

【表紙】

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

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

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

2【訂正の内容】

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(3)【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

(前略)

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。2019年2月14日現在、その他のベビーファンドは次のとおりです。

(中略)

委託会社の概況 (2018年12月28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。2019年8月16日現在、その他のベビーファンドは次のとおりです。

(中略)

委託会社の概況 (2019年6月28日現在)

(以下略)

2【投資方針】

(2)【投資対象】

< 訂正前 >

(前略)

< 参考情報 2 > 投資対象ファンドの概要等

(中略)

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

(中略)

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

< 訂正後 >

(前略)

< 参考情報 2 > 投資対象ファンドの概要等

(中略)

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

(中略)

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

(3) 【運用体制】

<訂正前>

(前略)

内部管理体制

(中略)

(参考情報)

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

運用部(3名)/法務コンプライアンス部(2名)/オペレーション部(8名)

()は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

(中略)

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

<訂正後>

(前略)

内部管理体制

(中略)

(参考情報)

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

運用部(3名)/法務コンプライアンス部(3名)/オペレーション部(6名)

()は、各部において、当ファンドにかかる業務に従事する人数を示します。

(中略)

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

3 【投資リスク】

<訂正前>

(前略)

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

<訂正後>

(前略)

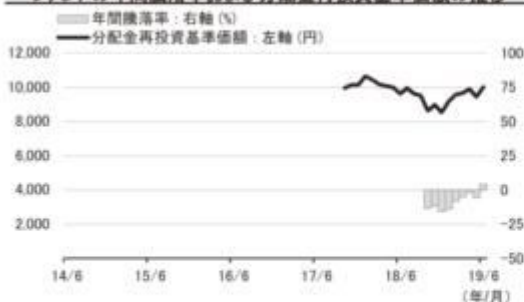
上記は2019年6月28日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

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

<更新・訂正後>

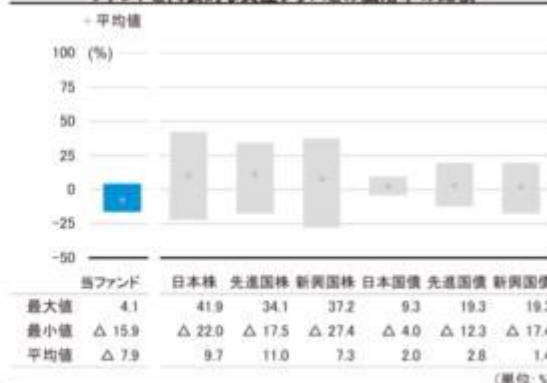
リスクの定量的比較

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



(注1) 年間騰落率は、2018年10月から2019年6月までの各月末における1年間の騰落率を表示したもので、分配金再投資基準価額を基に算出しています。
 (注2) 分配金再投資基準価額は、設定日(2017年10月17日)を10,000として指数化しています。
 (注3) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

<各資産クラスの指数>

日本株・・・TOPIX(配当込み)

先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(税引前配当再投資/円ベース)

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

日本国債・・・NOMURA-BPI国債

先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本/円ベース)

新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

※ 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

「ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数について

「日本株」の資産クラスはTOPIX(配当込み)を表示しております。

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

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

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

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

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

「日本国債」の資産クラスはNOMURA-BPI国債を表示しております。

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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

信託報酬の総額(消費税等相当額を含みます。)は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対して年率0.8424%(税抜0.78%)の信託報酬率を乗じて得た額とします。

(中略)

<投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担>

信託報酬	年率0.8424%（税抜0.78%）
投資対象とする外国投資信託の信託報酬（*1）	年率0.00%
投資対象とする国内投資信託の信託報酬（*2）	年率0.007%程度
実質的な負担（*3）	年率0.8494%程度（税込）

（中略）

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

（以下略）

<訂正後>

信託報酬の総額（消費税等相当額を含みます。）は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対して年率0.8424%¹（税抜0.78%）の信託報酬率を乗じて得た額とします。

（中略）

<投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担>

信託報酬	年率0.8424% ¹ （税抜0.78%）
投資対象とする外国投資信託の信託報酬（*1）	年率0.00%
投資対象とする国内投資信託の信託報酬（*2）	年率0.007%程度
実質的な負担（*3）	年率0.8494%程度（税込）²

1 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、**年率0.858%**となります。

2 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、**年率0.865%程度（税込）**となります。

（中略）

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

（以下略）

（5）【課税上の取扱い】

<訂正前>

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

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、2019年6月28日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご留意ください。

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）

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)

2019年6月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,007,289,316	100.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		804,257	0.07
合計(純資産総額)		1,006,485,059	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)

2019年6月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	2,285,466	0.04
投資証券	ルクセンブルク	5,674,568,817	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0	0.00
合計(純資産総額)		5,676,854,283	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)

2019年6月28日現在

資産の種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
	米国	9,195,400,210	18.26
	中国	6,968,360,269	13.83
	インド	4,324,673,621	8.59
	ブラジル	4,091,691,767	8.12
	フランス	2,422,499,998	4.81
	日本	2,365,560,230	4.70
	香港	2,205,113,353	4.38
	英国	1,826,760,423	3.63
	スイス	1,181,316,702	2.35
	韓国	991,122,731	1.97
	ロシア	963,536,796	1.91
	台湾	935,988,155	1.86
	南アフリカ	876,275,563	1.74
	ドイツ	788,109,623	1.56
	カナダ	737,701,508	1.46

