加設定元本額	1,661,982,664円
同計算期間の一部解約元本額	844,782,280円
計算日の元本額	12,684,273,398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）	12,684,273,398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、2019年12月31日付けで、ルクセンブルクにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務書類が作成されております。この財務書類は独立監査人であるブライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コオペラティブの監査を受けております。以下の「投資明細表」および「損益および純資産変動計算書」は、原文の財務書類から委託会社が抜粋・翻訳したものでありますが、これらは監査意見の対象外であります。

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

投資明細表

Capital Group Global Intermediate Bond Fund (LUX)
As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing				
Bonds				
<i>Australia</i>				
Australia Government Bond, Reg. S 5.5% 21/04/2023	AUD	3,500,000	2,819,255	1.44
Australia Government Bond, Reg. S 2.75% 21/04/2024	AUD	2,000,000	1,507,204	0.77
Australia Government Bond, Reg. S 5.75% 15/07/2022	AUD	800,000	629,301	0.32
Scentre Group Trust 1, REIT, Reg. S 2.375% 08/04/2022	GBP	100,000	135,693	0.07
Scentre Group Trust 1, REIT, Reg. S 2.25% 16/07/2024	EUR	100,000	121,727	0.07
			<u>5,213,180</u>	<u>2.67</u>
<i>Austria</i>				
Oesterreichische Kontrollbank AG 1.75% 24/01/2020	USD	105,000	104,995	0.05
			<u>104,995</u>	<u>0.05</u>
<i>Belgium</i>				
Anheuser-Busch InBev SA/NV, Reg. S 1.15% 22/01/2027	EUR	400,000	472,623	0.24
			<u>472,623</u>	<u>0.24</u>
<i>Canada</i>				
Canada Government Bond 1% 01/06/2027	CAD	2,450,000	1,792,742	0.92
Canada Government Bond 2.25% 01/06/2025	CAD	4,200,000	3,328,206	1.70
Export Development Canada 2.5% 24/01/2023	USD	1,000,000	1,024,113	0.52
Province of Alberta Canada 1.875% 13/11/2024	USD	250,000	249,117	0.13
Province of Quebec Canada 2.375% 31/01/2022	USD	114,000	115,370	0.06
			<u>6,509,548</u>	<u>3.33</u>
<i>China</i>				
China Development Bank 4.73% 02/04/2025	CNY	21,000,000	3,214,688	1.64
China Government Bond 3.25% 06/06/2026	CNY	20,000,000	2,904,334	1.49
China Government Bond 3.29% 23/05/2029	CNY	10,000,000	1,451,513	0.74
			<u>7,570,535</u>	<u>3.87</u>
<i>Denmark</i>				
Danske Bank A/S, 144A 3.875% 12/09/2023	USD	500,000	519,190	0.26
			<u>519,190</u>	<u>0.26</u>
<i>France</i>				
AXA SA, Reg. S, FRN 5.25% 16/04/2040	EUR	300,000	341,439	0.17
BPCE SA, Reg. S 4.625% 18/07/2023	EUR	300,000	387,571	0.20
RCI Banque SA, Reg. S 0.75% 26/09/2022	EUR	100,000	113,403	0.06
Sanofi, Reg. S 1% 21/03/2026	EUR	500,000	593,493	0.30
Total Capital International SA 2.434% 10/01/2025	USD	495,000	501,154	0.26
Veolia Environnement SA, Reg. S 0% 23/11/2020	EUR	200,000	224,787	0.11
Veolia Environnement SA, Reg. S 4.247% 06/01/2021	EUR	100,000	117,272	0.06
Veolia Environnement SA, Reg. S 0.314% 04/10/2023	EUR	200,000	226,319	0.12
			<u>2,505,438</u>	<u>1.28</u>

Capital Group Global Intermediate Bond Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Germany</i>				
Allianz SE, Reg. S, FRN 4.75% Perpetual	EUR	500,000	649,001	0.33
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.5% 15/02/2028	EUR	1,500,000	1,793,598	0.92
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 2% 04/01/2022	EUR	2,100,000	2,481,958	1.27
Daimler AG, Reg. S 0.375% 08/11/2026	EUR	250,000	277,174	0.14
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.125% 07/03/2022	USD	333,000	336,272	0.17
Landwirtschaftliche Rentenbank 2% 06/12/2021	USD	140,000	140,910	0.07
Merck Financial Services GmbH, Reg. S 1.375% 01/09/2022	EUR	100,000	116,118	0.06
Volkswagen Leasing GmbH, Reg. S 1.125% 04/04/2024	EUR	350,000	401,418	0.21
			<u>6,196,449</u>	<u>3.17</u>
<i>India</i>				
India Government Bond 7.27% 08/04/2026	INR	60,000,000	868,543	0.44
India Government Bond 7.35% 22/06/2024	INR	100,000,000	1,444,293	0.74
			<u>2,312,836</u>	<u>1.18</u>
<i>Indonesia</i>				
Indonesia Treasury 6.5% 15/06/2025	IDR	20,000,000,000	1,449,883	0.74
			<u>1,449,883</u>	<u>0.74</u>
<i>Ireland</i>				
Abbott Ireland Financing DAC, Reg. S 0.875% 27/09/2023	EUR	410,000	474,813	0.24
CRH Finance DAC, Reg. S 3.125% 03/04/2023	EUR	100,000	123,208	0.07
			<u>598,021</u>	<u>0.31</u>
<i>Italy</i>				
Intesa Sanpaolo SpA, Reg. S 3.928% 15/09/2026	EUR	250,000	320,782	0.16
Intesa Sanpaolo SpA, Reg. S 6.625% 13/09/2023	EUR	300,000	402,393	0.21
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 1.45% 15/11/2024	EUR	5,000,000	5,841,900	2.99
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 2.1% 15/07/2026	EUR	1,200,000	1,445,372	0.74
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA, Reg. S 0.875% 02/02/2022	EUR	100,000	114,277	0.06
UniCredit SpA, Reg. S 1% 18/01/2023	EUR	250,000	283,449	0.15
UniCredit SpA, Reg. S, FRN 4.375% 03/01/2027	EUR	250,000	297,549	0.15
UniCredit SpA, Reg. S 6.95% 31/10/2022	EUR	200,000	262,124	0.13
			<u>8,967,846</u>	<u>4.59</u>
<i>Japan</i>				
American Honda Finance Corp. 1.375% 10/11/2022	EUR	200,000	233,105	0.12
Japan Bank for International Cooperation 2.5% 23/05/2024	USD	220,000	224,460	0.12
Japan Bank for International Cooperation 2.125% 16/11/2020	USD	300,000	300,771	0.15
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/12/2022	JPY	230,000,000	2,131,839	1.09
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/06/2024	JPY	200,000,000	1,859,601	0.95
Japan Government Ten Year Bond 0.8% 20/06/2023	JPY	245,000,000	2,328,433	1.19
Japan Government Ten Year Bond 0.3% 20/12/2024	JPY	150,000,000	1,410,103	0.72
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/03/2027	JPY	510,000,000	4,763,055	2.44

