

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年8月17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・ニューワールド・ファンドF（米ドル売り円買い）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	(1)当初自己設定日(平成29年10月17日) 10万円を上限とします。 (2)継続申込期間(平成29年10月17日から平成31年2月14日まで) 3,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、平成29年9月29日付をもって提出した有価証券届出書（平成30年2月16日付けをもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、「第二部ファンド情報」及び「第三部委託会社等の情報」における訂正事項を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (3)【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

(前略)

ファミリーファンド方式

(中略)

- ・委託会社は、マザーファンドに投資を行なう当ファンド以外のベビーファンドの設定・運用を行なうことがあります。2018年2月16日現在、その他のベビーファンドは次のとおりです。  
キャピタル・ニューワールド・ファンドAコース（米ドル売り円買い） 2017年6月27日設定

委託会社の概況（2017年12月29日現在）

(以下略)

< 訂正後 >

(前略)

ファミリーファンド方式

(中略)

- ・委託会社は、マザーファンドに投資を行なう当ファンド以外のベビーファンドの設定・運用を行なうことがあります。2018年8月17日現在、その他のベビーファンドは次のとおりです。  
キャピタル・ニューワールド・ファンドAコース（米ドル売り円買い） 2017年6月27日設定

委託会社の概況（2018年6月29日現在）

(以下略)

#### 2【投資方針】

##### (2)【投資対象】

< 訂正前 >

(前略)

< 参考情報 2 > 投資対象ファンドの概要等

(中略)

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

(中略)

上記は、2017年12月29日現在のものであり、今後、委託会社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、2018年6月29日現在のものであり、今後、投資顧問会社等の判断その他理由により変更される場合があります。

（中略）

上記は、2018年6月29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）

（参考情報）

キャピタル・インターナショナル株式会社の運用部門等の人員体制（2017年12月29日現在）

運用部（3名）/法務コンプライアンス部（2名）/オペレーション部（8名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

< 参考情報 >

投資対象ファンドにおける運用体制は、次のとおりです。

（中略）

2. 「日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」

運用は、三菱UFJ国際投信株式会社が行ないます。同社の運用体制は、次のとおりです。

投資環境会議において国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づく投資環境の見通しを策定し、運用戦略委員会にて運用戦略を決定します。各運用部は運用戦略に基づいて運用計画を決定し、担当ファンドマネジャーは運用部門から独立したトレーディング部に売買実行の指図を行ない、トレーディング部は事前チェックを行なったうえで最良執行を目指して売買を行ないます。運用部門は投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているか自律的なチェックを行ない、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また運用部門から独立した管理担当部署による各種モニタリング結果が運用管理委員会等を通じてフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

（中略）

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

< 訂正後 >

（前略）

（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6月29日現在）

運用部（3名）/法務コンプライアンス部（2名）/オペレーション部（8名）

（ ）は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

（中略）

< 参考情報 >

投資対象ファンドにおける運用体制は、次のとおりです。

（中略）

2. 「日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」

運用は、三菱UFJ国際投信株式会社が行ないます。同社の運用体制は、次のとおりです。

投資環境会議において国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づく投資環境の見通しを策定し、運用戦略委員会にて運用戦略を決定します。各運用部は運用戦略に基づいて運用計画を決定し、担当ファンドマネジャーは運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指図を行ない、トレーディング部は事前チェックを行なったうえで最良執行を目指して売買を行ないます。運用部門は投資行動がファンドコン

セプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているか自律的なチェックを行ない、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また運用部から独立した管理担当部署による各種モニタリング結果が運用管理委員会等を通じてフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

(中略)

上記は2018年6月29日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

### 3【投資リスク】

<訂正前>

(前略)

<参考情報> 投資対象ファンドにおけるリスク管理体制

1. キャピタル・グループのリスク管理体制

(中略)

2. 三菱UFJ国際投信株式会社の投資リスクに対する管理体制

三菱UFJ国際投信株式会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行なうとともに運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行なっています。

(中略)

<流動性リスクに対する管理体制>

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

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

<訂正後>

(前略)

<参考情報> 投資対象ファンドにおけるリスク管理体制

1. キャピタル・グループのリスク管理体制

(中略)

2. 三菱UFJ国際投信株式会社の投資リスクに対する管理体制

三菱UFJ国際投信株式会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行なうとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行なっています。

(中略)

<流動性リスクに対する管理体制>

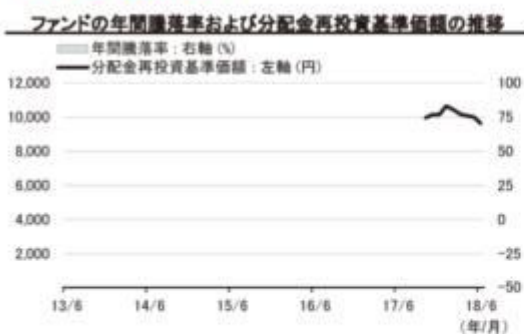
流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立したリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行ない、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

上記は2018年6月29日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

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

<更新・訂正後>

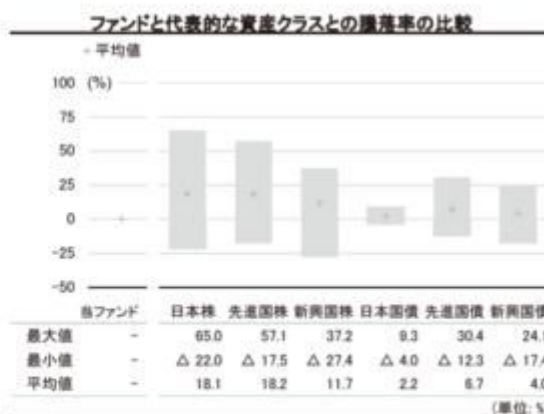
## リスクの定量的比較



(注1) ファンドの年間騰落率は、運用開始後1年を経過していないため、表示できません。

(注2) 分配金再投資基準価額は、設定日(2017年10月17日)を10,000として指数化しています。

(注3) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。



(注1) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 代表的な資産クラスの騰落率は、2013年7月から2018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、運用開始後1年を経過していないため、表示できません。

### <各資産クラスの指数>

日本株・・・TOPIX(配当込み)

先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)

新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)

日本国債・・・NOMURA-BPI国債

先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本/円ベース)

新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(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】

### (5) 【課税上の取扱い】

#### <訂正前>

課税上は、株式投資信託として取扱われ、個人受益者、法人受益者毎に以下の取扱いとなります。以下の取扱内容は、2017年12月29日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご留意ください。

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、2018年6月29日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご注意ください。

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

（以下略）

## 5【運用状況】

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

< 更新・訂正後 >

### （1）【投資状況】

キャピタル・ニューワールド・ファンドF（米ドル売り円買い）

平成30年 6月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	896,083,785	100.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		796,994	0.08
合計(純資産総額)		895,286,791	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・ニューワールド・マザーファンド（米ドル売り円買い）

平成30年 6月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	2,285,033	0.01
投資証券	ルクセンブルク	15,650,266,966	99.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,000,000	0.06
合計(純資産総額)		15,662,551,999	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・ニューワールド・ファンド（LUX）

平成30年6月29日現在

資産の種類	国/地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
	中国	23,196,665,078	15.83
	米国	22,729,004,623	15.51
	インド	12,275,936,378	8.38
	ブラジル	8,870,590,996	6.05

株式

英国	8,062,691,610	5.50
日本	6,825,368,198	4.66
フランス	6,763,554,371	4.62
香港	5,903,184,221	4.03
韓国	3,822,664,071	2.61
台湾	2,798,705,452	1.91
カナダ	2,516,356,250	1.72
南アフリカ	2,395,219,144	1.63
ドイツ	2,356,788,970	1.61
フィリピン	2,284,233,013	1.56
スイス	1,991,789,630	1.36
ロシア	1,831,326,645	1.25
スペイン	1,708,076,899	1.17
メキシコ	1,634,032,051	1.11
オーストラリア	1,208,643,500	0.82
アルゼンチン	1,139,793,538	0.78
デンマーク	1,101,092,611	0.75
オランダ	895,597,636	0.61
インドネシア	678,344,343	0.46
イタリア	646,358,575	0.44
タイ	622,348,887	0.42
ギリシャ	592,071,218	0.40
ベトナム	540,867,051	0.37
トルコ	465,688,279	0.32
イスラエル	345,349,164	0.24
スウェーデン	314,097,214	0.21
ペルー	303,361,724	0.21
マレーシア	252,410,194	0.17
ノルウェー	174,904,366	0.12
アラブ首長国連邦	164,343,178	0.11
ニュージーランド	164,151,302	0.11
カタール	155,528,332	0.11
ハンガリー	149,795,383	0.10
アイルランド	139,255,523	0.10
コロンビア	124,274,513	0.08
ポーランド	28,760,650	0.02
ブラジル	853,463,081	0.58
メキシコ	617,061,289	0.42
インドネシア	415,201,398	0.28
アルゼンチン	412,229,764	0.28
ドミニカ共和国	351,684,544	0.24
インド	342,667,324	0.23
トルコ	311,167,542	0.21
ロシア	291,569,164	0.20
パキスタン	282,955,629	0.19
エジプト	277,979,757	0.19
南アフリカ	221,460,755	0.15
ナイジェリア	199,794,591	0.14
カザフスタン	177,375,460	0.12
中国	155,516,590	0.11
サウジアラビア	147,963,983	0.10
スリランカ	140,663,406	0.10
パナマ	139,024,343	0.09
モロッコ	137,449,524	0.09
パラグアイ	123,265,617	0.08
ケニア	118,643,526	0.08
コートジボワール	115,786,424	0.08
ホンジュラス	86,383,125	0.06
ペルー	83,493,752	0.06
コロンビア	83,290,720	0.06
イラク	79,481,334	0.05
グアテマラ	77,594,597	0.05
パーレーン	68,631,335	0.05
イスラエル	63,096,824	0.04
ヨルダン	62,188,013	0.04
セネガル	61,560,819	0.04
ハンガリー	46,406,525	0.03

債券



クウェート	43,078,434	0.03
チリ	40,101,869	0.03
ギリシャ	39,940,888	0.03
フィリピン	32,873,873	0.02
ポーランド	28,764,455	0.02
クロアチア	28,515,446	0.02
銀行預金、その他資産（負債控除後）	11,618,426,604	7.93
純資産総額	146,549,977,101	100.00

（注）投資比率は、キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド（LUX）の純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（参考）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

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

平成30年1月24日現在

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
特殊債券	日本	99,978,000	4.15
社債券	日本	2,217,201,000	92.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		90,777,420	3.77
合計(純資産総額)		2,407,956,420	100.00

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

（注）当該情報は委託会社が入手可能な直近日（平成30年1月24日）現在の情報です。

## （２）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

キャピタル・ニューワールド・ファンドF（米ドル売り円買い）

a. 上位30銘柄

平成30年 6月29日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	キャピタル・ニューワールド・マ ザーファンド（米ドル売り円買 い）	844,247,019	1.1081	935,562,886	1.0614	896,083,785	100.08

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

b. 種類別投資比率

平成30年 6月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.08
合計	100.08

## （参考）キャピタル・ニューワールド・マザーファンド（米ドル売り円買い）

## a. 上位30銘柄

平成30年 6月29日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ルクセンブルク	投資証券	キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド（LUX） （クラスCh-JPY）	11,767,118.02	1,345.46	15,832,186,611	1,330	15,650,266,966	99.92
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）	2,166,730	1.054	2,283,733	1.0546	2,285,033	0.01

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

## b. 種類別投資比率

平成30年 6月29日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	0.01
投資証券	99.92
合計	99.93

## （参考）キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド（LUX）

## 上位30銘柄

平成30年6月29日現在

順位	銘柄	国/地域（上段） 業種（下段）	株数	評価単価（現地通貨）（上段） 通貨（下段）	評価金額（円）	投資 比率 (%)
1	AIA GROUP LTD	香港 金融	2,551,804	68.10 香港ドル	2,446,876,831	1.66
2	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド エネルギー	1,605,864	944.95 インド・ルピー	2,439,948,868	1.66
3	TENCENT HOLDINGS LTD	中国 情報技術	401,015	379.00 香港ドル	2,140,018,417	1.45
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD COM	韓国 情報技術	460,899	46,800.00 韓国ウォン	2,120,548,696	1.44
5	HDFC BANK LTD	インド 金融	594,495	2,133.542 インド・ルピー	2,039,447,530	1.39
6	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO	台湾 情報技術	2,600,670	212.00 台湾ドル	1,992,537,529	1.35
7	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ADR	中国 情報技術	91,155	188.38 米ドル	1,897,653,286	1.29
8	ALPHABET INC CL C	米国 情報技術	14,876	1,114.22 米ドル	1,831,718,359	1.24
9	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	インド 金融	813,554	1,339.10 インド・ルピー	1,751,711,287	1.19
10	AIRBUS SE	フランス 資本財・サービス	135,295	98.12 ユーロ	1,696,774,200	1.15
11	CHINA GAS HOLDINGS LTD	中国 公益事業	3,939,767	30.15 香港ドル	1,672,536,244	1.14
12	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	カナダ 素材	1,088,970	18.20 カナダ・ドル	1,651,131,368	1.12
13	MASTERCARD INC CL A	米国 情報技術	75,259	197.10 米ドル	1,639,255,489	1.11
14	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	中国 公益事業	1,309,000	70.45 香港ドル	1,298,489,156	0.88