株式	フィリピン	692,143,677	1.37
	オランダ	533,882,583	1.06
	オーストラリア	508,358,054	1.01
	デンマーク	469,493,922	0.93
	スペイン	415,449,181	0.82
	メキシコ	356,867,925	0.71
	インドネシア	330,509,854	0.66
	イタリア	219,150,554	0.44
	ギリシャ	189,575,676	0.38
	トルコ	186,087,225	0.37
	タイ	170,903,832	0.34
	アルゼンチン	147,017,999	0.29
	ベルギー	67,280,829	0.13
	ベトナム	64,469,799	0.13
	ニュージーランド	63,039,749	0.13
	ノルウェー	60,459,226	0.12
	マレーシア	56,143,909	0.11
	ペルー	50,887,475	0.10
	アラブ首長国連邦	49,806,438	0.10
	イスラエル	49,066,854	0.10
	スウェーデン	45,326,428	0.09
	ハンガリー	41,098,896	0.08
	オーストリア	11,347,142	0.02
債券	アルゼンチン	184,998,577	0.37
	ドミニカ共和国	118,700,113	0.24
	インドネシア	118,244,227	0.23
	エジプト	113,138,647	0.22
	ウクライナ	110,033,808	0.22
	メキシコ	95,909,551	0.19
	ナイジェリア	92,277,456	0.18
	トルコ	90,602,524	0.18
	ルーマニア	80,690,226	0.16
	ペルー	76,033,465	0.15
	ケニア	68,125,547	0.14
	ブラジル	60,456,575	0.12
	オマーン	60,328,158	0.12
	ロシア	59,747,359	0.12
	エチオピア	51,721,179	0.10
	パラグアイ	44,794,394	0.09
	ヨルダン	44,291,780	0.09
	パキスタン	40,970,666	0.08
	カタール	39,784,026	0.08
	イラク	38,103,457	0.08
	コートジボワール	37,925,146	0.08
	スリランカ	37,580,115	0.07
	ベネズエラ	37,398,302	0.07
	カザフスタン	35,967,746	0.07
	中国	34,018,670	0.07
	コロンビア	34,003,013	0.07
	サウジアラビア	33,232,313	0.07
ホンジュラス	27,903,206	0.06	

イタリア	27,326,094	0.05
セネガル	26,387,710	0.05
カメルーン	23,414,119	0.05
パナマ	23,082,926	0.05
ルクセンブルク	22,854,767	0.05
ガボン	21,542,433	0.04
チュニジア	18,327,028	0.04
南アフリカ	9,767,207	0.02
銀行預金、その他資産（負債控除後）	3,678,162,097	7.30
純資産総額	50,370,322,802	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

2019年1月23日現在

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

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

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

キャピタル・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

2019年6月28日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	キャピタル・ニューワールド・マ ザーファンド（米ドル売り円買 い）	902,750,777	0.9873	891,285,843	1.1158	1,007,289,316	100.07

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

b. 種類別投資比率

2019年6月28日現在

種類	投資比率（％）
----	---------

親投資信託受益証券	100.07
合計	100.07

（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

2019年6月28日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ルクセンブルク	投資証券	キャピタル・グループ・ニューワールド・ファンド（LUX） （クラスCh-JPY）	4,059,062.1	1,305.94	5,300,924,485	1,398	5,674,568,817	99.95
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	1.0545	2,284,816	1.0548	2,285,466	0.04

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

b. 種類別投資比率

2019年6月28日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	0.04
投資証券	99.95
合計	100.00

（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

2019年6月28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	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド エネルギー	461,142	1,274.15 インド・ルピー	916,786,256	1.82
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ADR	中国 一般消費財・サービス	47,957	170.90 米ドル	883,307,874	1.75
3	AIA GROUP LTD	香港 金融	722,637	84.20 香港ドル	839,087,868	1.67
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO	台湾 情報技術	952,670	240.50 台湾ドル	794,437,359	1.58
5	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	インド 金融	332,613	1,481.60 インド・ルピー	768,923,342	1.53
6	HDFC BANK LTD	インド 金融	198,264	2,462.30 インド・ルピー	761,724,081	1.51
7	MICROSOFT CORP	米国 情報技術	52,211	134.15 米ドル	754,867,486	1.50
8	TENCENT HOLDINGS LTD	中国 コミュニケーション・サービス	151,615	352.80 香港ドル	737,642,453	1.46

9	MASTERCARD INC CL A	米国 情報技術	23,136	261.10 米ドル	651,048,255	1.29
10	AIRBUS SE	フランス 資本財・サービス	36,249	123.88 ユーロ	550,221,457	1.09
11	ALPHABET INC CL C	米国 コミュニケーション・サー ビス	4,741	1,076.01 米ドル	549,799,442	1.09
12	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	中国 公益事業	518,000	74.95 香港ドル	535,397,765	1.06
13	FACEBOOK INC CL A	米国 コミュニケーション・サー ビス	25,475	189.50 米ドル	520,285,160	1.03
14	PAGSEGURO DIGITAL LTD CL A	ブラジル 情報技術	122,215	37.64 米ドル	495,783,602	0.98
15	BROADCOM INC	米国 情報技術	14,594	285.71 米ドル	449,384,216	0.89
16	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD COM	韓国 情報技術	103,543	46,500.00 韓国ウォン	448,031,107	0.89
17	NESTLE SA	スイス 生活必需品	39,704	100.56 スイス・フラン	440,684,270	0.87
18	PETROLEO BRASILEIRO ON ADR (PETROBRAS)	ブラジル エネルギー	252,246	15.54 米ドル	422,467,529	0.84
19	MERCADOLIBRE INC	米国 一般消費財・サービス	6,340	610.67 米ドル	417,266,842	0.83
20	CHINA GAS HOLDINGS LTD	中国 公益事業	1,004,967	29.75 香港ドル	412,300,563	0.82
21	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	フランス 一般消費財・サービス	9,051	368.35 ユーロ	408,505,149	0.81
22	NASPERS LIMITED N	南アフリカ 一般消費財・サービス	15,724	3,369.65 南アフリカ・ラ ンド	402,742,921	0.80
23	MICRON TECHNOLOGY INC	米国 情報技術	95,599	38.07 米ドル	392,242,147	0.78
24	SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD A (SSE NORTH)	中国 資本財・サービス	305,864	81.27 中国元	389,562,936	0.77
25	KEYENCE CORP	日本 情報技術	5,800	66,030.00 日本円	382,974,000	0.76
26	SBERBANK OF RUSSIA PJSC ADR (PK SHEETS)	ロシア 金融	223,836	15.48 米ドル	373,438,357	0.74
27	JBS SA ON	ブラジル 生活必需品	622,221	21.09 ブラジル・レア ル	369,026,124	0.73
28	INTL CONTAINER TERMINAL SERVICES INC	フィリピン 資本財・サービス	1,188,770	146.90 フィリピン・ペ ソ	367,019,929	0.73