Capital Group Global Intermediate Bond Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., Reg. S 2.25% 21/11/2026	EUR	350,000	438,859	0.22
Toyota Motor Credit Corp. 3.35% 08/01/2024	USD	150,000	157,466	0.08
Toyota Motor Credit Corp. 2.15% 08/09/2022	USD	130,000	130,986	0.07
			13,978,678	7.15
<i>Lithuania</i>				
Lithuania Government Bond, 144A 6.625% 01/02/2022	USD	750,000	822,442	0.42
			822,442	0.42
<i>Luxembourg</i>				
DH Europe Finance II Sarl 0.45% 18/03/2028	EUR	175,000	194,264	0.10
			194,264	0.10
<i>Mexico</i>				
Mexican Bonos 10% 05/12/2024	MXN	38,000,000	2,283,095	1.17
Mexican Bonos 5.75% 05/03/2026	MXN	21,000,000	1,053,360	0.54
			3,336,455	1.71
<i>Netherlands</i>				
Enel Finance International NV, Reg. S 1% 16/09/2024	EUR	350,000	407,251	0.21
Unilever NV, Reg. S 0.375% 14/02/2023	EUR	100,000	113,955	0.06
			521,206	0.27
<i>Norway</i>				
Equinor ASA 2.75% 10/11/2021	USD	250,000	254,409	0.13
Norway Government Bond, Reg. S, 144A 3.75% 25/05/2021	NOK	5,000,000	588,714	0.30
			843,123	0.43
<i>Poland</i>				
Poland Government Bond 4% 22/01/2024	USD	220,000	237,133	0.12
Poland Government Bond 5.75% 25/10/2021	PLN	6,000,000	1,701,940	0.87
Poland Government Bond 5.75% 23/09/2022	PLN	1,500,000	438,689	0.23
Poland Government Bond 4% 25/10/2023	PLN	5,900,000	1,685,634	0.86
Poland Government Bond 3.25% 06/04/2026	USD	25,000	26,558	0.01
			4,089,954	2.09
<i>Portugal</i>				
Portugal Government Bond, Reg. S 5.125% 15/10/2024	USD	150,000	168,805	0.09
Portugal Obrigaçoes do Tesouro OT, Reg. S, 144A 2.875% 15/10/2025	EUR	1,850,000	2,410,145	1.23
			2,578,950	1.32
<i>Qatar</i>				
Qatar Government Bond, Reg. S 3.875% 23/04/2023	USD	1,010,000	1,067,788	0.55
			1,067,788	0.55
<i>Saudi Arabia</i>				
Saudi Government Bond, 144A 3.625% 04/03/2028	USD	200,000	211,544	0.11
Saudi Government Bond, Reg. S 2.875% 04/03/2023	USD	400,000	407,753	0.21

Capital Group Global Intermediate Bond Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Saudi Government Bond, Reg. S 4% 17/04/2025	USD	475,000	512,950	0.26
			1,132,247	0.58
<i>Spain</i>				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Reg. S 1.375% 14/05/2025	EUR	300,000	353,913	0.18
Banco Santander SA, Reg. S 1.375% 09/02/2022	EUR	100,000	115,417	0.06
CaixaBank SA, Reg. S, FRN 3.5% 15/02/2027	EUR	300,000	355,705	0.18
Iberdrola Finanzas SA, Reg. S 1% 07/03/2025	EUR	300,000	350,554	0.18
Iberdrola International BV, Reg. S, FRN 2.625% Perpetual	EUR	300,000	360,096	0.18
Spain Government Bond, Reg. S, 144A 2.75% 31/10/2024	EUR	3,750,000	4,781,180	2.45
			6,316,865	3.23
<i>Supra National</i>				
Asian Development Bank 2.75% 17/03/2023	USD	641,000	662,279	0.34
European Financial Stability Facility, Reg. S 0.4% 17/02/2025	EUR	2,225,000	2,570,793	1.31
European Investment Bank 0% 16/10/2023	EUR	1,000,000	1,135,925	0.58
European Investment Bank 1.375% 15/09/2021	USD	250,000	248,830	0.13
European Investment Bank 2.25% 15/03/2022	USD	825,000	835,117	0.43
European Stability Mechanism, Reg. S 2.125% 03/11/2022	USD	938,000	949,169	0.49
Inter-American Development Bank 2.5% 18/01/2023	USD	1,500,000	1,535,216	0.78
			7,937,329	4.06
<i>Sweden</i>				
Sweden Government Bond, 144A 2.375% 15/02/2023	USD	365,000	372,708	0.19
			372,708	0.19
<i>Switzerland</i>				
Credit Suisse Group AG, Reg. S, FRN 2.125% 12/09/2025	GBP	100,000	134,719	0.07
			134,719	0.07
<i>Thailand</i>				
Thailand Government Bond 2.125% 17/12/2026	THB	40,000,000	1,403,857	0.72
			1,403,857	0.72
<i>United Kingdom</i>				
AstraZeneca plc 3.5% 17/08/2023	USD	700,000	732,507	0.37
Barclays Bank plc, Reg. S 10% 21/05/2021	GBP	50,000	73,795	0.04
BAT Capital Corp. 2.764% 15/08/2022	USD	330,000	334,806	0.17
BAT Capital Corp. 3.215% 06/09/2026	USD	600,000	604,817	0.31
Cadent Finance plc, Reg. S 1.125% 22/09/2021	GBP	100,000	132,777	0.07
GlaxoSmithKline Capital plc 2.875% 01/06/2022	USD	800,000	817,333	0.42
HSBC Holdings plc, FRN 4.292% 12/09/2026	USD	350,000	378,390	0.19
HSBC Holdings plc, FRN 3.033% 22/11/2023	USD	550,000	562,792	0.29
Lloyds Bank plc, Reg. S 6.5% 24/03/2020	EUR	50,000	56,899	0.03
Lloyds Banking Group plc 4.45% 08/05/2025	USD	600,000	655,334	0.34
Shell International Finance BV 3.5% 13/11/2023	USD	874,000	920,410	0.47
Shell International Finance BV 1.875% 10/05/2021	USD	100,000	100,097	0.05