15	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP H	中国 金融	12,957,000	7.08 香港ドル	1,291,681,382	0.88
16	BROADCOM INC	米国 情報技術	46,954	244.90 米ドル	1,270,758,314	0.86
17	SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD A (SSE NORTH)	中国 資本財・サービス	1,312,254	54.81 中国元	1,199,485,726	0.81
18	MICROSOFT CORP	米国 情報技術	109,009	98.63 米ドル	1,188,154,638	0.81
19	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	英国 生活必需品	196,923	38.77 英ポンド	1,103,068,024	0.75
20	CTRIIP.COM INTL ADR	中国 一般消費財・サービス	201,642	48.01 米ドル	1,069,828,791	0.73
21	FACEBOOK INC CL A	米国 情報技術	47,905	196.23 米ドル	1,038,838,000	0.71
22	FOSHAN HAITIAN F&F CO LTD A (SSE NORTH)	中国 生活必需品	837,084	71.54 中国元	998,700,698	0.68
23	PETROLEO BRASILEIRO ON ADR (PETROBRAS)	ブラジル エネルギー	913,025	9.84 米ドル	992,840,185	0.67
24	NASPERS LIMITED N	南アフリカ 一般消費財・サービス	37,591	3,271.82 南アフリカ・ラ ンド	987,322,897	0.67
25	BOOKING HOLDINGS INC	米国 一般消費財・サービス	4,151	2,019.49 米ドル	926,394,609	0.63
26	MURATA MANUFACTURING CO LTD	日本 情報技術	49,500	18,155.00 日本円	898,672,500	0.61
27	NESTLE SA	スイス 生活必需品	106,099	76.30 スイス・フラン	896,859,687	0.61
28	MICRON TECHNOLOGY INC	米国 情報技術	151,912	53.14 米ドル	892,103,433	0.61
29	CSL LTD	オーストラリア ヘルスケア	56,285	194.84 豪ドル	890,879,084	0.61
30	PAGSEGURO DIGITAL LTD CL A	ブラジル 情報技術	284,666	27.82 米ドル	875,173,791	0.59

(注) 投資比率は、キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド(LUX)の純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

(参考) 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

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

平成30年1月24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41回東日本高速 道路	0.005	2019/6/20	特殊債券	100,000	99.978	99,978,000	4.15
日本	第16回フランス相 互信用連合銀行円 貨社債(2015)	0.269	2018/10/15	社債券	100,000	100.099	100,099,000	4.16
日本	第1回バンコ・サ ンタンデール・エ セ・アー非上位円 貨社債(2017)	0.568	2023/1/11	社債券	100,000	100.063	100,063,000	4.16
日本	第9回モルガン・ スタンレー円貨社 債(2014)	0.557	2018/5/22	社債券	100,000	100.139	100,139,000	4.16

日本	第19回ルノー円貨社債(2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	100.232	100,232,000	4.16
日本	第1回ソシエテ・ジェネラル非上位円貨社債(2017)	0.448	2022/5/26	社債券	100,000	100.442	100,442,000	4.17
日本	第237回四国電力社債(一般担保付)	2.05	2018/11/22	社債券	100,000	101.654	101,654,000	4.22
日本	第316回北海道電力	1.164	2020/6/25	社債券	100,000	102.503	102,503,000	4.26
日本	第5回ヤフー(社債間限定同順位特約付)	0.2	2022/12/7	社債券	100,000	99.837	99,837,000	4.15
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	99.808	99,808,000	4.14
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	100.043	100,043,000	4.15
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	100.072	100,072,000	4.16
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	99.993	99,993,000	4.15
日本	第66回クレディセゾン(社債間限定同順位特約付)	0.09	2020/12/22	社債券	100,000	99.904	99,904,000	4.15
日本	第7回あおぞら銀行(社債間限定同順位特約付)	0.08	2019/9/9	社債券	100,000	99.941	99,941,000	4.15
日本	第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	104.01	104,010,000	4.32
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	103.917	103,917,000	4.32
日本	第8回三井住友信託銀行(社債間限定同順位特約付)	0.234	2019/7/22	社債券	100,000	100.279	100,279,000	4.16
日本	第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	104.036	104,036,000	4.32
日本	第38回日産フィナンシャルサービス(社債間限定同順位特約付)	0.001	2019/6/20	社債券	100,000	99.726	99,726,000	4.14
日本	第67回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.5	2019/6/6	社債券	100,000	100.221	100,221,000	4.16
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	99.905	99,905,000	4.15

日本	第43回野村ホールディングス	0.454	2019/2/25	社債券	100,000	100.377	100,377,000	4.17
----	----------------	-------	-----------	-----	---------	---------	-------------	------

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

(注) 当該情報は委託会社が入手可能な直近日(平成30年1月24日)現在の情報です。

#### 【投資不動産物件】

キャピタル・ニューワールド・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・ニューワールド・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・ニューワールド・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・ニューワールド・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・ニューワールド・ファンドF(米ドル売り円買い)

期	純資産総額(円)		1口当たり純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期(平成29年11月20日)	100,812	100,812	1.0081	1.0081
平成29年10月末日	99,540		0.9954	
11月末日	101,305		1.0131	
12月末日	635,235,097		1.0140	
平成30年1月末日	725,858,613		1.0644	
2月末日	846,920,741		1.0429	
3月末日	852,469,793		1.0169	
4月末日	858,274,855		1.0069	
5月末日	894,740,232		0.9997	
6月末日	895,286,791		0.9612	

(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・ニューワールド・ファンドF（米ドル売り円買い）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	平成29年10月17日～平成29年11月20日	0

## 【収益率の推移】

キャピタル・ニューワールド・ファンドF（米ドル売り円買い）

期	計算期間	収益率（％）
第1期	平成29年10月17日～平成29年11月20日	0.8
第2中間計算期間末	平成29年11月21日～平成30年 5月20日	1.0

(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・ニューワールド・ファンドF（米ドル売り円買い）

下記計算期間中の設定および解約の実績ならびに当該計算期間末の発行済口数は次のとおりです。

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	平成29年10月17日～平成29年11月20日	100,000		100,000
第2中間計算期間末	平成29年11月21日～平成30年 5月20日	888,175,447	28,661,377	859,614,070

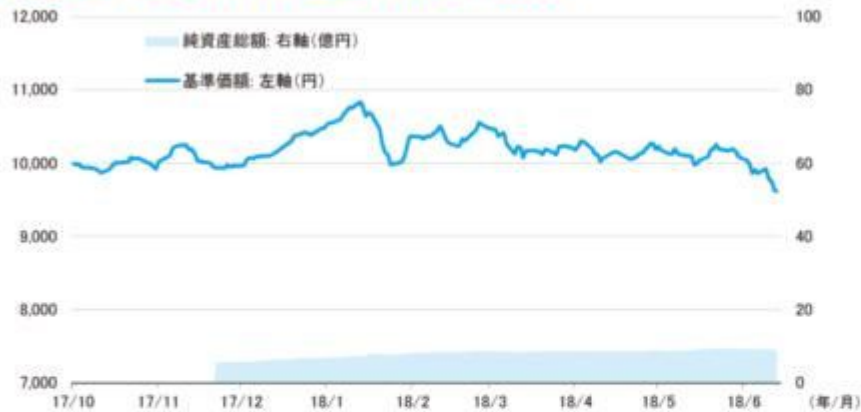
(注)第1期の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(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

2018年6月29日現在

## 基準価額・純資産の推移(設定～2018年6月29日)



## 分配金の推移

第1期	2017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(2018年6月29日現在)

&lt;キャピタル・ニューワールド・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・ニューワールド・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)	99.92
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.01

&lt;キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド(LUX)の主要な資産の状況等&gt;

(2018年6月29日現在)

上位10銘柄				
順位	銘柄名	国名/地域名	業種名	投資比率(%)
1	AIA GROUP	香港	金融	1.67
2	RELIANCE INDUSTRIES	インド	エネルギー	1.66
3	ALPHABET	米国	情報技術	1.63
4	TSMC	台湾	情報技術	1.50
5	HDFC BANK	インド	金融	1.48
6	TENCENT	中国	情報技術	1.46
7	SAMSUNG ELECTRONICS	韓国	情報技術	1.45
8	ALIBABA GROUP	中国	情報技術	1.29
9	KOTAK MAHINDRA BANK	インド	金融	1.20
10	AIRBUS SE	フランス	資本財・サービス	1.16

同一企業が発行し、複数市場において取引されている株式および株式に類する有価証券(預託証券等)の組み入れがある場合には、それらを合算して算出した投資比率を表示しております。

## 資産別構成比率

資産の種類	投資比率(%)
株式	87.46
債券	4.61
現金・その他	7.93

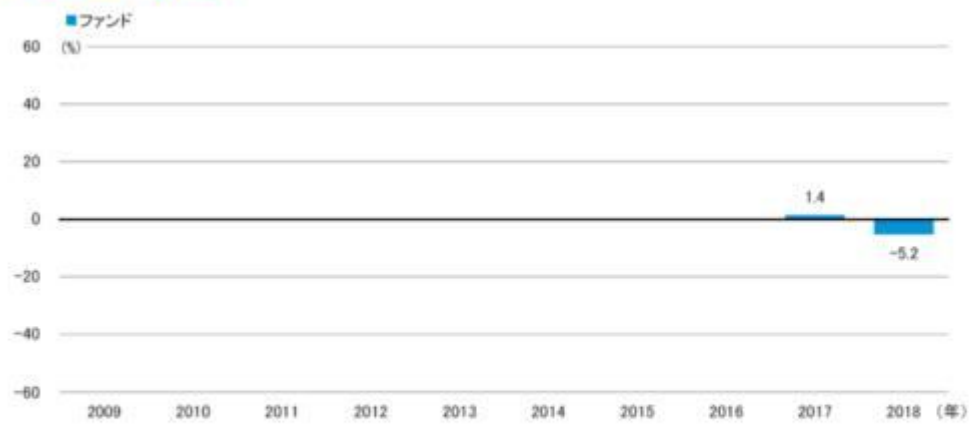
## 国別構成比率

国名	投資比率(%)
中国	15.93
米国	15.51
インド	8.61
ブラジル	6.64
英国	5.50
その他国	39.88
現金・その他	7.93

## 通貨別構成比率

通貨名	投資比率(%)
米ドル	27.94
香港ドル	12.80
ユーロ	8.93
インド・ルピー	8.09
英ポンド	5.72
その他通貨	36.51

## 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。2018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2期中間計算期間（平成29年11月21日から平成30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・ニューワールド・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1期 平成29年11月20日現在	第2期中間計算期間 平成30年5月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	1,453,062
コール・ローン	100	3,787,266
親投資信託受益証券	100,781	872,876,806
流動資産合計	100,881	878,117,134
<b>資産合計</b>		
	100,881	878,117,134
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	-	74,809
未払委託者報酬	69	2,842,622
未払利息	-	30
その他未払費用	-	173,110
流動負債合計	69	3,090,571
<b>負債合計</b>		
	69	3,090,571
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	100,000	859,614,070
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	812	15,412,493
元本等合計	100,812	875,026,563
<b>純資産合計</b>		
	100,812	875,026,563
<b>負債純資産合計</b>		
	100,881	878,117,134

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

第2期中間計算期間	
自 平成29年11月21日	
至 平成30年 5月20日	
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	11,393,494
<b>営業収益合計</b>	<b>11,393,494</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	12,272
受託者報酬	74,809
委託者報酬	2,842,622
その他費用	173,254
<b>営業費用合計</b>	<b>3,102,957</b>
営業利益又は営業損失（ ）	8,290,537
経常利益又は経常損失（ ）	8,290,537
中間純利益又は中間純損失（ ）	8,290,537
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（ ）	219,799
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	812
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,523,949
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,523,949
剰余金減少額又は欠損金増加額	183,006
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	183,006
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	15,412,493

## (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1期 平成29年11月20日現在	第2期中間計算期間 平成30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 100,000口	1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数 859,614,070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	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 1.0081円	1口当たり純資産額 1.0179円
(1万口当たり純資産額) (10,081円)	(1万口当たり純資産額) (10,179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1期 自 平成29年10月17日 至 平成29年11月20日	第2期中間計算期間 自 平成29年11月21日 至 平成30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1期	第2期中間計算期間
	自 平成29年10月17日 至 平成29年11月20日	自 平成29年11月21日 至 平成30年 5月20日
期首元本額	100,000円	100,000円
期中追加設定元本額	- 円	888,175,447円
期中一部解約元本額	- 円	28,661,377円

（参考）

#### キャピタル・ニューワールド・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・ニューワールド・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）

平成30年 5月20日現在

資産の部	
流動資産	
投資信託受益証券	2,286,550
投資証券	16,609,183,240
未収入金	6,000,000
流動資産合計	16,617,469,790
資産合計	16,617,469,790
負債の部	
流動負債	
未払解約金	6,000,000
流動負債合計	6,000,000
負債合計	6,000,000
純資産の部	
元本等	
元本	14,793,957,170
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,817,512,620
元本等合計	16,611,469,790
純資産合計	16,611,469,790
負債純資産合計	16,617,469,790

#### 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	平成30年 5月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数		14,793,957,170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	1.1229円
	(1万口当たり純資産額)	(11,229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 平成29年11月21日 至 平成30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	平成30年 5月20日現在
同計算期間の期首元本額	14,022,190,516円
同計算期間の追加設定元本額	1,279,142,774円
同計算期間の一部解約元本額	507,376,120円
計算日の元本額	14,793,957,170円
元本額の内訳	
キャピタル・ニューワールド・ファンドAコース（米ドル売り円買い）	14,016,615,638円
キャピタル・ニューワールド・ファンドF（米ドル売り円買い）	777,341,532円

## キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド（LUX）

「キャピタル・ニューワールド・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・ニューワールド・ファンド（LUX）（クラスC H J P Y）」（ルクセンブルク籍外国投資法人（以下、当外国投資法人といいます。）の発行する外国投資証券）を主な投資対象としております。

当外国投資法人を含むアンブレラファンド（CIF）については、2017年12月31日付けで、ルクセンブルクにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務書類が作成されております。この財務書類は独立監査人であるプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コオペラティブの監査を受けております。以下の「投資明細表」「純資産価額計算書」「損益および純資産変動計算書」および「投資証券口数変動計算書」等は、原文の財務書類から委託会社が抜粋・翻訳したものでありますが、これらは監査意見の対象外であります。

## キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド（LUX）

### 投資明細表

2017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				
アルゼンチン				
Argentina Government Bond 5.625% 26/01/2022	USD	355,000	375,412	0.03
Argentina Government Bond 7.5% 22/04/2026	USD	375,000	425,119	0.03
Argentina Government Bond 6.875% 26/01/2027	USD	85,000	92,990	0.01
Argentina Government Bond 8.28% 31/12/2033	USD	677,184	801,786	0.06
Argentina Government Bond, FRN 24.328% 03/04/2022	ARS	3,450,000	184,772	0.02
Argentina Government Bond 0% 15/12/2035	USD	2,320,000	245,340	0.02
Argentina Government Bond, STEP 2.285% 31/12/2038	EUR	640,000	562,566	0.04
Argentina Treasury Bill 0% 11/05/2018	USD	5,000	4,948	-
Argentina Treasury Bill 0% 24/05/2018	USD	7,000	6,920	-
Argentina Treasury Bill 0% 15/06/2018	USD	31,000	30,584	-
Argentina Treasury Bill 0% 29/06/2018	USD	46,513	45,819	-
Argentina Treasury Bill 0% 13/07/2018	USD	182,000	179,115	0.01
City of Buenos Aires Argentina, FRN 26.604% 22/02/2028	ARS	5,550,000	298,126	0.02
City of Buenos Aires Argentina, Reg. S 8.95% 19/02/2021	USD	1,245,000	1,385,063	0.10

YPF SA, 144A 8.5% 28/07/2025	USD	510,000	592,875	0.04
YPF SA, Reg. S 8.75% 04/04/2024	USD	270,000	310,770	0.02
			5,542,205	0.40
<b>バーレーン</b>				
Bahrain Government Bond, 144A 6.75% 20/09/2029	USD	925,000	913,669	0.07
			913,669	0.07
<b>ブラジル</b>				
Brazil Government Bond 4.875% 22/01/2021	USD	290,000	308,125	0.02
Brazil Government Bond 4.25% 07/01/2025	USD	200,000	203,650	0.01
Brazil Government Bond 5% 27/01/2045	USD	200,000	186,900	0.01
Brazil Government Bond 5.625% 21/02/2047	USD	600,000	614,400	0.04
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/07/2021	BRL	18,800,000	4,149,655	0.30
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2025	BRL	1,175,000	354,209	0.03
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2027	BRL	3,519,000	1,047,686	0.08
Cemig Geracao e Transmissao SA, 144A 9.25% 05/12/2024	USD	300,000	324,375	0.02
Petrobras Global Finance BV 6.125% 17/01/2022	USD	660,000	702,075	0.05
Petrobras Global Finance BV 4.375% 20/05/2023	USD	600,000	594,882	0.04
Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/05/2026	USD	665,000	796,338	0.06
Petrobras Global Finance BV 6.85% 05/06/2115	USD	355,000	343,019	0.03
Vale Overseas Ltd. 6.25% 10/08/2026	USD	295,000	342,495	0.02
Vale Overseas Ltd. 6.875% 21/11/2036	USD	55,000	67,650	0.01
Vale Overseas Ltd. 6.875% 10/11/2039	USD	345,000	424,781	0.03
			10,460,240	0.75
<b>中国</b>				
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd., Reg. S 3.5% 04/05/2027	USD	1,475,000	1,483,300	0.11
			1,483,300	0.11
<b>コロンビア</b>				
Colombia Government Bond 4.5% 28/01/2026	USD	610,000	651,709	0.05
Colombia Government Bond 7.375% 18/09/2037	USD	165,000	223,740	0.02
Colombian TES 5% 21/11/2018	COP	100,000,000	33,684	-
Colombian TES 10% 24/07/2024	COP	130,000,000	52,627	-
Colombian TES 7.5% 26/08/2026	COP	130,000,000	46,618	-
Ecopetrol SA 5.875% 28/05/2045	USD	275,000	281,738	0.02
			1,290,116	0.09
<b>クロアチア</b>				
Croatia Government Bond, Reg. S 6.625% 14/07/2020	USD	245,000	267,175	0.02
			267,175	0.02
<b>ドミニカ共和国</b>				
Dominican Republic Government Bond, 144A 5.5% 27/01/2025	USD	510,000	541,237	0.04
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 7.5% 06/05/2021	USD	525,000	574,219	0.04
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 5.875% 18/04/2024	USD	100,000	107,899	0.01
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.875% 29/01/2026	USD	100,000	114,276	0.01
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 5.95% 25/01/2027	USD	410,000	443,825	0.03
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 7.45% 30/04/2044	USD	465,000	556,838	0.04
			2,338,294	0.17

## エジプト

Egypt Government Bond, 144A 7.5% 31/01/2027	USD	200,000	221,479	0.01
Egypt Government Bond, Reg. S 8.5% 31/01/2047	USD	805,000	926,321	0.07
			1,147,800	0.08

## ガーナ

Ghana Government Bond, Reg. S 7.875% 07/08/2023	USD	750,000	826,117	0.06
			826,117	0.06

## ギリシャ

Greece Government Bond, Reg. S 3.5% 30/01/2023	EUR	48,812	58,327	0.01
Greece Government Bond, Reg. S 3.75% 30/01/2028	EUR	69,387	80,981	0.01
Greece Government Bond, Reg. S 3.9% 30/01/2033	EUR	13,575	15,292	-
Greece Government Bond, Reg. S 4% 30/01/2037	EUR	32,087	35,741	-
Greece Government Bond, Reg. S 4.2% 30/01/2042	EUR	169,006	188,080	0.01
			378,421	0.03

## ハンガリー

Hungary Government Bond 5.75% 22/11/2023	USD	390,000	446,773	0.03
Hungary Government Bond 7.625% 29/03/2041	USD	104,000	163,297	0.01
			610,070	0.04

## インド

India Government Bond 7.8% 11/04/2021	INR	33,600,000	539,268	0.04
India Government Bond 8.83% 25/11/2023	INR	39,000,000	651,158	0.05
India Government Bond 8.4% 28/07/2024	INR	26,000,000	427,744	0.03
India Government Bond 7.88% 19/03/2030	INR	25,600,000	410,206	0.03
India Government Bond 7.61% 09/05/2030	INR	77,450,000	1,210,393	0.09
State of Maharashtra India 8.24% 24/12/2024	INR	13,000,000	208,705	0.01
State of Maharashtra India 8.12% 13/11/2025	INR	15,700,000	250,477	0.02
			3,697,951	0.27

## インドネシア

Indonesia Government Bond, Reg. S 4.875% 05/05/2021	USD	530,000	566,241	0.04
Indonesia Government Bond, Reg. S 3.375% 15/04/2023	USD	480,000	485,465	0.03
Indonesia Government Bond, Reg. S 4.125% 15/01/2025	USD	680,000	707,656	0.05
Indonesia Government Bond, Reg. S 4.35% 08/01/2027	USD	900,000	953,665	0.07
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 144A 4.35% 10/09/2024	USD	240,000	254,076	0.02
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, Reg. S 4.55% 29/03/2026	USD	755,000	799,198	0.06
			3,766,301	0.27

## ヨルダン

Jordan Government Bond, 144A 5.75% 31/01/2027	USD	605,000	601,676	0.04
			601,676	0.04

## カザフスタン

Kazakhstan Government Bond, Reg. S 3.875% 14/10/2024	USD	460,000	478,846	0.03
Kazakhstan Government Bond, Reg. S 5.125% 21/07/2025	USD	655,000	730,967	0.05
Kazakhstan Government Bond, Reg. S 4.875% 14/10/2044	USD	205,000	221,064	0.02



1,430,877	0.10
-----------	------

## ケニア

Kenya Government Bond, Reg. S 6.875% 24/06/2024	USD	1,085,000	1,158,243	0.08
--	-----	-----------	-----------	------

1,158,243	0.08
-----------	------

## クウェート

Kuwait Government Bond, 144A 2.75% 20/03/2022	USD	400,000	399,140	0.03
---	-----	---------	---------	------

399,140	0.03
---------	------

## メキシコ

Mexican Bonos 6.5% 10/06/2021	MXN	13,980,000	687,429	0.05
Mexican Bonos 10% 05/12/2024	MXN	3,400,000	195,083	0.01
Mexican Bonos 5.75% 05/03/2026	MXN	28,030,000	1,261,560	0.09
Mexican Bonos 7.75% 29/05/2031	MXN	3,200,000	162,999	0.01
Mexican Bonos 7.75% 23/11/2034	MXN	1,800,000	91,592	0.01
Mexican Udibonos 4% 15/11/2040	MXN	653,332	34,924	-
Mexico Government Bond 4% 02/10/2023	USD	774,000	811,926	0.06
Mexico Government Bond 4.15% 28/03/2027	USD	430,000	446,448	0.03
Mexico Government Bond 6.05% 11/01/2040	USD	106,000	125,265	0.01
Mexico Government Bond 5.55% 21/01/2045	USD	105,000	118,519	0.01
Mexico Government Bond 4.35% 15/01/2047	USD	405,000	387,787	0.03
Mexico Government Bond 5.75% 12/10/2110	USD	164,000	175,480	0.01
Petroleos Mexicanos 7.47% 12/11/2026	MXN	15,600,000	701,033	0.05
Petroleos Mexicanos 6.75% 21/09/2047	USD	260,000	272,051	0.02

5,472,096	0.39
-----------	------

## モロッコ

Morocco Government Bond, Reg. S 4.25% 11/12/2022	USD	755,000	797,854	0.06
---	-----	---------	---------	------

Morocco Government Bond, Reg. S 5.5% 11/12/2042	USD	480,000	545,808	0.04
--	-----	---------	---------	------

1,343,662	0.10
-----------	------

## ナイジェリア

Nigeria Government Bond, 144A 6.5% 28/11/2027	USD	200,000	209,056	0.02
---	-----	---------	---------	------

209,056	0.02
---------	------

## パキスタン

Pakistan Government Bond, 144A 6.875% 05/12/2027	USD	200,000	201,024	0.01
---	-----	---------	---------	------

Pakistan Government Bond, Reg. S 7.25% 15/04/2019	USD	1,280,000	1,328,261	0.10
--	-----	-----------	-----------	------

Pakistan Government Bond, Reg. S 8.25% 15/04/2024	USD	990,000	1,095,520	0.08
--	-----	---------	-----------	------

Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd. (The), 144A 5.5% 13/10/2021	USD	685,000	693,798	0.05
--	-----	---------	---------	------

3,318,603	0.24
-----------	------

## パナマ

Panama Government Bond 3.75% 16/03/2025	USD	200,000	208,750	0.02
---	-----	---------	---------	------

Panama Government Bond 4.5% 15/05/2047	USD	1,090,000	1,176,110	0.08
--	-----	-----------	-----------	------

1,384,860	0.10
-----------	------

## パラグアイ

Paraguay Government Bond, Reg. S 5% 15/04/2026	USD	455,000	490,263	0.03
--	-----	---------	---------	------

Paraguay Government Bond, Reg. S 6.1% 11/08/2044	USD	205,000	234,212	0.02
---	-----	---------	---------	------

724,475	0.05
---------	------

## ペルー

Peru Government Bond 2.75% 30/01/2026	EUR	200,000	267,663	0.02
Peru Government Bond 4.125% 25/08/2027	USD	90,000	98,010	0.01
Peru Government Bond 6.55% 14/03/2037	USD	65,000	88,237	-
Peru Government Bond 5.625% 18/11/2050	USD	80,000	102,840	0.01
			556,750	0.04
<b>フィリピン</b>				
Philippine Government Bond 4% 15/01/2021	USD	100,000	105,132	0.01
Philippine Government Bond 6.25% 14/01/2036	PHP	10,000,000	226,362	0.01
			331,494	0.02
<b>ポーランド</b>				
Poland Government Bond 5% 23/03/2022	USD	155,000	169,922	0.01
Poland Government Bond 3.25% 06/04/2026	USD	100,000	102,323	0.01
			272,245	0.02
<b>ロシア</b>				
Gazprom OAO, Reg. S 9.25% 23/04/2019	USD	325,000	351,190	0.03
Gazprom OAO, Reg. S 6.51% 07/03/2022	USD	875,000	969,916	0.07
Russian Federal Bond - OFZ 7.5% 18/08/2021	RUB	23,000,000	406,512	0.03
Russian Federal Bond - OFZ 7% 25/01/2023	RUB	23,050,000	400,160	0.03
Russian Federal Bond - OFZ 7% 16/08/2023	RUB	9,700,000	168,330	0.01
Russian Federal Bond - OFZ 7.7% 23/03/2033	RUB	13,000,000	226,837	0.02
Sberbank of Russia, 144A 5.25% 23/05/2023	USD	200,000	208,759	0.01
Vnesheconombank, Reg. S 6.902% 09/07/2020	USD	140,000	151,430	0.01
			2,883,134	0.21
<b>サウジアラビア</b>				
Saudi Government Bond, 144A 2.375% 26/10/2021	USD	600,000	586,038	0.04
Saudi Government Bond, 144A 3.625% 04/03/2028	USD	800,000	794,224	0.06
			1,380,262	0.10
<b>スロベニア</b>				
Slovenia Government Bond, 144A 4.75% 10/05/2018	USD	515,000	520,897	0.04
			520,897	0.04
<b>南アフリカ</b>				
South Africa Government Bond 7.25% 15/01/2020	ZAR	700,000	56,572	-
South Africa Government Bond 4.665% 17/01/2024	USD	145,000	148,620	0.01
South Africa Government Bond 10.5% 21/12/2026	ZAR	1,500,000	135,530	0.01
South Africa Government Bond 8% 31/01/2030	ZAR	1,500,000	111,077	0.01
South Africa Government Bond 6.5% 28/02/2041	ZAR	3,850,000	219,922	0.02
South Africa Government Bond 8.75% 28/02/2048	ZAR	16,400,000	1,201,982	0.09
			1,873,703	0.14
<b>スリランカ</b>				
Sri Lanka Government Bond, 144A 6.2% 11/05/2027	USD	200,000	211,544	0.02
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6% 14/01/2019	USD	200,000	205,181	0.01
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.825% 18/07/2026	USD	600,000	661,689	0.05
			1,078,414	0.08
<b>トルコ</b>				
Turkey Government Bond 8.8% 14/11/2018	TRY	320,000	81,467	-
Turkey Government Bond 7.4% 05/02/2020	TRY	680,000	161,994	0.01
Turkey Government Bond 5.625% 30/03/2021	USD	365,000	384,797	0.03
Turkey Government Bond 9.2% 22/09/2021	TRY	500,000	120,268	0.01
Turkey Government Bond 8.8% 27/09/2023	TRY	195,000	45,322	-
Turkey Government Bond 9% 24/07/2024	TRY	410,000	95,239	0.01
Turkey Government Bond 2% 18/09/2024	TRY	757,983	189,371	0.01
Turkey Government Bond 7.375% 05/02/2025	USD	85,000	98,092	0.01
Turkey Government Bond 8% 12/03/2025	TRY	580,000	124,362	0.01