29	ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD	インド 資本財・サービス	544,121	406.50 インド・ルピー	345,119,019	0.69
30	MEITUAN-DIANPING B	中国 一般消費財・サービス	344,048	68.50 香港ドル	325,001,051	0.65

(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

2019年1月23日現在

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	
日本	第4回クレディ・ア グリコル・エス・ エー円貨社債 (2014)	0.425	2019/11/28	社債券	100,000	100.208	100,208,000	5.39
日本	第19回ルノー円貨社 債(2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	99.503	99,503,000	5.35
日本	第11回ウエストパッ ク・バンキング・ コーポレーション円 貨社債(2016)	0.3	2021/1/22	社債券	100,000	100.213	100,213,000	5.39
日本	第3回ソシエテ・ ジェネラル非上位円 貨社債(2018)	0.804	2023/10/12	社債券	100,000	98.616	98,616,000	5.30
日本	第488回中部電力	1.562	2019/2/25	社債券	100,000	100.127	100,127,000	5.38
日本	第521回関西電力	0.18	2023/9/20	社債券	100,000	99.863	99,863,000	5.37
日本	第4回富士フィルム ホールディングス (社債間限定同順位 特約付)	0.005	2020/3/3	社債券	100,000	99.949	99,949,000	5.37
日本	第50回日本電気(社 債間限定同順位特約 付)	0.29	2022/6/15	社債券	100,000	100.151	100,151,000	5.38
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	100.277	100,277,000	5.39
日本	第1回三井住友トラ スト・パナソニック ファイナンス(社債 間限定同順位特約 付)	0.12	2020/10/30	社債券	100,000	100.148	100,148,000	5.38
日本	第22回あおぞら銀行 (社債間限定同順位 特約付)	0.1	2021/12/10	社債券	100,000	99.968	99,968,000	5.37
日本	第28回三菱東京UF J銀行(劣後特約 付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	102.834	102,834,000	5.53

日本	第6回りそな銀行 (劣後特約付)	2.084	2020/3/4	社債券	100,000	102.197	102,197,000	5.49
日本	第23回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	102.859	102,859,000	5.53
日本	第22回東京センチュ リーリース(社債間 限定同順位特約付)	0.06	2021/4/13	社債券	100,000	99.898	99,898,000	5.37
日本	第75回アコム(特定 社債間限定同順位特 約付)	0.309	2023/2/28	社債券	100,000	99.826	99,826,000	5.37
日本	第69回日立キャピタ ル(社債間限定同順 位特約付)	0.08	2020/12/18	社債券	100,000	100.026	100,026,000	5.38
日本	第33回三菱UFJ リース(社債間限定 同順位特約付)	0.297	2020/6/4	社債券	100,000	100.321	100,321,000	5.39

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

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

【投資不動産物件】

キャピタル・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	(2017年11月20日)	100,812	100,812	1.0081	1.0081
第2期	(2018年11月20日)	958,697,622	958,697,622	0.8844	0.8844
	2018年 6月末日	895,286,791		0.9612	
	7月末日	1,006,920,607		0.9941	
	8月末日	965,120,984		0.9631	
	9月末日	998,339,279		0.9499	
	10月末日	921,398,081		0.8619	
	11月末日	968,810,284		0.8965	
	12月末日	927,247,929		0.8528	
	2019年 1月末日	983,930,958		0.9175	
	2月末日	1,022,014,052		0.9570	
	3月末日	939,087,304		0.9664	
	4月末日	945,647,745		0.9894	
	5月末日	902,924,963		0.9441	
	6月末日	1,006,485,059		1.0009	

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

【収益率の推移】

キャピタル・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	2017年10月17日～2017年11月20日	0.8
第2期	2017年11月21日～2018年11月20日	12.3
第3中間計算期間末	2018年11月21日～2019年 5月20日	7.8

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

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

（４）【設定及び解約の実績】

キャピタル・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	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	1,181,350,611	97,486,705	1,083,963,906
第3中間計算期間末	2018年11月21日～2019年5月20日	51,328,202	181,216,393	954,075,715