Capital Group Global Intermediate Bond Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/09/2021	USD	448,000	450,546	0.23
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23/09/2023	USD	532,000	542,066	0.28
UK Treasury, Reg. S 2.75% 07/09/2024	GBP	2,000,000	2,911,418	1.49
UK Treasury, Reg. S 4.25% 07/12/2027	GBP	1,000,000	1,689,278	0.86
			10,963,265	5.61
<i>United States of America</i>				
Abbott Laboratories 3.75% 30/11/2026	USD	124,000	135,504	0.07
AbbVie, Inc. 2.5% 14/05/2020	USD	100,000	100,156	0.05
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT 2.75% 15/12/2029	USD	243,000	240,036	0.12
Allergan Funding SCS 0.5% 01/06/2021	EUR	100,000	113,047	0.06
Allergan Funding SCS 3.8% 15/03/2025	USD	189,000	198,561	0.10
Altria Group, Inc. 1.7% 15/06/2025	EUR	1,000,000	1,166,203	0.60
Altria Group, Inc. 4.8% 14/02/2029	USD	500,000	557,055	0.28
American Campus Communities Operating Partnership LP, REIT 3.3% 15/07/2026	USD	402,000	416,603	0.21
Aon Corp. 2.2% 15/11/2022	USD	384,000	385,859	0.20
Apache Corp. 4.25% 15/01/2030	USD	250,000	259,276	0.13
Bank of America Corp. 2.625% 19/04/2021	USD	100,000	100,959	0.05
Boeing Co. (The) 2.7% 01/02/2027	USD	600,000	608,237	0.31
Boston Scientific Corp. 3.45% 01/03/2024	USD	535,000	559,696	0.29
Chevron Corp. 2.498% 03/03/2022	USD	120,000	121,959	0.06
Cigna Corp. 4.125% 15/11/2025	USD	280,000	303,933	0.16
CMS Energy Corp. 3.45% 15/08/2027	USD	250,000	261,548	0.13
Conagra Brands, Inc. 4.3% 01/05/2024	USD	360,000	387,659	0.20
Dominion Energy, Inc., STEP 3.071% 15/08/2024	USD	150,000	154,554	0.08
Duke Energy Corp. 3.75% 15/04/2024	USD	250,000	264,926	0.14
Edison International 2.125% 15/04/2020	USD	200,000	200,126	0.10
FirstEnergy Corp. 4.25% 15/03/2023	USD	100,000	105,428	0.05
FirstEnergy Corp. 3.9% 15/07/2027	USD	250,000	267,337	0.14
General Motors Financial Co., Inc., Reg. S 1.694% 26/03/2025	EUR	300,000	346,621	0.18
JPMorgan Chase & Co. 2.4% 07/06/2021	USD	100,000	100,662	0.05
Merck & Co., Inc. 2.9% 07/03/2024	USD	335,000	348,677	0.18
Morgan Stanley 2.5% 21/04/2021	USD	100,000	100,782	0.05
Morgan Stanley 2.75% 19/05/2022	USD	200,000	203,665	0.10
NV Energy, Inc. 6.25% 15/11/2020	USD	100,000	103,531	0.05
Occidental Petroleum Corp. 3.2% 15/08/2026	USD	348,000	352,413	0.18
Pfizer, Inc. 2.95% 15/03/2024	USD	265,000	275,132	0.14
Philip Morris International, Inc. 2% 21/02/2020	USD	55,000	54,993	0.03
Philip Morris International, Inc. 2.625% 18/02/2022	USD	65,000	65,807	0.03
Prologis LP, REIT 1.375% 13/05/2021	EUR	100,000	114,029	0.06
Public Service Enterprise Group, Inc. 2% 15/11/2021	USD	50,000	49,970	0.03
Reynolds American, Inc. 3.25% 12/06/2020	USD	100,000	100,463	0.05
Reynolds American, Inc. 4.45% 12/06/2025	USD	250,000	269,155	0.14
Union Pacific Corp. 3.15% 01/03/2024	USD	325,000	338,305	0.17
United Technologies Corp. 3.65% 16/08/2023	USD	500,000	527,031	0.27
UnitedHealth Group, Inc. 2.375% 15/08/2024	USD	165,000	167,147	0.09
US Treasury 2.875% 30/11/2023	USD	1,500,000	1,569,199	0.80
US Treasury 2.375% 29/02/2024	USD	1,000,000	1,028,633	0.53