Turkey Government Bond 10.6% 11/02/2026	TRY	1,045,000	256,736	0.02
Turkey Government Bond 4.875% 09/10/2026	USD	1,270,000	1,255,596	0.09
Turkey Government Bond 6% 14/01/2041	USD	675,000	684,285	0.05
Turkey Government Bond 4.875% 16/04/2043	USD	200,000	176,019	0.01
			3,673,548	0.26
<b>債券合計</b>			<b>61,334,794</b>	<b>4.42</b>
<b>株式</b>				
<b>アルゼンチン</b>				
Banco Macro SA, ADR	USD	14,579	1,689,415	0.12
BBVA Banco Frances SA, ADR	USD	134,140	3,380,328	0.24
Globant SA	USD	37,636	1,748,569	0.13
Grupo Financiero Galicia SA, ADR	USD	273,312	17,997,595	1.30
Grupo Supervielle SA, ADR	USD	13,414	393,298	0.03
Pampa Energia SA, ADR	USD	75,166	5,057,168	0.36
YPF SA, ADR	USD	25,516	584,572	0.04
			30,850,945	2.22
<b>オーストラリア</b>				
CSL Ltd.	AUD	59,820	6,595,114	0.47
Energy World Corp. Ltd.	AUD	2,661,266	768,288	0.06
Fortescue Metals Group Ltd.	AUD	259,828	989,326	0.07
Oil Search Ltd.	AUD	393,939	2,394,419	0.17
			10,747,147	0.77
<b>ブラジル</b>				
Ambev SA	BRL	128,640	825,257	0.06
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	BRL	760,766	5,224,518	0.38
Banco Bradesco SA Preference	BRL	455,936	4,652,689	0.34
BB Seguridade Participacoes SA	BRL	141,726	1,217,260	0.09
Centrais Eletricas Brasileiras SA	BRL	91,735	534,851	0.04
Cielo SA	BRL	163,720	1,160,862	0.08
Equatorial Energia SA	BRL	143,098	2,832,108	0.20
Hypermarcas SA	BRL	1,171,756	12,716,896	0.92
IRB Brasil Resseguros S/A	BRL	137,304	1,407,355	0.10
Itau Unibanco Holding SA, ADR Preference	USD	61,753	802,789	0.06
Itau Unibanco Holding SA Preference	BRL	383,681	4,925,127	0.35
JBS SA	BRL	3,128,663	9,252,716	0.67
Klabin SA	BRL	127,893	678,580	0.05
Kroton Educacional SA	BRL	1,118,882	6,206,454	0.45
Lojas Americanas SA Preference	BRL	203,127	1,044,079	0.07
Lojas Renner SA	BRL	311,406	3,331,765	0.24
MRV Engenharia e Participacoes SA	BRL	290,572	1,317,477	0.09
Petroleo Brasileiro SA, ADR Preference	USD	369,139	3,628,636	0.26
Petroleo Brasileiro SA, ADR	USD	381,866	3,929,401	0.28
Raia Drogasil SA	BRL	233,889	6,472,826	0.47
Rumo SA	BRL	1,084,534	4,240,573	0.31
Vale SA, ADR	USD	556,445	6,805,322	0.49
Vale SA	BRL	606,438	7,360,403	0.53
			90,567,944	6.53
<b>カナダ</b>				
First Quantum Minerals Ltd.	CAD	664,882	9,314,696	0.67
Teck Resources Ltd. 'B'	CAD	263,504	6,890,514	0.50
			16,205,210	1.17
<b>チリ</b>				
Enel Chile SA	CLP	7,431,203	879,210	0.06
			879,210	0.06
<b>中国</b>				

AAC Technologies Holdings, Inc.	HKD	172,966	3,086,129	0.22
Aier Eye Hospital Group Co. Ltd. 'A'	CNY	87,068	411,808	0.03
Alibaba Group Holding Ltd., ADR	USD	94,986	16,378,436	1.18
Aluminum Corp. of China Ltd. 'H'	HKD	422,000	301,936	0.02
Baidu, Inc., ADR	USD	56,732	13,287,202	0.96
Brilliance China Automotive Holdings Ltd.	HKD	950,000	2,541,326	0.18
China Biologic Products Holdings, Inc.	USD	25,810	2,033,054	0.15
China Construction Bank Corp. 'H'	HKD	4,409,000	4,063,152	0.29
China Gas Holdings Ltd.	HKD	3,668,000	10,140,832	0.73
China Merchants Port Holdings Co. Ltd.	HKD	343,275	898,516	0.07
China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 'H'	HKD	286,600	1,377,453	0.10
China Resources Gas Group Ltd.	HKD	2,162,000	7,845,114	0.57
China Unicom Hong Kong Ltd.	HKD	1,762,000	2,381,553	0.17
Ctrip.com International Ltd., ADR	USD	174,118	7,678,604	0.55
ENN Energy Holdings Ltd.	HKD	1,386,000	9,890,053	0.71
Foshan Haitian Flavouring & Food Co. Ltd. 'A'	CNY	886,084	7,320,534	0.53
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai 'A'	CNY	848,400	5,693,348	0.41
Guangzhou Baiyun International Airport Co. Ltd. 'A'	CNY	1,821,496	4,111,792	0.30
Hangzhou Hikvision Digital Technology Co. Ltd. 'A'	CNY	1,197,900	7,174,155	0.52
Hengan International Group Co. Ltd.	HKD	190,000	2,109,666	0.15
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd. 'A'	CNY	482,300	2,384,097	0.17
Kingboard Chemical Holdings Ltd.	HKD	167,500	905,799	0.07
Midea Group Co. Ltd. 'A'	CNY	454,400	3,867,843	0.28
Shanghai International Airport Co. Ltd. 'A'	CNY	1,206,811	8,341,303	0.60
Tencent Holdings Ltd.	HKD	446,415	23,198,255	1.67
TravelSky Technology Ltd. 'H'	HKD	507,000	1,521,743	0.11
Wuxi Biologics Cayman, Inc.	HKD	600,500	3,358,806	0.24
Yum China Holdings, Inc.	USD	37,626	1,505,793	0.11
Yunnan Baiyao Group Co. Ltd. 'A'	CNY	234,800	3,670,192	0.26
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	HKD	1,641,500	3,748,230	0.27
			161,226,724	11.62
<b>コロンビア</b>				
Grupo Nutresa SA	COP	132,289	1,233,156	0.09
			1,233,156	0.09
<b>デンマーク</b>				
Carlsberg A/S 'B'	DKK	11,367	1,364,839	0.10
Chr Hansen Holding A/S	DKK	55,737	5,228,123	0.38
Novo Nordisk A/S 'B'	DKK	93,317	5,030,789	0.36
			11,623,751	0.84
<b>フランス</b>				
Accor SA	EUR	11,877	612,777	0.04
Air Liquide SA	EUR	1,690	213,015	0.02
Airbus SE	EUR	143,873	14,327,959	1.03
ArcelorMittal	EUR	36,495	1,187,326	0.09
Arkema SA	EUR	14,404	1,755,052	0.13
BioMerieux	EUR	23,929	2,144,440	0.16
Edenred	EUR	59,727	1,732,822	0.13
Essilor International Cie Generale d'Optique SA	EUR	21,998	3,034,025	0.22
Hermes International	EUR	8,909	4,770,173	0.34
Kering	EUR	7,482	3,528,070	0.25
L'Occitane International SA	HKD	973,750	1,784,765	0.13
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	19,350	5,697,476	0.41
Pernod Ricard SA	EUR	48,509	7,679,955	0.55
Peugeot SA	EUR	36,949	751,670	0.05
Renault SA	EUR	15,471	1,557,611	0.11
Safran SA	EUR	25,183	2,595,841	0.19
Societe Generale SA	EUR	52,056	2,688,877	0.19
TOTAL SA	EUR	16,043	886,329	0.06

Valeo SA	EUR	12,731	951,192	0.07
			57,899,375	4.17
<b>ドイツ</b>				
BASF SE	EUR	21,460	2,362,193	0.17
Bayer AG	EUR	16,973	2,117,966	0.15
Bayerische Motoren Werke AG	EUR	23,079	2,404,439	0.18
Carl Zeiss Meditec AG	EUR	33,625	2,088,255	0.15
Deutsche Post AG	EUR	28,637	1,365,814	0.10
Evonik Industries AG	EUR	58,013	2,183,568	0.16
Henkel AG & Co. KGaA Preference	EUR	13,925	1,843,718	0.13
Infineon Technologies AG	EUR	92,457	2,533,190	0.18
LANXESS AG	EUR	24,212	1,925,776	0.14
Symrise AG	EUR	8,251	709,035	0.05
Volkswagen AG Preference	EUR	4,288	856,378	0.06
Wacker Chemie AG	EUR	9,132	1,777,230	0.13
			22,167,562	1.60
<b>ギリシャ</b>				
Eurobank Ergasias SA	EUR	1,823,058	1,859,287	0.13
JUMBO SA	EUR	238,152	4,257,625	0.31
			6,116,912	0.44
<b>香港</b>				
AIA Group Ltd.	HKD	2,481,404	21,168,406	1.53
Chow Sang Sang Holdings International Ltd.	HKD	1,259,000	3,042,413	0.22
Galaxy Entertainment Group Ltd.	HKD	734,000	5,890,527	0.43
Global Brands Group Holding Ltd.	HKD	1,708,000	139,913	0.01
Jardine Matheson Holdings Ltd.	USD	46,700	2,837,025	0.20
Li & Fung Ltd.	HKD	2,730,000	1,499,030	0.11
Melco Resorts & Entertainment Ltd., ADR	USD	168,749	4,900,471	0.35
MGM China Holdings Ltd.	HKD	240,400	727,706	0.05
Sands China Ltd.	HKD	647,200	3,342,509	0.24
Shangri-La Asia Ltd.	HKD	502,000	1,139,850	0.08
Sun Hung Kai Properties Ltd.	HKD	46,000	767,761	0.06
Techtronic Industries Co. Ltd.	HKD	556,000	3,625,847	0.26
Wynn Macau Ltd.	HKD	1,024,000	3,243,887	0.23
			52,325,345	3.77
<b>ハンガリー</b>				
Wizz Air Holdings plc	GBP	18,167	902,637	0.07
			902,637	0.07
<b>インド</b>				
ACC Ltd.	INR	38,592	1,063,181	0.08
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	INR	233,026	1,480,976	0.11
Aditya Birla Capital Ltd.	INR	219,387	632,958	0.05
Avenue Supermarts Ltd.	INR	54,472	1,008,194	0.07
Axis Bank Ltd. <sup>1</sup>	INR	226,884	1,824,223	0.13
Bajaj Finance Ltd.	INR	131,123	3,608,849	0.26
Bharti Airtel Ltd.	INR	171,739	1,425,116	0.10
Britannia Industries Ltd.	INR	8,252	608,840	0.04
Eicher Motors Ltd.	INR	11,578	5,503,684	0.40
Godrej Consumer Products Ltd.	INR	355,875	5,572,508	0.40
Grasim Industries Ltd.	INR	194,111	3,545,257	0.25
Havells India Ltd.	INR	287,943	2,537,363	0.18
HDFC Bank Ltd., ADR	USD	15,838	1,610,250	0.12
HDFC Bank Ltd. <sup>1</sup>	INR	613,188	18,135,696	1.31
Hindalco Industries Ltd.	INR	354,753	1,520,390	0.11
Housing Development Finance Corp. Ltd.	INR	123,414	3,307,153	0.24
ICICI Bank Ltd., ADR	USD	20,184	196,390	0.01

ICICI Bank Ltd.	INR	1,177,497	5,792,708	0.42
Indus Gas Ltd.	GBP	397,871	2,041,305	0.15
Kotak Mahindra Bank Ltd.	INR	862,505	13,650,896	0.98
MakeMyTrip Ltd.	USD	92,731	2,768,020	0.20
Maruti Suzuki India Ltd.	INR	15,106	2,302,684	0.17
Motherson Sumi Systems Ltd.	INR	154,500	918,008	0.07
Pidilite Industries Ltd.	INR	162,545	2,297,569	0.17
Piramal Enterprises Ltd.	INR	29,250	1,313,964	0.09
Power Grid Corp. of India Ltd.	INR	1,174,072	3,685,329	0.27
Reliance Industries Ltd.	INR	1,899,513	27,410,543	1.97
Shriram Transport Finance Co. Ltd.	INR	67,064	1,556,517	0.11
State Bank of India	INR	379,945	1,844,737	0.13
TVS Motor Co. Ltd.	INR	307,180	3,709,116	0.27
Vakrangee Ltd.	INR	284,900	1,875,825	0.13
Vakrangee Ltd.	INR	284,900	1,875,825	0.13
			126,624,074	9.12
<b>インドネシア</b>				
Bank Central Asia Tbk. PT	IDR	2,284,800	3,688,013	0.26
Matahari Department Store Tbk. PT	IDR	2,101,300	1,548,775	0.11
Surya Citra Media Tbk. PT	IDR	5,828,500	1,065,390	0.08
			6,302,178	0.45
<b>イスラエル</b>				
Teva Pharmaceutical Industries Ltd., ADR	USD	84,008	1,591,952	0.12
			1,591,952	0.12
<b>イタリア</b>				
Ferrari NV	EUR	8,351	876,244	0.06
UniCredit SpA	EUR	310,829	5,810,533	0.42
			6,686,777	0.48
<b>日本</b>				
Asahi Intecc Co. Ltd.	JPY	98,000	3,374,662	0.24
Hamamatsu Photonics KK	JPY	20,100	676,095	0.05
Kansai Paint Co. Ltd.	JPY	26,500	688,635	0.05
Kao Corp.	JPY	10,600	716,764	0.05
Keyence Corp.	JPY	13,400	7,506,616	0.54
Komatsu Ltd.	JPY	75,200	2,721,683	0.20
Lion Corp.	JPY	182,200	3,452,381	0.25
Murata Manufacturing Co. Ltd.	JPY	60,400	8,105,152	0.58
Nidec Corp.	JPY	16,300	2,287,136	0.16
Nifco, Inc.	JPY	10,900	743,918	0.05
Nitto Denko Corp.	JPY	24,700	2,194,338	0.16
Omron Corp.	JPY	21,300	1,270,344	0.09
Renesas Electronics Corp.	JPY	353,600	4,120,495	0.30
Ryohin Keikaku Co. Ltd.	JPY	20,800	6,479,521	0.47
Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	JPY	7,600	772,310	0.06
SMC Corp.	JPY	12,500	5,145,330	0.37
SoftBank Group Corp.	JPY	162,200	12,840,683	0.92
Sony Corp.	JPY	77,300	3,487,161	0.25
Suzuki Motor Corp.	JPY	19,900	1,153,997	0.08
Sysmex Corp.	JPY	24,300	1,912,944	0.14
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.	JPY	48,900	2,777,980	0.20
Tokyo Electron Ltd.	JPY	6,600	1,194,941	0.09
Topcon Corp.	JPY	83,300	1,801,661	0.13
Toyota Motor Corp.	JPY	38,400	2,458,213	0.18
Unicharm Corp.	JPY	42,500	1,104,981	0.08
			78,987,941	5.69
<b>マレーシア</b>				
IHH Healthcare Bhd.	MYR	1,621,400	2,347,765	0.17