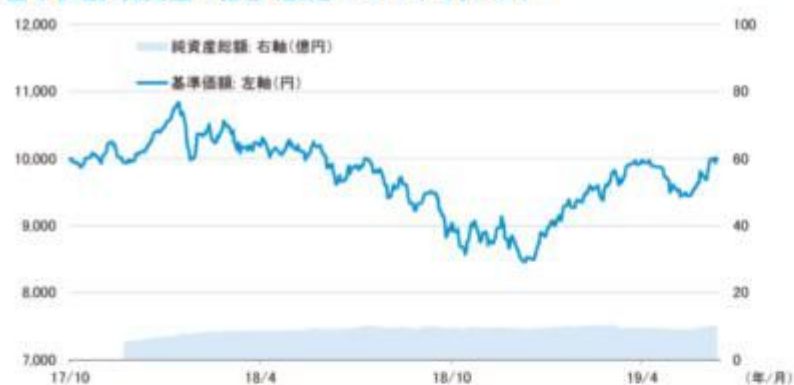
(注)第1期の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

参考情報

2019年6月28日現在

基準価額・純資産の推移(設定～2019年6月28日)



分配金の推移

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

分配金は1万円当たり、税引前

主要な資産の状況(2019年6月28日現在)

<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>

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C)-JPY)	99.95
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.04

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

(2019年6月28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	RELIANCE INDUSTRIES	インド	エネルギー	1.82
2	ALIBABA GROUP	中国	一般消費財・サービス	1.75
3	TSMC	台湾	情報技術	1.72
4	AIA GROUP	香港	金融	1.67
5	HDFC BANK	インド	金融	1.62
6	KOTAK MAHINDRA BANK	インド	金融	1.53
7	MICROSOFT	米国	情報技術	1.50
8	TENCENT	中国	コミュニケーション・サービス	1.46
9	ALPHABET	米国	コミュニケーション・サービス	1.41
10	MASTERCARD INC	米国	情報技術	1.29

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、

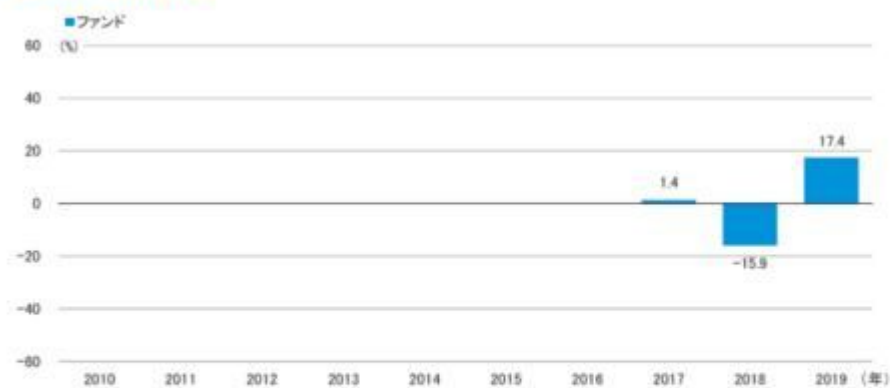
それらを合算して算出した投資比率を表示しております。

資産別構成比率	
資産の種類	投資比率(%)
株式	88.65
債券	4.05
現金・その他	7.30

国別構成比率	
国名	投資比率(%)
米国	18.26
中国	13.90
インド	8.59
ブラジル	8.24
フランス	4.81
その他国	38.90
現金・その他	7.30

通貨別構成比率	
通貨名	投資比率(%)
米ドル	32.53
香港ドル	11.38
ユーロ	9.45
インド・ルピー	8.05
日本円	4.70
その他通貨	33.90

年間収益率の推移



ファンドにはベンチマークはありません。

ファンドの年間収益率は、税引前分配金を再投資したものと算出。

2017年は設定日から年末までの収益率を表示。2019年は6月末までの収益率を表示。

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

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

第3【ファンドの経理状況】

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

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

【中間財務諸表】

【キャピタル・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2期 2018年11月20日現在	第3期中間計算期間 2019年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,695,908	5,268,810
親投資信託受益証券	958,257,107	908,858,418
流動資産合計	962,953,015	914,127,228
資産合計	962,953,015	914,127,228
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	103,001	103,520
未払委託者報酬	3,914,010	3,933,656
未払利息	12	15
その他未払費用	238,370	239,572
流動負債合計	4,255,393	4,276,763
負債合計	4,255,393	4,276,763
純資産の部		
元本等		
元本	1,083,963,906	954,075,715
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	125,266,284	44,225,250
元本等合計	958,697,622	909,850,465
純資産合計	958,697,622	909,850,465
負債純資産合計	962,953,015	914,127,228

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	第2期中間計算期間 自 2017年11月21日 至 2018年5月20日	第3期中間計算期間 自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	11,393,494	81,766,311
営業収益合計	11,393,494	81,766,311
営業費用		
支払利息	12,272	1,516
受託者報酬	74,809	103,520
委託者報酬	2,842,622	3,933,656
その他費用	173,254	239,572
営業費用合計	3,102,957	4,278,264
営業利益又は営業損失()	8,290,537	77,488,047
経常利益又は経常損失()	8,290,537	77,488,047
中間純利益又は中間純損失()	8,290,537	77,488,047
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	14,047,385
期首剰余金又は期首欠損金()	812	125,266,284
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,523,949	20,808,491
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	20,808,491
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	3,208,119
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	-	3,208,119
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	15,412,493	44,225,250

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年11月20日現在	第3期中間計算期間 2019年5月20日現在
1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 1,083,963,906口	1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数 954,075,715口
2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損 125,266,284円	2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損 44,225,250円
3. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.8844円 (1万口当たり純資産額) (8,844円)	3. 当該中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9536円 (1万口当たり純資産額) (9,536円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

当ファンドの中間計算期間における元本額の変動

項目	第2期	第3期中間計算期間
	自 2017年11月21日 至 2018年11月20日	自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
期首元本額	100,000円	1,083,963,906円
期中追加設定元本額	1,181,350,611円	51,328,202円
期中一部解約元本額	97,486,705円	181,216,393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)