Capital Group Global Intermediate Bond Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
US Treasury 1.75% 30/06/2024	USD	2,500,000	2,508,203	1.28
US Treasury 1.75% 31/07/2024	USD	1,000,000	1,003,320	0.51
US Treasury 1.5% 31/10/2024	USD	2,500,000	2,479,394	1.27
US Treasury 1.875% 30/06/2026	USD	3,500,000	3,517,500	1.80
US Treasury 1.375% 31/08/2026	USD	1,000,000	972,930	0.50
US Treasury 2% 30/11/2022	USD	1,750,000	1,769,180	0.91
US Treasury Inflation Indexed 0.875% 15/01/2029	USD	3,300,000	3,573,292	1.83
US Treasury Inflation Indexed 1% 15/02/2049	USD	250,000	284,552	0.15
US Treasury Inflation Indexed 0.375% 15/01/2027	USD	4,950,000	5,356,124	2.74
US Treasury Inflation Indexed 1% 15/02/2046	USD	250,000	299,265	0.15
Walmart, Inc. 3.4% 26/06/2023	USD	566,000	595,087	0.30
Wells Fargo & Co. 2.625% 22/07/2022	USD	500,000	507,382	0.26
			35,891,106	18.36
Total Bonds			134,005,500	68.55
Total Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing			134,005,500	68.55
Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market				
Bonds				
<i>Canada</i>				
Toronto-Dominion Bank (The) 2.65% 12/06/2024	USD	500,000	512,072	0.26
			512,072	0.26
<i>Denmark</i>				
Danske Bank A/S, 144A 2.8% 10/03/2021	USD	500,000	503,587	0.26
			503,587	0.26
<i>Germany</i>				
Daimler Finance North America LLC, 144A 3% 22/02/2021	USD	500,000	504,959	0.26
Daimler Finance North America LLC, Reg. S 2.45% 18/05/2020	USD	650,000	650,903	0.33
EMD Finance LLC, 144A 3.25% 19/03/2025	USD	350,000	360,376	0.19
Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A 4% 12/11/2021	USD	440,000	455,095	0.23
Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A 4.25% 13/11/2023	USD	410,000	436,879	0.22
			2,408,212	1.23
<i>Italy</i>				
UniCredit SpA, FRN, 144A 5.861% 19/06/2032	USD	500,000	522,443	0.27
			522,443	0.27
<i>Japan</i>				
American Honda Finance Corp. 2.65% 12/02/2021	USD	750,000	756,915	0.39
Toyota Motor Credit Corp. 2.7% 11/01/2023	USD	330,000	336,755	0.17
Toyota Motor Credit Corp. 2.9% 17/04/2024	USD	76,000	78,790	0.04
			1,172,460	0.60
<i>Malaysia</i>				
Malaysia Government Bond 3.885% 15/08/2029	MYR	6,000,000	1,535,151	0.79

Capital Group Global Intermediate Bond Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Malaysia Government Bond 3.955% 15/09/2025	MYR	9,450,000	2,393,627	1.22
			3,928,778	2.01
<i>South Korea</i>				
Hyundai Capital America, 144A 3.25% 20/09/2022	USD	233,000	237,453	0.12
Hyundai Capital America, Reg. S 2.55% 03/04/2020	USD	40,000	40,018	0.02
Hyundai Capital America, Reg. S 2.75% 18/09/2020	USD	68,000	68,243	0.04
Hyundai Capital America, Reg. S 3.25% 20/09/2022	USD	50,000	50,956	0.03
Hyundai Capital Services, Inc., 144A 3.75% 05/03/2023	USD	250,000	257,912	0.13
			654,582	0.34
<i>Sweden</i>				
Skandinaviska Enskilda Banken AB 2.8% 11/03/2022	USD	250,000	253,807	0.13
Swedbank AB, Reg. S 2.8% 14/03/2022	USD	200,000	202,513	0.10
			456,320	0.23
<i>United States of America</i>				
AbbVie, Inc., 144A 2.6% 21/11/2024	USD	500,000	503,427	0.26
AbbVie, Inc., 144A 2.95% 21/11/2026	USD	361,000	366,954	0.19
AbbVie, Inc., 144A 3.2% 21/11/2029	USD	475,000	483,519	0.25
Amazon.com, Inc. 2.8% 22/08/2024	USD	280,000	289,843	0.15
Arroyo Mortgage Trust, FRN, Series 2018-1 'A1', 144A 3.763% 25/04/2048	USD	496,406	501,781	0.26
Bank of America Corp., FRN 3.55% 05/03/2024	USD	502,000	521,239	0.27
BMW US Capital LLC, Reg. S 2.15% 06/04/2020	USD	200,000	200,148	0.10
Cascade Funding Mortgage Trust, FRN, Series 2018- RM2 'A', 144A 4% 25/10/2068	USD	122,717	125,992	0.06
Charter Communications Operating LLC 4.5% 01/02/2024	USD	400,000	430,424	0.22
Comcast Corp. 3.7% 15/04/2024	USD	510,000	543,703	0.28
Comcast Corp. 3.95% 15/10/2025	USD	165,000	180,077	0.09
CPS Auto Receivables Trust, Series 2018-D 'A', 144A 3.06% 17/01/2022	USD	32,488	32,543	0.02
CPS Auto Receivables Trust, Series 2018-D 'B', 144A 3.61% 15/11/2022	USD	275,000	277,343	0.14
CPS Auto Receivables Trust, Series 2017-D 'C', 144A 3.01% 17/10/2022	USD	150,000	150,417	0.08
CVS Health Corp. 3.35% 09/03/2021	USD	229,000	232,809	0.12
Drive Auto Receivables Trust, Series 2017-2 'C' 2.75% 15/09/2023	USD	5,686	5,686	-
DT Auto Owner Trust, Series 2018-3A 'A', 144A 3.02% 15/02/2022	USD	72,923	73,163	0.04
Exelon Corp. 2.45% 15/04/2021	USD	100,000	100,453	0.05
Exelon Corp. 3.497% 01/06/2022	USD	50,000	51,344	0.03
Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2018-4A 'A', 144A 3.05% 15/12/2021	USD	34,358	34,376	0.02
FHLMC, Series K733 'A2' 3.75% 25/08/2025	USD	1,250,000	1,341,925	0.69
FHLMC G08842 4% 01/10/2048	USD	2,511,672	2,616,982	1.34
FHLMC Q44363 4.5% 01/11/2046	USD	523,488	556,470	0.28
Finance of America Structured Securities Trust, FRN, Series 2018-HB1 'A', 144A 3.375% 25/09/2028	USD	167,925	168,118	0.09
Fiserv, Inc. 3.2% 01/07/2026	USD	500,000	517,922	0.26
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2018-1 'A', 144A 3.19% 15/07/2031	USD	445,000	462,867	0.24