Public Bank Bhd.	MYR	84,000	431,312	0.03
			2,779,077	0.20
<b>メキシコ</b>				
America Movil SAB de CV, ADR 'L'	USD	111,550	1,913,082	0.14
Becle SAB de CV	MXN	107,999	173,018	0.01
Coca-Cola Femsa SAB de CV	MXN	72,591	505,599	0.04
Fibra Uno Administracion SA de CV, REIT	MXN	797,009	1,181,174	0.08
Fomento Economico Mexicano SAB de CV, ADR	USD	5,891	553,165	0.04
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	MXN	209,630	1,971,828	0.14
Genomma Lab Internacional SAB de CV 'B'	MXN	1,662,992	1,735,517	0.12
Gruma SAB de CV 'B'	MXN	261,567	3,316,397	0.24
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV 'B'	MXN	79,699	819,142	0.06
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	MXN	106,552	1,940,398	0.14
Grupo Financiero Banorte SAB de CV 'O'	MXN	453,564	2,487,365	0.18
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	MXN	1,084,602	5,320,273	0.38
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 'A'	MXN	476,106	839,012	0.06
Wal-Mart de Mexico SAB de CV, ADR 'V'	USD	2,994	73,113	0.01
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	MXN	555,046	1,360,339	0.10
			24,189,422	1.74
<b>オランダ</b>				
Akzo Nobel NV	EUR	25,015	2,191,640	0.16
Altice NV 'A'	EUR	75,991	797,441	0.06
Altice NV 'B'	EUR	28,282	299,808	0.02
ASML Holding NV	EUR	26,484	4,612,407	0.33
Koninklijke DSM NV	EUR	13,810	1,320,126	0.10
Unilever NV, CVA	EUR	25,706	1,448,249	0.10
			10,669,671	0.77
<b>ニュージーランド</b>				
a2 Milk Co. Ltd.	AUD	136,908	787,282	0.06
			787,282	0.06
<b>ノルウェー</b>				
Yara International ASA	NOK	35,092	1,610,011	0.12
			1,610,011	0.12
<b>ペルー</b>				
Credicorp Ltd.	USD	6,438	1,335,434	0.10
			1,335,434	0.10
<b>フィリピン</b>				
Alliance Global Group, Inc.	PHP	6,588,000	2,111,538	0.15
Ayala Corp.	PHP	37,050	753,320	0.06
Ayala Land, Inc.	PHP	4,633,000	4,139,259	0.30
Bank of the Philippine Islands	PHP	1,824,420	3,950,717	0.29
Emperador, Inc.	PHP	10,705,200	1,576,186	0.11
Globe Telecom, Inc.	PHP	9,925	377,754	0.03
GT Capital Holdings, Inc.	PHP	28,310	732,703	0.05
International Container Terminal Services, Inc.	PHP	4,374,540	9,245,072	0.67
Metropolitan Bank & Trust Co.	PHP	503,360	1,022,450	0.07
SM Investments Corp.	PHP	83,700	1,659,916	0.12
SM Prime Holdings, Inc.	PHP	3,403,500	2,556,716	0.18
Universal Robina Corp.	PHP	237,020	716,948	0.05
			28,842,579	2.08
<b>ポーランド</b>				
PLAY Communications SA	PLN	44,378	431,038	0.03
			431,038	0.03

## カタール

Industries Qatar QSC	QAR	50,083	1,348,018	0.10
			1,348,018	0.10

## ロシア

Aeroflot PJSC	USD	553,066	1,328,798	0.10
En+ Group plc, GDR	USD	263,653	3,638,411	0.26
Lenta Ltd., GDR	USD	148,970	867,005	0.06
LUKOIL PJSC, ADR	USD	12,278	707,827	0.05
Magnit PJSC, GDR	USD	38,018	1,039,792	0.07
Magnit PJSC	USD	3,314	364,612	0.03
Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC	USD	2,474,438	4,679,211	0.34
Sberbank of Russia PJSC, ADR	USD	632,384	10,706,261	0.77
Yandex NV 'A'	USD	53,542	1,753,501	0.13
			25,085,418	1.81

## 南アフリカ

Barclays Africa Group Ltd.	ZAR	27,789	408,755	0.03
Capitec Bank Holdings Ltd.	ZAR	88,926	7,891,468	0.57
FirstRand Ltd.	ZAR	59,392	322,822	0.02
Mr Price Group Ltd.	ZAR	83,884	1,660,188	0.12
MTN Group Ltd.	ZAR	170,314	1,880,371	0.14
Naspers Ltd. 'N'	ZAR	42,009	11,717,362	0.84
Remgro Ltd.	ZAR	3,906	74,505	-
Shoprite Holdings Ltd.	ZAR	107,537	1,922,498	0.14
Steinhoff International Holdings NV	ZAR	1,816,053	682,534	0.05
			26,560,503	1.91

## 韓国

Amorepacific Corp.	KRW	7,029	1,999,281	0.14
Hyundai Mobis Co. Ltd.	KRW	13,933	3,422,894	0.25
Hyundai Motor Co.	KRW	47,708	6,951,985	0.50
LG Chem Ltd.	KRW	6,785	2,566,835	0.18
LG Household & Health Care Ltd.	KRW	509	565,318	0.04
Samsung Electronics Co. Ltd.	KRW	11,695	27,835,094	2.01
Samsung SDI Co. Ltd.	KRW	21,038	4,018,748	0.29
			47,360,155	3.41

## スペイン

Amadeus IT Group SA 'A'	EUR	38,129	2,749,977	0.20
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	EUR	61,139	521,720	0.04
Grifols SA, ADR Preference	USD	31,173	714,485	0.05
Grifols SA Preference 'B'	EUR	198,454	4,527,757	0.32
Industria de Diseno Textil SA	EUR	98,144	3,420,283	0.25
			11,934,222	0.86

## スウェーデン

Assa Abloy AB 'B'	SEK	227,819	4,732,401	0.34
Hexagon AB 'B'	SEK	8,956	448,613	0.03
			5,181,014	0.37

## スイス

LafargeHolcim Ltd.	CHF	56,816	3,203,899	0.23
Nestle SA	CHF	122,843	10,564,158	0.76
Novartis AG	CHF	57,283	4,843,880	0.35
Straumann Holding AG	CHF	1,755	1,240,000	0.09
Temenos Group AG	CHF	11,072	1,420,288	0.10
			21,272,225	1.53



## 台湾

Largan Precision Co. Ltd.	TWD	28,000	3,782,449	0.27
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	USD	55,599	2,204,500	0.16
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	2,742,085	21,147,185	1.52
United Microelectronics Corp.	TWD	18,207,017	8,687,926	0.63
			35,822,060	2.58

## タイ

Advanced Info Service PCL	THB	81,600	478,233	0.03
Airports of Thailand PCL	THB	584,300	1,219,159	0.09
Bangkok Bank PCL, NVDR	THB	129,400	802,050	0.06
CP ALL PCL	THB	666,500	1,574,731	0.11
Intouch Holdings PCL 'F'	THB	23,600	40,552	-
Intouch Holdings PCL, NVDR	THB	378,100	652,597	0.05
Kasikornbank PCL	THB	19,100	140,070	0.01
Kasikornbank PCL, NVDR	THB	511,500	3,641,240	0.26
Siam Commercial Bank PCL (The)	THB	19,959	91,864	0.01
Thai Beverage PCL	SGD	4,543,400	3,125,297	0.23
			11,765,793	0.85

## トルコ

Akbank Turk A/S	TRY	367,693	955,488	0.07
BIM Birlesik Magazalar A/S	TRY	15,894	327,482	0.02
Haci Omer Sabanci Holding A/S	TRY	1,322,096	3,878,567	0.28
Turkiye Garanti Bankasi A/S	TRY	984,510	2,784,315	0.20
			7,945,852	0.57

## アラブ首長国連邦

DP World Ltd.	USD	52,114	1,302,850	0.09
			1,302,850	0.09

## 英国

African Petroleum Corp. Ltd.	NOK	8,540	936	-
Associated British Foods plc	GBP	63,939	2,434,428	0.18
AstraZeneca plc	GBP	40,791	2,820,338	0.20
BAE Systems plc	GBP	174,920	1,353,244	0.10
BHP Billiton plc	GBP	98,306	2,020,781	0.15
British American Tobacco plc	GBP	211,651	14,339,466	1.03
Coca-Cola HBC AG	GBP	19,242	628,706	0.04
Experian plc	GBP	60,096	1,327,428	0.10
Glencore plc	GBP	964,209	5,077,124	0.37
Gulf Keystone Petroleum Ltd.	GBP	585,312	847,553	0.06
GVC Holdings plc	GBP	33,716	421,075	0.03
Halma plc	GBP	38,237	650,484	0.05
Hikma Pharmaceuticals plc	GBP	232,951	3,566,643	0.26
HSBC Holdings plc	GBP	148,887	1,541,621	0.11
Inchcape plc	GBP	94,364	996,948	0.07
InterContinental Hotels Group plc	GBP	22,668	1,444,259	0.10
Intertek Group plc	GBP	19,681	1,379,102	0.10
Johnson Matthey plc	GBP	47,684	1,979,702	0.14
Ophir Energy plc	GBP	1,836,906	1,686,467	0.12
Prudential plc	GBP	345,353	8,884,934	0.64
Randgold Resources Ltd.	GBP	58,854	5,888,114	0.42
Reckitt Benckiser Group plc	GBP	8,824	824,311	0.06
Rio Tinto plc	GBP	9,803	521,744	0.04
Rolls-Royce Holdings plc Preference	GBP	2,615,836	3,532	-
Rolls-Royce Holdings plc	GBP	155,909	1,782,940	0.13
Royal Dutch Shell plc 'A'	GBP	52,270	1,750,194	0.13
Royal Dutch Shell plc 'B'	GBP	170,120	5,761,711	0.41
Sirius Minerals plc	GBP	5,931,644	1,882,023	0.14

Vedanta Resources plc	GBP	108,126	1,174,460	0.08
Vodafone Group plc, ADR	USD	19,402	618,924	0.04
			73,609,192	5.30
<b>アメリカ合衆国</b>				
Acacia Communications, Inc.	USD	15,905	576,238	0.04
Accenture plc 'A'	USD	14,728	2,254,710	0.16
Air Products & Chemicals, Inc.	USD	6,318	1,036,657	0.07
Alcoa Corp.	USD	36,422	1,962,053	0.14
Alexion Pharmaceuticals, Inc.	USD	3,486	416,891	0.03
Alphabet, Inc. 'A'	USD	4,505	4,745,567	0.34
Alphabet, Inc. 'C'	USD	19,340	20,237,376	1.46
American Tower Corp., REIT	USD	17,715	2,527,399	0.18
Apple, Inc.	USD	3,186	539,167	0.04
Applied Materials, Inc.	USD	44,211	2,260,066	0.16
Baker Hughes a GE Co.	USD	19,036	602,299	0.04
BioMarin Pharmaceutical, Inc.	USD	47,450	4,231,117	0.31
Broadcom Ltd.	USD	53,577	13,763,931	0.99
Celanese Corp.	USD	12,671	1,356,811	0.10
Coca-Cola Co. (The)	USD	39,544	1,814,279	0.13
CommScope Holding Co., Inc.	USD	85,139	3,220,808	0.23
Coty, Inc. 'A'	USD	43,781	870,804	0.06
Cummins, Inc.	USD	17,366	3,067,530	0.22
Deere & Co.	USD	10,483	1,640,694	0.12
Domino's Pizza, Inc.	USD	14,506	2,741,054	0.20
DowDuPont, Inc.	USD	18,935	1,348,551	0.10
EPAM Systems, Inc.	USD	6,108	656,182	0.05
Exxon Mobil Corp.	USD	25,515	2,134,075	0.15
Facebook, Inc. 'A'	USD	56,066	9,893,406	0.71
General Electric Co.	USD	46,284	807,656	0.06
Herbalife Ltd.	USD	15,001	1,015,868	0.07
Hess Corp.	USD	22,397	1,063,186	0.08
Illumina, Inc.	USD	5,843	1,276,637	0.09
Inphi Corp.	USD	15,642	572,497	0.04
Intel Corp.	USD	157,884	7,287,925	0.53
Johnson Controls International plc	USD	39,991	1,524,057	0.11
Kosmos Energy Ltd.	USD	1,114,157	7,631,975	0.55
Lumentum Holdings, Inc.	USD	17,618	861,520	0.06
MACOM Technology Solutions Holdings, Inc.	USD	20,862	678,850	0.05
Marriott International, Inc. 'A'	USD	13,777	1,869,952	0.14
Mastercard, Inc. 'A'	USD	60,685	9,185,282	0.66
McDonald's Corp.	USD	3,537	608,788	0.04
Mellanox Technologies Ltd.	USD	51,933	3,360,065	0.24
MercadoLibre, Inc.	USD	22,543	7,093,380	0.51
MGM Resorts International	USD	17,447	582,555	0.04
Micron Technology, Inc.	USD	248,996	10,238,716	0.74
Microsoft Corp.	USD	52,567	4,496,581	0.32
Moody's Corp.	USD	9,382	1,384,877	0.10
NIKE, Inc. 'B'	USD	96,072	6,009,304	0.43
Noble Energy, Inc.	USD	132,453	3,859,680	0.28
Occidental Petroleum Corp.	USD	33,005	2,431,148	0.18
PepsiCo, Inc.	USD	16,218	1,944,863	0.14
PerkinElmer, Inc.	USD	28,786	2,104,832	0.15
Philip Morris International, Inc.	USD	24,510	2,589,482	0.19
Platform Speciality Products Corp	USD	27,234	270,161	0.02
Praxair, Inc.	USD	8,435	1,304,726	0.09
Priceline Group, Inc. (The)	USD	4,388	7,625,203	0.55
Samsonite International SA	HKD	618,332	2,841,232	0.21
Skyworks Solutions, Inc.	USD	17,614	1,672,449	0.12
Starbucks Corp.	USD	33,572	1,928,040	0.14
Syntel, Inc.	USD	112,630	2,589,364	0.19
Thermo Fisher Scientific, Inc.	USD	28,310	5,375,503	0.39
Trimble, Inc.	USD	32,511	1,321,247	0.10
Twenty-First Century Fox, Inc. 'A'	USD	20,299	700,925	0.05
Visa, Inc. 'A'	USD	44,895	5,118,928	0.37