2019年5月20日現在

資産の部	
流動資産	
投資信託受益証券	2,283,300
投資証券	6,184,999,031
未収入金	11,000,000
流動資産合計	6,198,282,331
資産合計	6,198,282,331
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,000,000
流動負債合計	8,000,000
負債合計	8,000,000
純資産の部	
元本等	
元本	5,826,832,598
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	363,449,733
元本等合計	6,190,282,331
純資産合計	6,190,282,331
負債純資産合計	6,198,282,331

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
-----------------	----------

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2019年5月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数		5,826,832,598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	1.0624円
	(1万口当たり純資産額)	(10,624円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	自 2018年11月21日 至 2019年5月20日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) 投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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つた場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

項目	2019年5月20日現在
同計算期間の期首元本額	9,231,802,301円
同計算期間の追加設定元本額	33,887,907円
同計算期間の一部解約元本額	3,438,857,610円
計算日の元本額	5,826,832,598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）	4,971,355,924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）	855,476,674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、2018年12月31日付けで、ルクセンブルクにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務書類が作成されております。この財務書類は独立監査人であるプライスウォーターハウスクーパーズ・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・ニューワールド・ファンド（LUX）

投資明細表

2018年12月31日現在

投資銘柄	通貨	数量/額面	評価額 (USD)	投資比率 (%)
公的な市場に上場している譲渡可能な有価証券と短期金融商品 債券				
<i>Argentina</i>				
Argentina Government Bond 8.28% 31/12/2033	USD	221,522	173,895	0.02
Argentina Government Bond, FRN 0% 15/12/2035	USD	2,320,000	98,832	0.01
Argentina Treasury Bill 0% 29/03/2019	ARS	1,856,507	55,582	0.01
Argentina Treasury Bill 0% 30/04/2019	ARS	25,904,030	780,698	0.12
Argentina Treasury Bill 0% 31/05/2019	ARS	13,989,100	411,893	0.06
Argentina Treasury Bill 0% 31/10/2019	ARS	23,688,628	715,817	0.11
Autonomous City of Buenos Aires Argentina, FRN 55.594% 22/02/2028	ARS	3,068,000	70,073	0.01
Autonomous City of Buenos Aires Argentina, Reg. S 8.95% 19/02/2021	USD	1,245,000	1,243,382	0.19
YPF SA, 144A 8.5% 28/07/2025	USD	510,000	459,637	0.07
			4,009,809	0.60
<i>Bahrain</i>				
Bahrain Government Bond, 144A 6.75% 20/09/2029	USD	315,000	309,468	0.05
			309,468	0.05

<i>Brazil</i>					
Brazil Government Bond 5.625% 21/02/2047	USD	520,000	492,250	0.07	
Brazil Notas do Tesouro Nacional 6% 15/05/2045	BRL	40,000	373,291	0.06	
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2025	BRL	416,000	112,181	0.02	
Cemig Geracao e Transmissao SA, 144A 9.25% 05/12/2024	USD	700,000	747,600	0.11	
Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/05/2026	USD	525,000	589,838	0.09	
			2,315,160	0.35	
<i>China</i>					
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd., Reg. S 3.5% 04/05/2027	USD	305,000	294,281	0.04	
			294,281	0.04	
<i>Colombia</i>					
Colombia Government Bond 4.5% 28/01/2026	USD	410,000	410,769	0.06	
Colombian TES 10% 24/07/2024	COP	130,000,000	47,192	0.01	
			457,961	0.07	
<i>Dominican Republic</i>					
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 5.875% 18/04/2024	USD	100,000	101,521	0.01	
Dominican Republic Government Bond, 144A 5.5% 27/01/2025	USD	310,000	308,063	0.05	
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.875% 29/01/2026	USD	100,000	105,125	0.02	
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 11.25% 05/02/2027	DOP	10,600,000	218,206	0.03	
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 7.45% 30/04/2044	USD	465,000	484,762	0.07	
			1,217,677	0.18	
<i>Egypt</i>					
Egypt Government Bond 14.8% 30/01/2023	EGP	2,510,000	126,117	0.02	
Egypt Government Bond, Reg. S 8.5% 31/01/2047	USD	605,000	548,155	0.08	
			674,272	0.10	
<i>Greece</i>					
Greece Government Bond, Reg. S 4.2% 30/01/2042	EUR	109,006	109,928	0.02	
			109,928	0.02	
<i>Guatemala</i>					
Guatemala Government Bond, Reg. S 4.375% 05/06/2027	USD	555,000	513,375	0.08	
Guatemala Government Bond, Reg. S 4.5% 03/05/2026	USD	370,000	348,263	0.05	
			861,638	0.13	
<i>Honduras</i>					
Honduras Government Bond, Reg. S 6.25% 19/01/2027	USD	240,000	238,224	0.04	
			238,224	0.04	
<i>India</i>					
HDFC Bank Ltd., Reg. S 8.1% 22/03/2025	INR	20,000,000	273,069	0.04	
			273,069	0.04	
<i>Indonesia</i>					
Indonesia Government Bond, Reg. S 4.35% 08/01/2027	USD	400,000	396,224	0.06	
Indonesia Government Bond, Reg. S 3.375% 15/04/2023	USD	280,000	271,414	0.04	
Indonesia Government Bond, Reg. S 4.125% 15/01/2025	USD	680,000	670,775	0.10	
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 144A 4.35% 10/09/2024	USD	240,000	239,100	0.04	
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, Reg. S 4.55% 29/03/2026	USD	755,000	750,470	0.11	
			2,327,983	0.35	
<i>Iraq</i>					
Iraq Government Bond, Reg. S 6.752% 09/03/2023	USD	345,000	329,440	0.05	