Capital Group Global Intermediate Bond Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Ford Credit Auto Owner Trust, Series 2018-2 'A', 144A 3.47% 15/01/2030	USD	460,000	480,615	0.25
Galton Funding Mortgage Trust, FRN, Series 2018-2 'A42', 144A 4% 25/10/2058	USD	138,318	139,683	0.07
Goldman Sachs Group, Inc. (The), FRN 2.905% 24/07/2023	USD	250,000	254,534	0.13
Homeward Opportunities Fund I Trust, FRN, Series 2018-1 'A1', 144A 3.766% 25/06/2048	USD	61,877	62,634	0.03
Keurig Dr Pepper, Inc. 4.417% 25/05/2025	USD	329,000	359,396	0.18
Morgan Stanley, FRN 2.72% 22/07/2025	USD	250,000	253,189	0.13
Nationstar HECM Loan Trust, FRN, Series 2018-3A 'A', 144A 3.555% 25/11/2028	USD	82,156	82,932	0.04
Nestle Holdings, Inc., 144A 3.35% 24/09/2023	USD	500,000	522,993	0.27
New York Life Global Funding, 144A 2% 13/04/2021	USD	410,000	411,250	0.21
New York Life Global Funding, Reg. S 2% 13/04/2021	USD	100,000	100,305	0.05
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2.403% 01/09/2021	USD	500,000	503,678	0.26
Oncor Electric Delivery Co. LLC 2.75% 01/06/2024	USD	250,000	253,065	0.13
PNC Financial Services Group, Inc. (The), STEP 2.854% 09/11/2022	USD	100,000	102,392	0.05
Public Service Co. of Colorado 2.25% 15/09/2022	USD	100,000	100,777	0.05
RMF Buyout Issuance Trust, FRN, Series 2018-1 'A', 144A 3.436% 25/11/2028	USD	38,388	38,450	0.02
Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2016- 3 'C' 2.46% 15/03/2022	USD	41,300	41,338	0.02
Santander Drive Auto Receivables Trust, Series 2017- 1 'C' 2.58% 16/05/2022	USD	34,044	34,069	0.02
Sequoia Mortgage Trust, FRN, Series 2018-CH1 'A1', 144A 4% 25/02/2048	USD	256,737	261,387	0.13
Starwood Mortgage Residential Trust, FRN, Series 2018-IMC1 'A1', 144A 3.793% 25/03/2048	USD	61,221	61,798	0.03
UMBS B02188 4% 01/09/2049	USD	2,366,951	2,467,940	1.26
UMBS CA4534 3% 01/11/2049	USD	1,989,567	2,041,320	1.04
UMBS MA3495 4% 01/10/2048	USD	2,286,535	2,381,745	1.22
UMBS MA3496 4.5% 01/10/2048	USD	146,266	154,490	0.08
UMBS MA3631 3% 01/04/2034	USD	197,743	202,617	0.10
UMBS MA3639 4.5% 01/04/2049	USD	227,834	239,628	0.12
UMBS MA3681 3% 01/06/2034	USD	239,777	245,724	0.13
UMBS MA3692 3.5% 01/07/2049	USD	4,161,447	4,276,610	2.19
UMBS MA3776 4% 01/09/2049	USD	1,066,945	1,113,610	0.57
UMBS MA3905 3% 01/01/2050	USD	3,500,000	3,548,913	1.81
UMBS QN0549 3% 01/08/2034	USD	362,894	372,169	0.19
UMBS SB8021 3% 01/12/2034	USD	475,487	487,628	0.25
UMBS SB8027 3% 01/01/2035	USD	158,671	162,935	0.08
UMBS ZT1344 3% 01/11/2033	USD	359,701	369,049	0.19
UMBS ZT2091 3% 01/06/2034	USD	159,867	163,887	0.08
Union Pacific Corp. 3.2% 08/06/2021	USD	620,000	631,897	0.32
Wells Fargo & Co., FRN 2.406% 30/10/2025	USD	250,000	250,170	0.13
World Financial Network Credit Card Master Trust, Series 2018-B 'A' 3.46% 15/07/2025	USD	470,000	480,802	0.25
			34,425,144	17.61
Total Bonds			44,583,598	22.81

Capital Group Global Intermediate Bond Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2019

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Total Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market			44,583,598	22.81
Recently issued securities				
Bonds				
<i>Germany</i>				
Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A 2.85% 26/09/2024	USD	281,000	285,511	0.14
			285,511	0.14
<i>Italy</i>				
Intesa Sanpaolo SpA, 144A 3.25% 23/09/2024	USD	500,000	502,768	0.26
			502,768	0.26
<i>United States of America</i>				
Bristol-Myers Squibb Co., 144A 3.2% 15/06/2026	USD	368,000	386,206	0.20
Metropolitan Life Global Funding I, 144A 2.4% 17/06/2022	USD	235,000	237,439	0.12
			623,645	0.32
Total Bonds			1,411,924	0.72
Total Recently issued securities			1,411,924	0.72
Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings				
Collective Investment Schemes - UCITS				
<i>Luxembourg</i>				
JPMorgan USD Treasury CNAV Fund - JPM USD Treasury CNAV Institutional (dist.)	USD	6,908,873	6,908,873	3.53
			6,908,873	3.53
Total Collective Investment Schemes - UCITS			6,908,873	3.53
Total Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings			6,908,873	3.53
Total Investments			186,909,895	95.61
Cash			6,370,695	3.26
Other assets/(liabilities)			2,219,489	1.13
Total net assets			195,500,079	100.00