Waters Corp.	USD	13,049	2,520,936	0.18
Western Union Co. (The)	USD	39,730	755,267	0.05
Wynn Resorts Ltd.	USD	9,492	1,600,256	0.12
Zoetis, Inc.	USD	14,491	1,043,932	0.08
			201,045,510	14.49
<b>株式合計</b>			<b>1,223,816,166</b>	<b>88.18</b>
<b>新株予約権付社債</b>				
<b>中国</b>				
Aier Eye Hospital. Group Co. Ltd. 19/07/2019 <sup>1</sup>	USD	260,100	1,230,195	0.09
Gree Electric Appliances, Inc. 04/12/2018 <sup>1</sup>	USD	61,700	414,050	0.03
			1,644,245	0.12
<b>新株予約権付社債合計</b>			<b>1,644,245</b>	<b>0.12</b>
<b>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</b>			<b>1,286,795,205</b>	<b>92.72</b>
<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</b>				
<b>債券</b>				
<b>ドミニカ共和国</b>				
Dominican Republic Government Bond, 144A 7.45% 30/04/2044	USD	525,000	628,687	0.04
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 11.25% 05/02/2027	DOP	21,600,000	509,179	0.04
			1,137,866	0.08
<b>エジプト</b>				
Egypt Treasury Bill 0% 06/03/2018	EGP	3,125,000	170,839	0.01
Egypt Treasury Bill 0% 13/03/2018	EGP	1,200,000	65,376	-
Egypt Treasury Bill 0% 20/03/2018	EGP	9,000,000	488,639	0.04
Egypt Treasury Bill 0% 03/04/2018	EGP	4,375,000	235,900	0.02
Egypt Treasury Bill 0% 10/04/2018	EGP	3,375,000	181,824	0.01
Egypt Treasury Bill 0% 08/05/2018	EGP	8,250,000	438,368	0.03
			1,580,946	0.11
<b>ジャマイカ</b>				
Digicel Ltd., 144A 6% 15/04/2021	USD	200,000	197,598	0.02
			197,598	0.02
<b>メキシコ</b>				
Petroleos Mexicanos 6.375% 04/02/2021	USD	70,000	76,265	0.01
Petroleos Mexicanos 6.875% 04/08/2026	USD	250,000	284,062	0.02
			360,327	0.03
<b>ナイジェリア</b>				
Nigeria Government Bond 0% 03/05/2018	NGN	11,200,000	29,679	-
Nigeria Government Bond 0% 14/06/2018	NGN	8,310,000	21,547	-
Nigeria Government Bond 0% 21/06/2018	NGN	49,300,000	127,434	0.01
Nigeria Government Bond 0% 26/07/2018	NGN	254,400,000	647,256	0.05
Nigeria Treasury Bill 0% 20/09/2018	NGN	24,100,000	59,854	0.01
Nigeria Treasury Bill 0% 18/10/2018	NGN	65,800,000	165,451	0.01
			1,051,221	0.08
<b>南アフリカ</b>				
Myriad International Holdings BV, Reg. S 6% 18/07/2020	USD	400,000	430,926	0.03
			430,926	0.03
<b>債券合計</b>			<b>4,758,884</b>	<b>0.35</b>
<b>株式</b>				

## フランス

Air Liquide SA <sup>1</sup>	EUR	205	25,789	-
			25,789	-

## インド

Axis Bank Ltd. <sup>1</sup>	INR	105,385	273,094	0.02
			273,094	0.02

## 株式合計

298,883 0.02

## 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

5,057,767 0.37

## 新規発行証券

## 債券

## ブラジル

Petrobras Global Finance BV, 144A 5.999% 27/01/2028	USD	361,000	362,354	0.03
			362,354	0.03

## 債券合計

362,354 0.03

## 新規発行証券合計

362,354 0.03

## UCITS準拠ファンド、もしくは他の譲渡可能証券への集合投資事業

## 集団投資スキーム- UCITS

## ルクセンブルク

JPMorgan US Dollar Treasury Liquidity - Institutional (dist.)	USD	58,467,048	58,467,048	4.21
			58,467,048	4.21

## 集団投資スキーム合計- UCITS

58,467,048 4.21

## 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

58,467,048 4.21

## 投資総額

1,350,682,374 97.33

## 銀行預金

35,283,813 2.54

## その他の純資産 / (負債)

1,834,170 0.13

## 純資産総額

1,387,800,357 100.00

<sup>1</sup> 証券は取締役会により公正な価値で評価されている。

## 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	336,495	JPY	37,450,000	05/01/2018	J.P. Morgan	4,089	-

USD	548,847	MXN	10,250,000	08/01/2018	J.P. Morgan	28,042	-
USD	1,215,351	BRL	3,970,000	09/01/2018	J.P. Morgan	19,327	-
先物為替予約の未実現益						51,458	-
AUD Hedged Share Class							
AUD	826,254	USD	624,665	19/01/2018	J.P. Morgan	20,023	-
EUR Hedged Share Class							
EUR	1,631,508	USD	1,923,702	19/01/2018	J.P. Morgan	35,807	-
JPY Hedged Share Class							
JPY	16,077,236,077	USD	142,028,887	19/01/2018	J.P. Morgan	773,384	0.06
ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現益						829,214	0.06
先物為替予約の未実現益合計						880,672	0.06
USD	353,086	EUR	295,000	08/01/2018	J.P. Morgan	(975)	-
USD	1,003,313	GBP	750,000	08/01/2018	J.P. Morgan	(9,455)	-
USD	7,039,519	INR	456,080,000	08/01/2018	J.P. Morgan	(101,596)	(0.01)
USD	148,934	TRY	593,500	08/01/2018	J.P. Morgan	(7,405)	-
USD	701,202	ZAR	9,800,000	08/01/2018	J.P. Morgan	(90,261)	-
USD	542,378	EUR	461,000	12/01/2018	Bank of America	(11,053)	-
先物為替予約の未実現損						(220,745)	(0.01)
AUD Hedged Share Class							
AUD	18,692	USD	14,589	19/01/2018	J.P. Morgan	(5)	-
JPY Hedged Share Class							
JPY	29,468,000	USD	262,520	19/01/2018	J.P. Morgan	(777)	-
ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現損						(782)	-
先物為替予約の未実現損合計						(221,527)	(0.01)
先物為替予約の未実現損益総額						659,145	0.05

国名はCIF Annual Report原本に基づき投資国を表示している

## キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド(LUX)

### 純資産価額計算書

#### 投資明細表

2017年12月31日現在

(USD)

#### 資産

投資有価証券(時価)(注記2b)	1,350,682,374
TBA取引に係る投資有価証券(時価)(注記2f)	
銀行預金	35,791,480
未収配当金および未収利息(源泉徴収税額控除後)(注記2d,5b)	1,929,275
投資証券引受に係る未収入金	837,278
TBA取引に係る未収入金(注記2f)	
ヘッジ・エクイバレント・クラスの為替予約取引に係る未実現益(注記7)	829,214
前払費用およびその他未収入金	247,955

投資有価証券売却に係る未収入金	1,800,217
先物為替予約取引に係る未実現益(注記6)	51,458
スワップ取引に係る未実現益(注記8,9)	
金融先物取引に係る未実現益(注記10)	
スワップ取引に係る未収利息	
先物為替予約取引に係る未収入金	
<b>資産合計</b>	<b>1,392,169,251</b>
<b>負債</b>	
TBA取引に係る未払金(注記2f)	
投資有価証券買入に係る未払金	1,418,269
未払費用およびその他未払金	2,101,292
投資証券買戻に係る未払金	70,904
ヘッジ・エクイバレント・クラスの為替予約取引に係る未実現損(注記7)	782
未払運用報酬(注記3a)	49,235
先物為替予約取引に係る未実現損(注記6)	220,745
当座貸越 <sup>1</sup>	507,667
スワップ取引に係る未実現損(注記8,9)	
委託保証金	
先物為替予約取引に係る未払金	
スワップ取引に係る未払利子	
金融先物取引に係る未実現損(注記10)	
<b>負債合計</b>	<b>4,368,894</b>
<b>純資産合計</b>	<b>1,387,800,357</b>
<b>投資簿価金額</b>	<b>1,241,392,136</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。

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

## キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド(LUX)

### 損益および純資産変動計算書

#### 純資産価額計算書

#### 投資明細表

2017年12月31日現在

(USD)

<b>収益(注記2d)</b>	
受取配当金(源泉徴収税額控除後)(注記5b)	5,763,477
債券および転換社債に係る利息(源泉徴収税額控除後)(注記5b)	2,001,437
銀行預金利息	21,492
スワップ取引(注記8、9)	
その他収益(注記5b)	
<b>収益小計</b>	<b>7,786,406</b>

**費用**

運用報酬(注記3a)	391,710
管理手数料(注記3b)	275,478
専門家サービス	359,277
年次税(注記5a)	66,532
デジタリー・カस्टディ費用およびファンド管理手数料(注記3b)	204,621
印刷費用	57,947
その他費用	50,591
スワップ取引(注記8、9)	
<b>費用小計</b>	<b>1,406,156</b>
費用の払戻し(注記3d)	201,752
<b>投資純利益/(損失)(a)</b>	<b>6,582,002</b>
実現純利益/(損失)	
投資有価証券の売却取引(注記2e)	10,434,294
金融先物取引(注記10)	
スワップ取引(注記8)	
為替取引(注記2c)	(3,506,770)
<b>当期実現純利益/(損失)(b)</b>	<b>6,927,524</b>
未実現評価利益/(損失)の増減	
投資有価証券	110,959,174
為替取引(注記2c)	661,870
金融先物取引(注記10)	
スワップ取引(注記8)	
<b>当期末実現評価利益/(損失)の増減:(c)</b>	<b>111,621,044</b>
<b>当期損益(a+b+c)</b>	<b>125,130,570</b>
<b>配当金の分配(注記4)</b>	<b>(54,284)</b>
当期投資証券の差引増減額	1,213,318,629
期首純資産総額	49,405,442
<b>期末純資産総額</b>	<b>1,387,800,357</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・ニューワールド・ファンド(LUX)

投資証券口数変動計算書

損益および純資産変動計算書

純資産価額計算書

投資明細表

2017年12月31日現在

クラスA7		クラスN	
期首投資証券口数		期首投資証券口数	5,000
引受投資証券口数	13,970	引受投資証券口数	5,353
買戻し投資証券口数	(4,307)	買戻し投資証券口数	

<b>期末投資証券口数</b>	<b>9,663</b>
<b>クラス B</b>	
期首投資証券口数	5,000
引受投資証券口数	221,469
買戻し投資証券口数	(18,104)
<b>期末投資証券口数</b>	<b>208,365</b>
<b>クラス Bh-EUR</b>	
期首投資証券口数	
引受投資証券口数	8,079
買戻し投資証券口数	
<b>期末投資証券口数</b>	<b>8,079</b>
<b>クラス C</b>	
期首投資証券口数	
引受投資証券口数	91,923,255
買戻し投資証券口数	(184,266)
<b>期末投資証券口数</b>	<b>91,738,989</b>
<b>クラス Cad</b>	
期首投資証券口数	
引受投資証券口数	54,402
買戻し投資証券口数	
<b>期末投資証券口数</b>	<b>54,402</b>
<b>クラス Cadh-AUD</b>	
期首投資証券口数	
引受投資証券口数	54,011
買戻し投資証券口数	
<b>期末投資証券口数</b>	<b>54,011</b>
<b>クラス Ch-JPY</b>	
期首投資証券口数	
引受投資証券口数	11,723,389
買戻し投資証券口数	(10,317)
<b>期末投資証券口数</b>	<b>11,713,072</b>

<b>期末投資証券口数</b>	<b>10,353</b>
<b>クラス Z</b>	
期首投資証券口数	5,045,373
引受投資証券口数	6,561,245
買戻し投資証券口数	(6,568,259)
<b>期末投資証券口数</b>	<b>5,038,359</b>
<b>クラス Zd</b>	
期首投資証券口数	62,356
引受投資証券口数	89,286
買戻し投資証券口数	(667)
<b>期末投資証券口数</b>	<b>150,975</b>
<b>クラス Zgd</b>	
期首投資証券口数	5,000
引受投資証券口数	
買戻し投資証券口数	
<b>期末投資証券口数</b>	<b>5,000</b>
<b>クラス Zh-EUR</b>	
期首投資証券口数	
引受投資証券口数	901,103
買戻し投資証券口数	(767,135)
<b>期末投資証券口数</b>	<b>133,968</b>
<b>期末投資証券口数 総合計</b>	<b>109,125,236</b>

## キャピタル・インターナショナル・ファンド

## 財務書類に関する注記

2017年12月31日現在

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

## a. 法制

CIFは、ルクセンブルク籍外国投資法人の投資証券(Societe d'Investissement a Capital Variable(以下「SICAV」という。))であり、2010年12月17日付ルクセンブルク法第1部に基づきUCITSとして設立された。