			329,440	0.05
<i>Italy</i>				
UniCredit SpA, Reg. S, FRN 5.375% Perpetual	EUR	200,000	193,193	0.03
UniCredit SpA, Reg. S, FRN 6.625% Perpetual	EUR	425,000	459,431	0.07
			652,624	0.10
<i>Ivory Coast</i>				
Ivory Coast Government Bond, 144A 5.25% 22/03/2030	EUR	350,000	354,637	0.05
Ivory Coast Government Bond, STEP, Reg. S 5.75% 31/12/2032	USD	277,500	245,676	0.04
			600,313	0.09
<i>Jordan</i>				
Jordan Government Bond, 144A 5.75% 31/01/2027	USD	405,000	372,938	0.06
			372,938	0.06
<i>Kazakhstan</i>				
Kazakhstan Government Bond, Reg. S 5.125% 21/07/2025	USD	295,000	312,640	0.05
			312,640	0.05
<i>Kenya</i>				
Kenya Government Bond, Reg. S 6.875% 24/06/2024	USD	1,085,000	1,022,585	0.15
			1,022,585	0.15
<i>Mexico</i>				
Mexican Bonos 5.75% 05/03/2026	MXN	4,830,000	207,858	0.03
Mexico Government Bond 4% 02/10/2023	USD	394,000	392,655	0.06
Mexico Government Bond 4.15% 28/03/2027	USD	430,000	416,416	0.06
Mexico Government Bond 5.75% 12/10/2110	USD	164,000	154,775	0.03
Petroleos Mexicanos 6.75% 21/09/2047	USD	260,000	215,642	0.03
Petroleos Mexicanos, Reg. S 3.75% 21/02/2024	EUR	100,000	110,290	0.02
Petroleos Mexicanos 7.47% 12/11/2026	MXN	23,440,000	879,965	0.13
			2,377,601	0.36
<i>Morocco</i>				
Morocco Government Bond, Reg. S 4.25% 11/12/2022	USD	355,000	356,754	0.05
Morocco Government Bond, Reg. S 5.5% 11/12/2042	USD	480,000	492,482	0.08
			849,236	0.13
<i>Nigeria</i>				
Nigeria Government Bond, Reg. S 6.375% 12/07/2023	USD	275,000	264,608	0.04
			264,608	0.04
<i>Pakistan</i>				
Pakistan Government Bond, Reg. S 7.25% 15/04/2019	USD	1,280,000	1,280,000	0.19
Pakistan Government Bond, Reg. S 8.25% 15/04/2024	USD	285,000	288,209	0.05
			1,568,209	0.24
<i>Panama</i>				
Panama Government Bond 3.875% 17/03/2028	USD	475,000	469,063	0.07
			469,063	0.07
<i>Paraguay</i>				
Paraguay Government Bond, Reg. S 6.1% 11/08/2044	USD	205,000	212,431	0.03
Paraguay Government Bond, Reg. S 5% 15/04/2026	USD	705,000	714,694	0.11
			927,125	0.14
<i>Peru</i>				
Peru Government Bond 6.55% 14/03/2037	USD	65,000	82,387	0.01
Peru Government Bond 4.125% 25/08/2027	USD	90,000	93,150	0.02
			175,537	0.03
<i>Qatar</i>				

Qatar Government Bond, 144A 4.5% 23/04/2028	USD	330,000	345,247	0.05
			345,247	0.05
<i>Romania</i>				
Romania Government Bond, 144A 5.125% 15/06/2048	USD	560,000	541,106	0.08
Romania Government Bond, Reg. S 2.875% 11/03/2029	EUR	320,000	356,121	0.05
Romania Government Bond, Reg. S 5.125% 15/06/2048	USD	50,000	48,313	0.01
			945,540	0.14
<i>Russian Federation</i>				
Gazprom OAO, Reg. S 9.25% 23/04/2019	USD	325,000	329,853	0.05
Sberbank of Russia, 144A 5.25% 23/05/2023	USD	200,000	195,900	0.03
Vnesheconombank, Reg. S 6.902% 09/07/2020	USD	140,000	143,362	0.02
			669,115	0.10
<i>Saudi Arabia</i>				
Saudi Government Bond, 144A 3.625% 04/03/2028	USD	800,000	758,540	0.11
			758,540	0.11
<i>Senegal</i>				
Senegal Government Bond, 144A 4.75% 13/03/2028	EUR	415,000	438,983	0.07
			438,983	0.07
<i>South Africa</i>				
South Africa Government Bond 8% 31/01/2030	ZAR	1,500,000	94,396	0.01
South Africa Government Bond 8.75% 28/02/2048	ZAR	5,273,000	326,331	0.05
			420,727	0.06
<i>Sri Lanka</i>				
Sri Lanka Government Bond, 144A 6.2% 11/05/2027	USD	340,000	300,950	0.05
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.25% 27/07/2021	USD	310,000	299,427	0.04
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6% 14/01/2019	USD	200,000	199,500	0.03
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.825% 18/07/2026	USD	600,000	556,592	0.08
			1,356,469	0.20
<i>Turkey</i>				
Turkey Government Bond 10.7% 17/02/2021	TRY	1,200,000	196,127	0.03
Turkey Government Bond 5.625% 30/03/2021	USD	365,000	366,127	0.05
Turkey Government Bond 10.7% 17/08/2022	TRY	1,500,000	231,186	0.03
Turkey Government Bond 16.2% 14/06/2023	TRY	950,000	173,935	0.03
Turkey Government Bond 7.25% 23/12/2023	USD	315,000	324,278	0.05
Turkey Government Bond 6% 14/01/2041	USD	675,000	571,515	0.09
Turkey Government Bond 7.4% 05/02/2020	TRY	340,000	56,770	0.01
Turkey Government Bond 7.1% 08/03/2023	TRY	2,488,140	330,028	0.05
Turkey Government Bond 8.8% 27/09/2023	TRY	460,000	63,970	0.01
Turkey Government Bond 2% 18/09/2024	TRY	575,000	160,292	0.02
Turkey Government Bond 4.875% 09/10/2026	USD	670,000	595,168	0.09
			3,069,396	0.46
<i>Ukraine</i>				
Ukraine Government Bond, Reg. S 7.75% 01/09/2022	USD	575,000	529,782	0.08
Ukraine Government Bond, Reg. S 7.75% 01/09/2027	USD	310,000	263,134	0.04
Ukraine Government Bond, Reg. S 7.375% 25/09/2032	USD	330,000	263,016	0.04
			1,055,932	0.16
<i>United Arab Emirates</i>				
DP World Crescent Ltd., 144A 4.848% 26/09/2028	USD	315,000	309,176	0.05
			309,176	0.05
<i>Venezuela</i>				