Capital Group Global Intermediate Bond Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2019

To Be Announced Contracts						
Country	Security Description	Currency	Nominal Value	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
United States of America	UMBS, 3.00%, 25/02/2034	USD	2,955,519	3,026,429	3,487	1.55
United States of America	UMBS, 4.50%, 25/01/2050	USD	3,016,587	3,175,975	5,260	1.62
Total To Be Announced Contracts Long Positions				6,202,404	8,747	3.17
Net To Be Announced Contracts				6,202,404	8,747	3.17

Interest Rate Swap Contracts								
Nominal Amount	Currency	Counterparty	Security Description	Maturity Date	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets	
2,000,000	USD	Goldman Sachs	Pay fixed 2.872% Receive floating LIBOR 3 month	20/04/2028	(160,233)	(160,233)	(0.08)	
7,600,000	GBP	Goldman Sachs	Pay floating LIBOR 6 month Receive fixed 0.583%	29/08/2024	(132,228)	(132,228)	(0.07)	
850,000	USD	Goldman Sachs	Pay fixed 2.376% Receive floating LIBOR 3 month	28/03/2029	(36,711)	(36,711)	(0.02)	
11,820,000	EUR	Goldman Sachs	Pay floating EURIBOR 6 month Receive fixed (0.067)%	19/07/2024	(20,533)	(20,533)	(0.01)	
700,000	GBP	Goldman Sachs	Pay fixed 1.118% Receive floating LIBOR 6 month	30/07/2049	(1,734)	(1,734)	-	
Total Unrealised Loss on Interest Rate Swap Contracts					(351,439)	(351,439)	(0.18)	
Net Unrealised Loss on Interest Rate Swap Contracts					(351,439)	(351,439)	(0.18)	

Financial Futures Contracts					
Security Description	Number of Contracts	Currency	Global Exposure USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
US 10 Year Ultra Bond, 20/03/2020	(28)	USD	(3,939,687)	47,189	0.02
US Ultra Bond, 20/03/2020	(26)	USD	(4,723,063)	146,852	0.08
Total Unrealised Gain on Financial Futures Contracts				194,041	0.10
US 5 Year Note, 31/03/2020	271	USD	32,143,141	(115,706)	(0.06)
Total Unrealised Loss on Financial Futures Contracts				(115,706)	(0.06)
Net Unrealised Gain on Financial Futures Contracts				78,335	0.04

Capital Group Global Intermediate Bond Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2019

Forward Currency Exchange Contracts							
Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
NOK	27,800,000	EUR	2,747,967	08/01/2020	UBS	83,274	0.04
USD	1,843,345	JPY	200,000,000	09/01/2020	UBS	2,002	-
USD	9,193,512	JPY	995,000,000	15/01/2020	Goldman Sachs	29,731	0.02
Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts						115,007	0.06
GBP Hedged Share Class							
GBP	400,000	USD	524,080	17/01/2020	J.P. Morgan	5,978	-
JPY Hedged Share Class							
JPY	12,301,779,066	USD	112,552,078	17/01/2020	J.P. Morgan	757,837	0.39
Unrealised Gain on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts						763,815	0.39
Total Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts						878,822	0.45
USD	1,119,852	AUD	1,650,000	07/01/2020	UBS	(38,154)	(0.02)
USD	790,124	CAD	1,050,000	07/01/2020	HSBC	(18,493)	(0.01)
USD	1,153,935	PLN	4,500,000	07/01/2020	Citibank	(32,181)	(0.02)
USD	1,616,812	AUD	2,360,000	08/01/2020	HSBC	(39,528)	(0.02)
USD	3,011,451	CNH	21,250,000	08/01/2020	HSBC	(40,980)	(0.02)
USD	333,570	EUR	300,000	09/01/2020	Morgan Stanley	(3,066)	-
USD	7,984,782	GBP	6,070,000	09/01/2020	Bank of America	(56,945)	(0.03)
USD	1,476,603	EUR	1,330,000	13/01/2020	HSBC	(16,199)	(0.01)
USD	1,863,923	SEK	17,700,000	13/01/2020	UBS	(26,807)	(0.01)
USD	1,853,474	EUR	1,660,000	15/01/2020	BNY Mellon	(9,964)	(0.01)
USD	2,842,712	EUR	2,550,000	16/01/2020	BNY Mellon	(19,984)	(0.01)
USD	1,458,593	MXN	27,950,000	16/01/2020	Citibank	(16,807)	(0.01)
USD	5,375,289	AUD	7,801,000	17/01/2020	Citibank	(101,035)	(0.05)
USD	5,774,919	CAD	7,605,000	17/01/2020	HSBC	(82,106)	(0.04)
USD	4,614,022	CNH	32,300,000	17/01/2020	Standard Chartered	(24,825)	(0.01)
USD	890,905	DKK	5,950,000	17/01/2020	Standard Chartered	(3,116)	-
USD	25,686,673	EUR	22,950,000	17/01/2020	Morgan Stanley	(79,252)	(0.04)
USD	1,926,853	MXN	36,800,000	17/01/2020	Standard Chartered	(15,392)	(0.01)
USD	1,740,920	CNH	12,200,000	23/01/2020	UBS	(10,959)	(0.01)
USD	2,302,764	EUR	2,065,000	24/01/2020	Bank of America	(16,657)	(0.01)
Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts						(652,450)	(0.34)
GBP Hedged Share Class							
GBP	5,298,762	USD	7,079,994	17/01/2020	J.P. Morgan	(58,356)	(0.03)
JPY Hedged Share Class							
USD	561,786	JPY	61,400,000	17/01/2020	J.P. Morgan	(3,761)	-
Unrealised Loss on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts						(62,117)	(0.03)
Total Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts						(714,567)	(0.37)
Net Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts						164,255	0.08