また、2013年2月1日から、CIFは自らが管理会社となるSICAVより、キャピタル・インターナショナル・マネジメント・カンパニー・S.a r.l(以下「管理会社」という。)という名称のマネジメントカンパニーが管理会社となるSICAVへ変更となった。



尚、運営は1969年12月30日より開始されている。

b. ファンド

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

キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（LUX）  
 キャピタル・グループ・ジャパン・エクイティ・ファンド（LUX）  
 キャピタル・グループ・ワールド・ディビデント・グロウーズ（LUX）  
 キャピタル・グループ・グローバル・グロース・アンド・インカム・ファンド（LUX）  
 キャピタル・グループ・ヨーロピアン・グロース・アンド・インカム・ファンド（LUX）  
 キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド（LUX）  
 キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（LUX）  
 キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド（LUX）  
 キャピタル・グループ・ユーロ・ボンド・ファンド（LUX）  
 キャピタル・グループ・ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド（LUX）  
 キャピタル・グループ・ニューパースペクティブ・ファンド（LUX）  
 キャピタル・グループ・グローバル・アブソリュート・インカム・グロワー（LUX）  
 キャピタル・グループ・インベストメント・カンパニー・オブ・アメリカ（LUX）  
 キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド（LUX）  
 キャピタル・グループ・グローバル・インターミディエイト・ボンド・ファンド（LUX）  
 キャピタル・グループ・U S・コーポレート・ボンド・ファンド（LUX）（設定日 2017年3月21日）  
 キャピタル・グループ・AMCAP・ファンド（LUX）（設定日 2017年6月16日）  
 キャピタル・グループ・U S・ハイ・イールド・ファンド（LUX）（設定日 2017年10月30日）

c. 投資証券クラスおよび通貨

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

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

2017年11月13日付にて、キャピタル・グループ・アジア・パシフィック（除く日本）・エクイティ・ファンド（LUX）（2017年12月18日付にて償還）、キャピタル・グループ・ワールド・ディビデント・グロウーズ（LUX）、キャピタル・グループ・グローバル・グロース・アンド・インカム・ファンド（LUX）、キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド（LUX）、キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（LUX）、キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド（LUX）の会計通貨をユーロから米ドルへ、また、キャピタル・グループ・ジャパン・エクイティ・ファンド（LUX）の会計通貨をユーロから日本円へ変更した。

ファンドの会計通貨（財務会計用の通貨であり、基準通貨とは異なることもある）は、米ドルであるキャピタル・グループ・アジア・パシフィック（除く日本）・エクイティ・ファンド、キャピタル・グループ・ワールド・ディビデント・グロウーズ、キャピタル・グループ・グローバル・グロース・アンド・インカム・ファンド、キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド、キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ、キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド、キャピタル・グループ・ニューパースペクティブ・ファンド、キャピタル・グループ・グローバル・アブソリュート・インカム・グロワー、キャピタル・グループ・インベストメント・カンパニー・オブ・アメリカ、キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド、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、キャピタル・グループ・U S・コーポレート・ボンド・ファンド、キャピタル・グループ・AMCAP・ファンド、および、キャピタル・グループ・U S・ハイ・イールド・ファンド、および日本円であるキャピタル・グループ・ジャパン・エクイティ・ファンドを除き、ユーロである。基準通貨はファンドが投資目的に保有する現金の通貨である。

連結純資産価額計算書、並びに連結損益および純資産変動計算書は、各サブ・ファンドの純資産価額計算書、並びに損益および純資産変動計算書を、2017年12月31日現在の為替レートで会計通貨に換算し合計したものである。

d. 配当方針

- ・クラスA、A4、A7、A9、A11、B、C、N、T、X、Z、Z L並びにヘッジ・エクイバレント・クラスは、現在配当金の分配を行わないクラスである。
- ・分配型エクイバレント・クラス、並びに分配型ヘッジ・エクイバレント・クラスは、取締役会により配当金を分配するよう推奨されているクラスである。

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

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

“ad”または“adh”表示のある分配型エクイバレント・クラス、並びに分配型ヘッジ・エクイバレント・クラス配当金は、一般に総投資収益(源泉徴収税額および費用を控除した後の投資収益)および各クラスの為替取引にかかる

実現損益相当額である。特定のクラスはいかなる計算期間においても純投資収益が小額あるいは発生しない場合には分配を行わないことがある。

“fd”表示のある分配型エクイバレント・クラス

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

詳細については、財務書類に関する注記4に開示している。

e. 会計年度

CIFの会計年度は1月1日に開始し、12月31日に終了する。

2) 重要な会計方針

a. 基本事項

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

b. 投資有価証券の評価

下記( )に該当する場合を除き、公的な証券取引所に上場している有価証券またはその他の規制のある市場で取引されている有価証券は、ファンドの純資産計算日における各有価証券の主要取引市場で発表される直近の相場もしくはその時点で入手可能な価格、または取締役会が承認した価格情報会社より提供される直近の相場もしくはその時点で入手可能な価格を用いて評価される。また、その他の有価証券は、一もしくは複数のディーラーまたは価格情報会社から提供された価格、もしくは同等の利回り相当額により評価される。

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

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

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

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

c. 外貨

ユーロ以外の通貨建て資産および負債は、2017年12月31日現在の為替レートでユーロに換算されている。また、ユーロ以外の通貨での期中取引は、取引時の為替レートでユーロに換算されている。2016年12月31日から2017年12月31日までの期間の、未決済の先物為替予約並びにその他資産および負債に係る未実現純利益または損失の変動は、「為替取引に係る未実現評価(損)益の増減」に開示されている。当期中に満期となった先物為替予約を含め、為替に係る実現純利益または損失は、「為替取引に係る実現純(損)益」に開示されている。

2017年12月31日の適用為替レートはキャピタル・グループ・ジャパン・エクイティ・ファンド(LUX)は135.193097618 日本円/ユーロ、他の全ファンドは1.199849990米ドル/ユーロが適用された。

d. 収益

配当金は、当該有価証券の配当落ち日に計上され、受取利息は日割計算で計上されている。

転換社債、減債基金付社債、減債基金付コーラブル債、インデックス連動債、インフレ連動債、利付債、ユニタイズド・ボンドのプレミアムおよびディスカウントは実効金利法で償却される。その他の確定利付証券のプレミアムおよびディスカウントは定額法で償却される。

e. 投資有価証券の売却に係る実現利益または損失

投資有価証券の売却に係る実現利益または損失は平均取得原価に基づき算出されている。確定利付証券の売却による利益および損失は先入先出法で算出されている。

f. モーゲージ証券-To Be Announced取引(TBA取引)

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

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

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

TBA取引に係る実現損益および未実現評価額(償却額)の増減は「投資有価証券の売却取引に係る実現純(損)益」お

よび「投資有価証券に係る未実現評価(損)益の増減」に開示されている。

g. スイング・プライシング調整

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

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

2017年12月31日現在、純資産価額を調整したファンドはない。

3) 費用

a. 運用報酬

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

キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド（LUX）

投資証券クラスおよびエクイバレント・クラス

クラスC、並びにエクイバレント・クラス

運用報酬に関する個別契約の締結が必須となる。

b. デポジタリー・カストディ費用およびファンド管理手数料

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

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

	デポジタリー・ カストディ費用	ファンドの 管理手数料
キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド（LUX）	0.04%	0.05%

c. 関係会社との取引

損益および純資産変動計算書上の「専門家サービス」は、2017年12月31日で終了する年度に受けた管理サービス料として管理会社から請求された総額1,066,237ユーロを含む。

d. 費用の払戻し

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

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

キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド（LUX）

クラスC、並びにエクイバレント・クラス

0.15%

2017年1月1日付にて、キャピタル・グループ・ワールド・ディビデント・グロワーズ、キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンドおよびキャピタル・グループ・ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンドのクラスZ並びに各エクイバレント・クラスの払戻の基準値は0.00%に縮小された。

2017年12月31日現在、ファンドで日々発生し、管理会社によって払戻される金額の合計は以下に示すとおりである。また、この払戻に係る方針は管理会社の決定により随時変更または取り下げることができる。

(USD)

キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド（LUX）	201,752
------------------------------	---------

## 4) 配当金の分配

配当方針の詳細は、財務書類に関する注記の1) dに記載がある。

2017年12月31日に発表された配当額は当ファンドが保有しているクラスでは該当なし。

## 5) 税金

## a. 年次税

ルクセンブルクにおいて、CIFは、各ファンドの各投資証券クラスの純資産総額に対して課される年率0.05%のみが年次税として徴収される。しかし、機関投資家専用の投資証券クラスについては、ルクセンブルクの法律で規定されるように、年率0.01%の軽減税率が2017年12月31日決算のクラスA、A4、A7、A9、C、並びに各エクイバレント・クラスに適用された。この軽減税率の適用が今後否認されないという保証はなく、また一度適用されたことが将来にわたる継続を保証するものではない。年次税は日割で計上され、四半期ごとに支払われ、四半期末の各クラスの純資産総額を基に算定されている。

## b. 外国税額

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

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

一定条件の下、CIFは、適用される租税措置において申請価値があると見なした場合は、各国の税務当局へ還付申請を行うことがある。これらの申請は性質として複雑であり、各地域の手続規定および判例法が適用される。

不確実性が見込まれた場合、ルクセンブルクで適用される会計原則に従い、CIFは見込みでの税還付を未収計上しない。還付が確定すると、源泉徴収税やキャピタルゲイン税還付金は確定通知に基づき「その他収益」、あるいは「投資有価証券の売却取引に係る実現純益」として計上される。

2017年12月31日に終了した会計年度において、ファンドへの返済はない。

## 6) 先物為替予約

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

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

## 7) ヘッジ・エクイバレント・クラス

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

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

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

これらのクラスは "h" およびヘッジされている通貨が記載されている。

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

## 8) クレジット・デフォルト・スワップ

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

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

## 9) 金利スワップ

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

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

#### 10) 金融先物取引

金融先物取引は、固定価格での原資産の先受渡または将来の特定の日における原資産の価値の変動に基づく現金額を規定している。先物契約を締結する際には、サブ・ファンドは、当初証拠金として契約金額のある一定割合相当額の現金または有価証券をブローカーに預託する必要がある。変動証拠金の支払は、サブ・ファンド毎に定期的に行われ、これは未決済先物契約の時価の変動に基づいている。

金融先物取引の未実現利益/損失は、純資産価額計算書の「金融先物取引に係る未実現益/損」に開示されている。未決済金融先物取引の時価の変動は、損益および純資産変動計算書の「未実現評価利益/(損失)の増減」内の「金融先物取引」に開示されている。未決済時と決済時の先物価格の差である実現損益は決済時または期日に損益および純資産変動計算書の「実現純利益/(損失)」内の「金融先物取引」に開示されている。

#### 11) 担保

2017年12月31日現在、店頭デリバティブの取引目的でブローカーおよびカウンターパーティーに授受された現金および非現金担保で構成された受取/支払担保は、以下のとおりである。

	サブファンド	カウンターパーティ	担保の種類	受取担保額	支払担保額
	通貨	/ブローカー			
キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ(LUX)	USD	Citibank	現金	-	305,000
キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ(LUX)	USD	J.P.Morgan	現金	-	332,000
キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド(LUX)	USD	Citibank	債券	-	812,000
キャピタル・グループ・グローバル・ボンド・ファンド(LUX)	USD	Goldman Sachs	債券	-	69,000
キャピタル・グループ・ユーロ・ボンド・ファンド(LUX)	EUR	Citibank	債券	-	171,000
キャピタル・グループ・ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド(LUX)	EUR	Citibank	債券	-	182,000
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)	USD	Citibank	債券	-	489,000

#### 12) クロス・インベストメント

2017年12月31日現在、サブ・ファンド間のクロス・インベストメント総額は9,916,036ユーロである。クロス・インベストメント総額を除いた年末時点における総純資産総額は7,011,063,329ユーロになる。

サブ・ファンド	クロス・インベストメント	通貨	時価(USD)
キャピタル・グループ・グローバル・アソシエイト・インカム・グロウワー(LUX)	キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ(LUX)	USD	11,897,756

#### 13) リスクエクスポージャーの算出方法

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

#### 14) 後発事象

2018年2月13日付で、キャピタル・グループ・グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド(LUX)が設定された。

#### 15) 取引費用

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

2017年12月31日に終了した会計年度における、当該費用は次のとおりである。

	(USD)
キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド(LUX)	1,458,707

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

## 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

「キャピタル・ニューワールド・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(平成19年9月26日)より各計算期間の財務諸表について、監査を受けております。なお、直近の計算期間は平成29年7月25日から平成30年1月24日までとなっております。ただし、同マザーファンド(「日本短期債券マザーファンド」)は当該監査の対象ではありません。

### 「日本短期債券マザーファンド」の組入有価証券の状況

(有価証券明細表)

(平成30年1月24日現在)

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額	
						単価 (円)	評価金額(円)
日本	第41回東日本高速道路	0.005	2019/6/20	特殊債券	100,000	99.978	99,978,000
日本	第16回フランス相互信用 連合銀行円貨社債(2015)	0.269	2018/10/15	社債券	100,000	100.099	100,099,000
日本	第1回バンコ・サンタン デール・エセ・アー非上 位円貨社債(2017)	0.568	2023/1/11	社債券	100,000	100.063	100,063,000
日本	第9回モルガン・スタン レー円貨社債(2014)	0.557	2018/5/22	社債券	100,000	100.139	100,139,000
日本	第19回ルノー円貨社債 (2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	100.232	100,232,000
日本	第1回ソシエテ・ジェネ ラル非上位円貨社債 (2017)	0.448	2022/5/26	社債券	100,000	100.442	100,442,000
日本	第237回四国電力社債 (一般担保付)	2.05	2018/11/22	社債券	100,000	101.654	101,654,000
日本	第316回北海道電力	1.164	2020/6/25	社債券	100,000	102.503	102,503,000
日本	第5回ヤフー(社債間限 定同順位特約付)	0.2	2022/12/7	社債券	100,000	99.837	99,837,000
日本	第4回富士フイルムホー ルディングス(社債間限 定同順位特約付)	0.005	2020/3/3	社債券	100,000	99.808	99,808,000
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	100.043	100,043,000
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	100.072	100,072,000