Venezuela Government Bond, Reg. S 7% 01/12/2018 ²	USD	23,000		
Venezuela Government Bond, Reg. S 7.75% 13/10/2019 ²	USD	418,000	97,060	0.02
Venezuela Government Bond, Reg. S 6% 09/12/2020 ²	USD	343,000	79,319	0.01
Venezuela Government Bond, Reg. S 9% 07/05/2023 ²	USD	504,000	115,290	0.02
Venezuela Government Bond 9.25% 15/09/2027 ²	USD	62,000	14,725	
Venezuela Government Bond, Reg. S 12.75% 23/08/2022 ²	USD	30,000	7,200	
Venezuela Government Bond, Reg. S 8.25% 13/10/2024 ²	USD	107,000	25,145	
Venezuela Government Bond, Reg. S 7.65% 21/04/2025 ²	USD	46,000	10,695	
Venezuela Government Bond, Reg. S 11.75% 21/10/2026 ²	USD	23,000	5,721	
Venezuela Government Bond, Reg. S 9.25% 07/05/2028 ²	USD	116,000	26,970	0.01
Venezuela Government Bond, Reg. S 11.95% 05/08/2031 ²	USD	39,000	9,311	
Venezuela Government Bond, Reg. S 7% 31/03/2038 ²	USD	39,000	8,970	
			405,351	0.06
債券合計			32,785,865	4.94
株式				
<i>Argentina</i>				
Grupo Financiero Galicia SA, ADR	USD	24,045	662,921	0.10
Loma Negra Cia Industrial Argentina SA, ADR	USD	84,156	936,656	0.14
Pampa Energia SA, ADR	USD	15,223	484,244	0.07
			2,083,821	0.31
<i>Australia</i>				
Amcor Ltd.	AUD	34,145	318,663	0.05
CSL Ltd.	AUD	30,396	3,964,168	0.60
Oil Search Ltd.	AUD	87,563	441,593	0.06
			4,724,424	0.71
<i>Belgium</i>				
Anheuser-Busch InBev SA/NV	EUR	5,538	366,116	0.06
			366,116	0.06
<i>Brazil</i>				
Ambev SA	BRL	66,628	264,398	0.04
Azul SA, ADR	USD	60,616	1,678,457	0.25