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

キャピタル・グループ・グローバル・インターメディエイト・ボンド・ファンド（LUX）
損益および純資産変動計算書
2019年12月31日現在

(USD)

収益

債券および転換社債に係る利息（源泉徴収税額控除後）

4,075,397

受取配当金（源泉徴収税額控除後）	
銀行預金利息	102,648
スワップ取引	4,295
収益小計	4,182,340
費用	
運用報酬	22,269
管理手数料	168,442
専門家サービス	83,550
年次税	17,505
デジタリー・カストディ費用およびファンド管理手数料	36,377
印刷費用	20,447
その他費用	12,379
当座貸越利息*	
スワップ取引	19,037
費用小計	380,006
費用の払戻し	164,841
投資純利益 / (損失) (a)	3,967,175
実現純利益 / (損失)	
投資有価証券の売却取引	405,019
金融先物取引	210,188
スワップ取引	(231,859)
為替取引	1,968,331
当期実現純利益 / (損失) (b)	2,351,679
未実現評価利益 / (損失)の増減	
投資有価証券	4,532,989
スワップ取引	(383,540)
金融先物取引	(149,045)
為替取引	(2,563,455)
当期末実現評価利益 / (損失)の増減 (c)	1,436,949
当期損益 (a+b+c)	7,755,803
配当金の分配	
当期投資証券の差引増減額	14,993,830
期首純資産総額	172,750,446
期末純資産総額	195,500,079

*主に中央銀行が実施するマイナス金利政策によるものです。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

「キャピタル・グローバル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が、これらは監査意見の対象外であります。

なお、同ファンド(「日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)」)は、三菱UFJ国際投信株式会社の委嘱に基づき、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に準じて、設定日(2007年9月26日)より各計算期間の財務諸表について、監査を受けております。なお、直近の計算期間は2019年7月23日から2020年1月22日までとなっております。ただし、同マザーファンド(「日本短期債券マザーファンド」)は当該監査の対象ではありません。

「日本短期債券マザーファンド」の組入有価証券の状況

(有価証券明細表)

(2020年1月22日現在)

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額	
						単価 (円)	評価金額(円)
日本	第29回フランス相互信用 連合銀行(BFCM)円 貨社債(2019)	0.25	2024/10/10	社債券	100,000	99.829	99,829,000
日本	第2回マラヤン・バンキ ング・ベルハッド円貨社 債(2015)	0.509	2020/4/30	社債券	100,000	100.08	100,080,000
日本	第1回バンコ・サンタン デール・エセ・アー 円 貨社債(2019)	0.463	2024/12/5	社債券	100,000	99.766	99,766,000
日本	第17回シティグループ・ インク 円貨社債 (2005)	2.04	2020/9/16	社債券	100,000	101.21	101,210,000
日本	第19回ルノー円貨社債 (2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	99.859	99,859,000
日本	第8回ケーティー円貨社 債(2018)	0.3	2020/11/13	社債券	100,000	99.957	99,957,000
日本	第1回明治安田生命2019 基金特定目的会社特定社 債(一般担保付)	0.29	2024/8/2	社債券	100,000	99.857	99,857,000
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	99.941	99,941,000
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	101.45	101,450,000
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	101.348	101,348,000
日本	第19回みずほ銀行(劣後 特約付)	1.67	2022/2/24	社債券	100,000	103.207	103,207,000
日本	第22回芙蓉総合リース (社債間限定同順位特約 付)	0.04	2022/10/28	社債券	100,000	99.648	99,648,000
日本	第5回イオンフィナン シャルサービス(社債間 限定同順位特約付)	0.23	2022/5/27	社債券	100,000	99.949	99,949,000
日本	第75回アコム(特定社債 間限定同順位特約付)	0.309	2023/2/28	社債券	100,000	100.049	100,049,000
日本	第74回三菱UFJリース (社債間限定同順位特約 付)	0.09	2023/1/23	社債券	100,000	99.931	99,931,000

日本	第2回野村ホールディングス(担保提供制限等財務上特約無)	0.29	2024/9/3	社債券	100,000	99.628	99,628,000
日本	第29回相鉄ホールディングス(相模鉄道株式会社保証付)	0.91	2020/6/25	社債券	100,000	100.333	100,333,000
合 計					1,700,000		1,706,042,000

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)

2020年6月30日現在

資産総額	12,538,109,276円
負債総額	30,809,498円
純資産総額(-)	12,507,299,778円
発行済口数	12,176,154,489口
1口当たり純資産額(/)	1.0272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)

2020年6月30日現在

資産総額	12,484,012,068円
負債総額	12,000,000円
純資産総額(-)	12,472,012,068円
発行済口数	11,972,642,173口
1口当たり純資産額(/)	1.0417円

(参考)日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

2020年1月22日現在

資産総額	158,005,759円
負債総額	114,917円
純資産総額(-)	157,890,842円
発行済口数	149,752,007口

1口当たり純資産額(/)	1.0543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（2019年12月30日現在）
 (2) 会社の機構（2019年12月30日現在）
- （中略）
 （以下略）

<訂正後>

- (1) 資本金の額（2020年6月30日現在）
 (2) 会社の機構（2020年6月30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・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12月30日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	29	370,565
合計	29	370,565

<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2020年6月30日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	29	339,825
合計	29	339,825

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、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。

なお、当事業年度（自2018年7月1日 至2019年6月30日）の財務諸表に含まれる比較情報のうち、改正府令による改正後の財務諸表等規則第8条の12第2項第2号及び同条第3項に係るものについては、改正府令附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

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2018年7月1日 至2019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2018年7月1日 至2019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2019年7月1日 至2019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