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	99.993	99,993,000
日本	第66回クレディセゾン(社 債間限定同順位特約付)	0.09	2020/12/22	社債券	100,000	99.904	99,904,000
日本	第7回あおぞら銀行(社債 間限定同順位特約付)	0.08	2019/9/9	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	104.01	104,010,000
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	103.917	103,917,000
日本	第8回三井住友信託銀行 (社債間限定同順位特約 付)	0.234	2019/7/22	社債券	100,000	100.279	100,279,000
日本	第23回三井住友銀行(劣後 特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	104.036	104,036,000
日本	第38回日産フィナンシャ ルサービス(社債間限定同 順位特約付)	0.001	2019/6/20	社債券	100,000	99.726	99,726,000
日本	第67回アコム(特定社債間 限定同順位特約付)	0.5	2019/6/6	社債券	100,000	100.221	100,221,000
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	99.905	99,905,000
日本	第43回野村ホールディン グス	0.454	2019/2/25	社債券	100,000	100.377	100,377,000
合 計					2,300,000		2,317,179,000

## 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・ニューワールド・ファンドF（米ドル売り円買い）

平成30年 6月29日現在

資産総額	896,175,611円
負債総額	888,820円
純資産総額（ - ）	895,286,791円
発行済口数	931,456,552口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9612円

（参考）キャピタル・ニューワールド・マザーファンド（米ドル売り円買い）

平成30年 6月29日現在

資産総額	15,663,551,999円
負債総額	1,000,000円
純資産総額（ - ）	15,662,551,999円
発行済口数	14,756,312,360口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0614円

（参考）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

平成30年1月24日現在

資産総額	161,076,486円
負債総額	112,189円
純資産総額（ - ）	160,964,297円
発行済口数	152,692,019口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0542円



### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

<訂正前>

##### (1) 資本金の額（2017年12月29日現在）

（中略）

過去5年間における資本金の額の増減

2013年4月 資本金の額9,000万円から5億9,000万円に増資

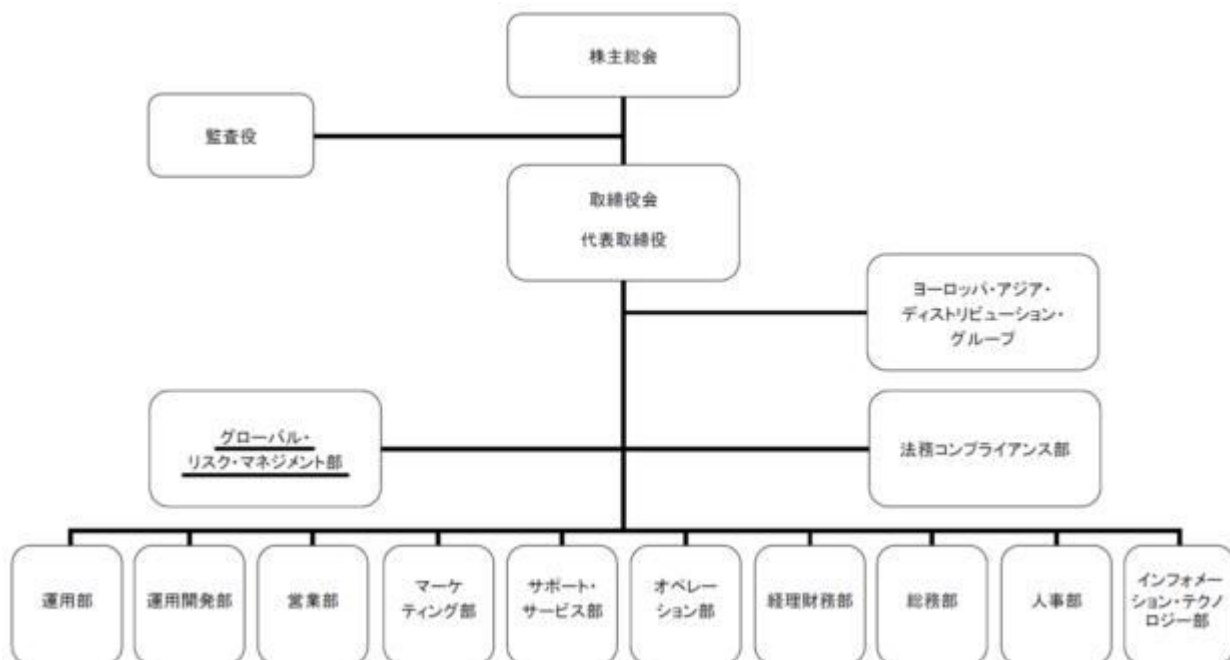
2013年4月 資本金の額5億9,000万円から4億5,000万円に減資

2013年12月 資本金の額4億5,000万円から9億5,000万円に増資

2013年12月 資本金の額9億5,000万円から4億5,000万円に減資

##### (2) 会社の機構（2017年12月29日現在）

（中略）



（以下略）

<訂正後>

##### (1) 資本金の額（2018年6月29日現在）

（中略）

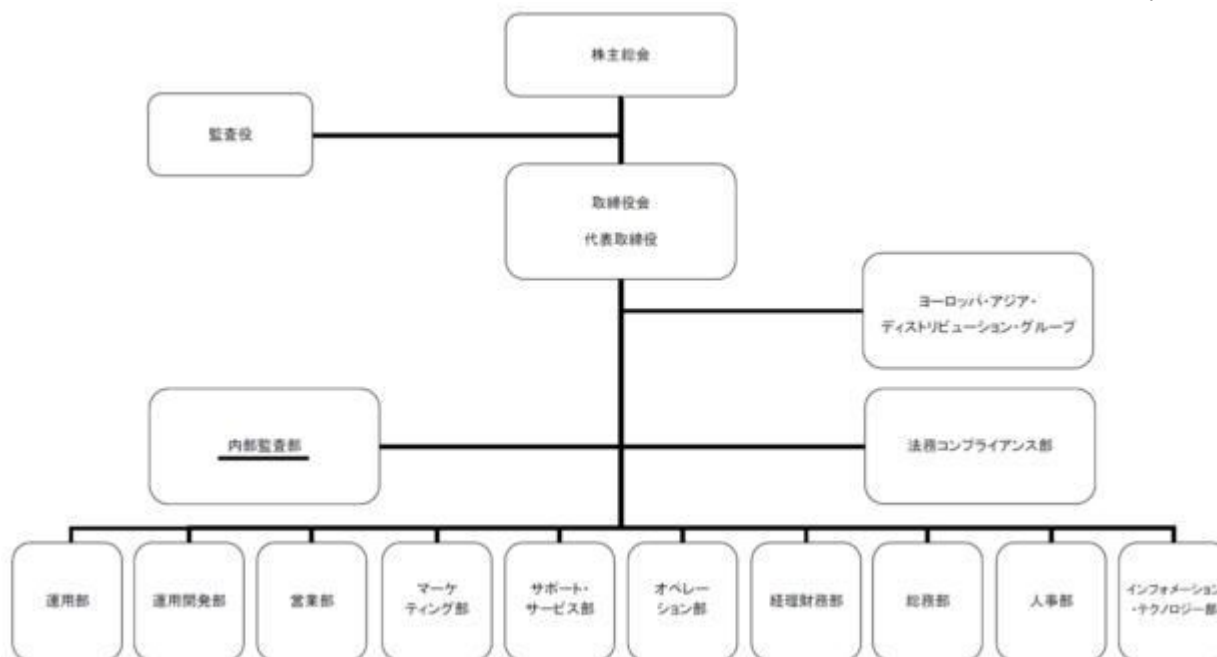
過去5年間における資本金の額の増減

2013年12月 資本金の額4億5,000万円から9億5,000万円に増資

2013年12月 資本金の額9億5,000万円から4億5,000万円に減資

##### (2) 会社の機構（2018年6月29日現在）

（中略）



(以下略)

## 2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

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

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

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

<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2018年6月29日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	24	466,187
合計	24	466,187

## 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28年7月1日 至平成29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(自平成28年7月1日 至平成29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(自平成29年7月1日 至平成29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

(平成29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			951,621
2. 証券会社預け金			1,191,615
3. 前払費用			49,043
4. 未収入金			635,047

5.未収委託者報酬			1,385,367
6.未収運用受託報酬			1,016,466
7.繰延税金資産			232,029
8.立替金			6,592
流動資産計			5,467,784
.固定資産			
1.有形固定資産			75,471
器具備品	*1	75,471	
2.無形固定資産			2,921
ソフトウェア		2,921	
3.投資その他の資産			295,550
(1)保険積立金		11,087	
(2)長期差入保証金		274,005	
(3)繰延税金資産		10,458	
固定資産計			373,943
資産合計			5,841,727
(負債の部)			
.流動負債			
1.預り金			15,528
2.未払金			1,420,485
(1)未払手数料		889,313	
(2)その他未払金		531,171	
3.未払費用			77,331
4.未払法人税等			71,918
5.未払消費税等	*2		84,350
6.賞与引当金			367,571
7.役員賞与引当金			1,071
流動負債計			2,038,258
.固定負債			
1.退職給付引当金			1,295,396
2.資産除去債務			245,266
固定負債計			1,540,662
負債合計			3,578,920
(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			1,230,070
その他利益剰余金		1,230,070	
繰越利益剰余金		1,230,070	
株主資本計			2,262,806
純資産合計			2,262,806
負債・純資産合計			5,841,727

## (2) 中間損益計算書

当中間会計期間

(自 平成29年 7月 1日 至 平成29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			1,979,926
2. 運用受託報酬			936,133
3. その他営業収益	*2		2,935,159
営業収益計			5,851,219
. 営業費用			
1. 支払手数料	*2		3,754,222
2. 広告宣伝費			39,756
3. 調査費			99,281
4. 営業雑経費			20,018
(1) 通信費		10,248	
(2) 印刷費		4,499	
(3) 協会費		5,270	
営業費用計			3,913,279
. 一般管理費			
1. 給料			1,149,229
(1) 役員報酬		27,902	
(2) 給料・手当		492,935	
(3) 賞与		392,363	
(4) 賞与引当金繰入額		234,956	
(5) 役員賞与引当金繰入額		1,071	
2. 交際費			5,349
3. 寄付金			950
4. 旅費交通費			53,226
5. 租税公課			18,725
6. 不動産賃借料			156,690
7. 退職給付費用			77,230
8. 固定資産減価償却費	*1		8,094
9. 器具備品賃借料			2,391
10. 消耗品費			9,528
11. 事務委託費			36,461
12. 採用費			8,589
13. 福利厚生費			98,573
14. 共通発生経費負担額	*3		61,281
15. 諸経費			4,021
一般管理費計			1,690,343
営業利益			247,596
. 営業外収益			
1. 受取利息及び配当金			6,741
2. 雑収入			91
営業外収益計			6,832
. 営業外費用			
1. 為替差損			3,306
2. 有価証券売却損			0
3. 固定資産除却損			3,251
営業外費用計			6,559
経常利益			247,870

税引前中間純利益			247,870
法人税、住民税及び事業税			55,193
法人税等調整額			40,276
中間純利益			232,952

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自平成29年7月1日 至平成29年12月31日)

(単位:千円)

	株主資本						純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計	
		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	997,117	997,117	2,029,854	2,029,854
当中間期変動額							
中間純利益				232,952	232,952	232,952	232,952
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	-	-	-	232,952	232,952	232,952	232,952
当中間期末残高	450,000	582,736	582,736	1,230,070	1,230,070	2,262,806	2,262,806

## [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 (平成29年12月31日現在)	
*1. 有形固定資産の減価償却累計額	30,981 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 (自平成29年7月1日 至平成29年12月31日)	
*1. 減価償却実施額	
有形固定資産	7,471 千円
無形固定資産	623 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「CRMC社」という。）との役務提供契約に基づき、当社の最終の親会社で あるキャピタル・グループ・カンパニーズ・インクの各グループ会社（以下「各グループ会社」 という。）との間で各種投資運用サービスを相互に提供しております。	
当社の主要な事業は、当社が各グループ会社に対して提供している各種投資運用サービス（市 場調査業務、投資運用関連業務、マーケティング業務、顧客リレーションサポート業務など）で あり、当該サービスに係る対価は、営業費用及び一般管理費の合計額から一定の支払手数料を差 引いた金額を基準に一定の利益率を加味して算定し、その他営業収益に計上しております。	
当社が各グループ会社から提供を受けている各種投資運用サービスは、市場調査業務、投資運 用関連業務、ITサービスなどであり、当該サービスに係る対価は、当社の委託者報酬及び運用受 託報酬を基準に算定し、支払手数料に含めて計上しております。	
*3. 共通発生経費負担額は、各グループ会社の利益規模に応じて負担しております。	

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自平成29年7月1日 至平成29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

(自平成29年7月1日 至平成29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 238,796 千円

1年超 - 千円

合計 238,796 千円

## [金融商品関係]

## 当中間会計期間

(自平成29年7月1日 至平成29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	274,005	274,727	722

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、平成29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、証券会社預け金、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)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り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。



## [デリバティブ取引関係]

当中間会計期間

(自平成29年7月1日 至平成29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

(平成29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	243,467 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	245,266 千円

## [セグメント情報等]

当中間会計期間

(自平成29年7月1日 至平成29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
2,820,581千円	2,935,159千円	95,478千円	5,851,219千円

(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	2,935,159千円

## [1株当たり情報]

当中間会計期間

(自平成29年7月1日 至平成29年12月31日)

1株当たり純資産額	40,120.69	円
1株当たり中間純利益金額	4,130.37	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	232,952	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	232,952	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（2017年9月30日現在）

（中略）

#### （2）販売会社

名称：みずほ証券株式会社

資本金の額：125,167百万円（2017年9月30日現在）

（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（2017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（2018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（2018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（2018年3月31日現在）

（以下略）

# 独立監査人の中間監査報告書

平成30年7月17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・ニューワールド・ファンドF（米ドル売り円買い）の平成29年11月21日から平成30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・ニューワールド・ファンドF（米ドル売り円買い）の平成30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（平成29年11月21日から平成30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

- 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。
- 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

平成30年3月19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平成29年7月1日から平成30年6月30日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成29年7月1日から平成29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、分析的な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平成29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（平成29年7月1日から平成29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。