(2019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			3,468,910
2.前払費用			44,353
3.未収入金			534,682
4.未収委託者報酬			1,080,582
5.未収運用受託報酬			571,016
6.立替金			3,448
流動資産計			5,702,994
固定資産			
1.有形固定資産			106,585
建物	*1	4,674	
器具備品	*1	101,911	
2.無形固定資産			902
ソフトウェア		902	
3.投資その他の資産			519,920
(1)投資有価証券		100	
(2)保険積立金		12,187	
(3)長期差入保証金		274,500	
(4)繰延税金資産		233,133	
固定資産計			627,409
資産合計			6,330,403
(負債の部)			
流動負債			
1.預り金			17,551
2.未払金			1,057,456
(1)未払手数料		647,989	
(2)その他未払金		409,467	
3.未払費用			101,553
4.未払法人税等			74,115
5.未払消費税等	*2		27,708
6.賞与引当金			308,878
7.役員賞与引当金			10,304
流動負債計			1,597,568
固定負債			
1.退職給付引当金			1,427,737
2.資産除去債務			252,461
固定負債計			1,680,199
負債合計			3,277,767
(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			2,019,899
その他利益剰余金		2,019,899	
繰越利益剰余金		2,019,899	
株主資本計			3,052,636
純資産合計			3,052,636
負債・純資産合計			6,330,403

(2) 中間損益計算書

当中間会計期間

(自 2019年 7月 1日 至 2019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			1,832,430
2. 運用受託報酬			678,412
3. その他営業収益	*2		2,549,673
営業収益計			5,060,516
. 営業費用			
1. 支払手数料	*2		3,194,260
2. 広告宣伝費			55,090
3. 調査費			133,731
4. 営業雑経費			22,923
(1) 通信費		8,731	
(2) 印刷費		6,283	
(3) 協会費		7,908	
営業費用計			3,406,005
. 一般管理費			
1. 給料			853,706
(1) 役員報酬		67,568	
(2) 給料・手当		493,522	
(3) 賞与		99,036	
(4) 賞与引当金繰入額		183,274	
(5) 役員賞与引当金繰入額		10,304	
2. 交際費			11,849
3. 寄付金			1,795
4. 旅費交通費			64,691
5. 租税公課			19,191
6. 不動産賃借料			178,414
7. 退職給付費用			83,412
8. 固定資産減価償却費	*1		11,691
9. 器具備品賃借料			2,051
10. 消耗品費			9,779
11. 事務委託費			22,871
12. 採用費			20,390
13. 福利厚生費			104,817
14. 共通発生経費負担額	*3		53,174
15. 諸経費			3,654
一般管理費計			1,441,494
営業利益			213,016
. 営業外収益			
1. 受取利息及び配当金			4,399
営業外収益計			4,399
. 営業外費用			
1. 為替差損			1,387
2. 固定資産除却損			433
営業外費用計			1,821
経常利益			215,594

税引前中間純利益			215,594
法人税、住民税及び事業税			56,924
法人税等調整額			30,454
中間純利益			189,124

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自2019年7月1日 至2019年12月31日)

(単位:千円)

	株主資本					株主資本 合計	純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	450,000	582,736	582,736	1,830,775	1,830,775	2,863,511	2,863,511
当中間期変動額							
中間純利益				189,124	189,124	189,124	189,124
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計	-	-	-	189,124	189,124	189,124	189,124
当中間期末残高	450,000	582,736	582,736	2,019,899	2,019,899	3,052,636	3,052,636

[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、建物15年、器具備品3~15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。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間 (2019年12月31日現在)	
*1.有形固定資産の減価償却累計額	60,860千円
*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2019年7月1日 至2019年12月31日)	
--------------------------------------	--

*1. 減価償却実施額

有形固定資産	11,235千円
無形固定資産	456千円

*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・マネジメント・カンパニー（以下「CRM社」という。）との役務提供契約に基づき、当社の最終の親会社であるキャピタル・グループ・カンパニーズ・インクの各グループ会社（以下「各グループ会社」という。）との間で各種投資運用サービスを相互に提供しております。

当社の主要な事業は、当社が各グループ会社に対して提供している各種投資運用サービス（市場調査業務、投資運用関連業務、マーケティング業務、顧客リレーションサポート業務など）であり、当該サービスに係る対価は、営業費用及び一般管理費の合計額から一定の支払手数料を差引いた金額を基準に一定の利益率を加味して算定し、その他営業収益に計上しております。

当社が各グループ会社から提供を受けている各種投資運用サービスは、市場調査業務、投資運用関連業務、ITサービスなどであり、当該サービスに係る対価は、当社の委託者報酬及び運用受託報酬を基準に算定し、支払手数料に含めて計上しております。

*3. 共通発生経費負担額は、各グループ会社の利益規模に応じて負担しております。

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間

(自2019年7月1日 至2019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2019年7月1日 至2019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	934,378	千円
合計	1,264,158	千円

[金融商品関係]

当中間会計期間

(自2019年7月1日 至2019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	274,500	276,465	1,965

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、2019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
(2019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)	100	100	-

[デリバティブ取引関係]

当中間会計期間
(自2019年7月1日 至2019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
(2019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 250,662千円

時の経過による調整額 1,799千円

当中間会計期間末残高 252,461千円

[セグメント情報等]

当中間会計期間
(自2019年7月1日 至2019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
2,449,777千円	2,549,673千円	61,065千円	5,060,516千円

(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	2,549,673千円

[1株当たり情報]

当中間会計期間
(自2019年7月1日 至2019年12月31日)

1株当たり純資産額	54,124.75円
1株当たり中間純利益金額	3,353.26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おりません。

(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	189,124千円
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	189,124千円
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(2019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(2019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(2019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(2020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(2020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(2020年3月31日現在)

(以下略)

独立監査人の中間監査報告書

2020年7月14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2019年11月21日から2020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2020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（2019年11月21日から2020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

2020年3月23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 水野 龍也 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、「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2019年7月1日から2020年6月30日までの第36期事業年度の中間会計期間（2019年7月1日から2019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2019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（2019年7月1日から2019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。