Azul SA Preference	BRL	60,167	558,863	0.08
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	BRL	517,539	3,580,009	0.54
Banco Bradesco SA Preference	BRL	127,268	1,269,150	0.19
BB Seguridade Participacoes SA	BRL	191,676	1,364,469	0.21
BR Malls Participacoes SA	BRL	254,033	856,663	0.13
CCR SA	BRL	241,602	698,173	0.10
Equatorial Energia SA	BRL	31,082	597,942	0.09
Gerdau SA, ADR Preference	USD	222,714	837,405	0.13
Gol Linhas Aereas Inteligentes SA, ADR Preference	USD	18,884	255,878	0.04
Gol Linhas Aereas Inteligentes SA Preference	BRL	209,666	1,357,832	0.20
Hypera SA	BRL	321,162	2,502,507	0.38
IRB Brasil Resseguros S/A	BRL	69,690	1,500,697	0.23
Itau Unibanco Holding SA, ADR Preference	USD	135,184	1,235,582	0.19
Itau Unibanco Holding SA Preference	BRL	291,053	2,665,905	0.40
Itausa - Investimentos Itau SA Preference	BRL	118,914	370,633	0.06
JBS SA	BRL	2,396,485	7,166,422	1.08
Klabin SA	BRL	72,228	295,938	0.04
Lojas Americanas SA	BRL	43,238	167,675	0.02
Lojas Americanas SA Preference	BRL	103,592	526,547	0.08
Pagueseguro Digital Ltd. 'A'	USD	220,665	4,133,056	0.62
Petroleo Brasileiro SA, ADR Preference	USD	91,004	1,054,736	0.16
Petroleo Brasileiro SA, ADR	USD	419,385	5,456,199	0.82
Raia Drogasil SA	BRL	101,485	1,496,450	0.23
Rumo SA	BRL	137,037	601,078	0.09
StoneCo Ltd. 'B'	USD	101,698	1,875,311	0.28
Ultrapar Participacoes SA	BRL	46,900	643,767	0.10
Vale SA, ADR	USD	171,912	2,267,519	0.34
Vale SA	BRL	329,005	4,329,292	0.65
			51,608,553	7.77
<i>Canada</i>				
Barrick Gold Corp.	USD	23,512	318,353	0.05
CCL Industries, Inc. 'B'	CAD	8,648	317,110	0.05
First Quantum Minerals Ltd.	CAD	627,167	5,071,728	0.76
Teck Resources Ltd. 'B'	CAD	144,802	3,117,295	0.47
			8,824,486	1.33
<i>China</i>				
AAC Technologies Holdings, Inc.	HKD	101,466	588,932	0.09
Agricultural Bank of China Ltd. 'H'	HKD	640,139	280,401	0.04
Alibaba Group Holding Ltd., ADR	USD	62,234	8,530,414	1.28
Baidu, Inc., ADR	USD	5,320	843,752	0.13
Bank of China Ltd. 'H'	HKD	6,217,360	2,683,695	0.40
Berry Genomics Co. Ltd. 'A'	CNY	172,700	802,413	0.12
Brilliance China Automotive Holdings Ltd.	HKD	229,359	170,763	0.02
China Biologic Products Holdings, Inc.	USD	3,648	276,920	0.04
China Construction Bank Corp. 'H'	HKD	5,959,000	4,916,051	0.74
China Gas Holdings Ltd.	HKD	1,709,767	6,091,884	0.92
China Oilfield Services Ltd. 'H'	HKD	468,000	402,227	0.06
China Overseas Land & Investment Ltd.	HKD	188,000	645,834	0.10
China Petroleum & Chemical Corp. 'H'	HKD	242,000	172,758	0.03
China Renaissance Holdings Ltd., Reg. S	HKD	139,564	356,463	0.05
China Resources Gas Group Ltd.	HKD	936,000	3,705,510	0.56
China Tower Corp. Ltd., Reg. S 'H'	HKD	2,440,000	461,171	0.07
Chongqing Fuling Zhacai Group Co. Ltd. 'A'	CNY	127,949	402,537	0.06
CNOOC Ltd.	HKD	232,000	358,496	0.05
Ctrip.com International Ltd., ADR	USD	91,472	2,475,232	0.37
ENN Energy Holdings Ltd.	HKD	863,200	7,655,864	1.15
Foshan Haitian Flavouring & Food Co. Ltd. 'A'	CNY	51,300	514,068	0.08
Guangzhou Baiyun International Airport Co. Ltd. 'A'	CNY	1,152,258	1,686,673	0.25
Hengan International Group Co. Ltd.	HKD	180,357	1,312,860	0.20
Huazhu Group Ltd., ADR	USD	78,060	2,234,858	0.34
HUYA, Inc., ADR	USD	22,691	351,257	0.05
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd. 'A'	CNY	194,400	647,840	0.10
Jiangsu Hengrui Medicine Co. Ltd. 'A'	CNY	118,589	911,134	0.14
Kingboard Holdings Ltd.	HKD	341,000	910,146	0.14
Kingdee International Software Group Co. Ltd.	HKD	1,478,702	1,306,764	0.20
Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	CNY	17,319	1,488,324	0.22
Longfor Group Holdings Ltd.	HKD	80,000	239,065	0.04

Meituan Dianping, Reg. S 'B'	HKD	375,794	2,106,808	0.32
Midea Group Co. Ltd. 'A'	CNY	367,878	1,975,033	0.30
MMG Ltd.	HKD	1,076,000	463,076	0.07
PICC Property & Casualty Co. Ltd. 'H'	HKD	1,955,000	1,999,815	0.30
Pinduoduo, Inc., ADR	USD	3,288	73,783	0.01
Ping An Healthcare and Technology Co. Ltd., Reg. S	HKD	10,400	36,657	
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'	HKD	43,500	384,142	0.06
Shanghai International Airport Co. Ltd. 'A'	CNY	520,764	3,850,151	0.58
Sun Art Retail Group Ltd.	HKD	610,500	622,156	0.09
Tencent Holdings Ltd.	HKD	263,115	10,550,809	1.59
Tencent Music Entertainment Group, ADR	USD	90,866	1,201,252	0.18
TravelSky Technology Ltd. 'H'	HKD	223,215	571,542	0.09
WuXi AppTec Co. Ltd., Reg. S 'H'	HKD	64,300	558,381	0.08
Wuxi Biologics Cayman, Inc., Reg. S	HKD	106,500	682,073	0.10
Xiaomi Corp., Reg. S 'B'	HKD	144,200	237,924	0.04
Yunnan Baiyao Group Co. Ltd. 'A'	CNY	219,400	2,363,462	0.36
YY, Inc., ADR	USD	25,177	1,507,095	0.23
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	HKD	560,500	1,110,907	0.17
			83,719,372	12.61
<i>Colombia</i>				
Grupo Nutresa SA	COP	67,235	486,535	0.07
			486,535	0.07
<i>Denmark</i>				
Carlsberg A/S 'B'	DKK	13,185	1,401,355	0.21
Chr Hansen Holding A/S	DKK	28,006	2,478,057	0.38
Novo Nordisk A/S 'B'	DKK	45,266	2,069,323	0.31
			5,948,735	0.90
<i>France</i>				
Accor SA	EUR	4,914	208,937	0.03
Air Liquide SA	EUR	5,870	729,386	0.11
Airbus SE	EUR	56,158	5,402,241	0.81
Arkema SA	EUR	7,435	638,558	0.10
BioMerieux	EUR	11,396	750,776	0.11
Edenred	EUR	29,812	1,096,784	0.17
EssilorLuxottica SA	EUR	18,118	2,292,798	0.35
Hermes International	EUR	4,670	2,593,996	0.39
Kering SA	EUR	4,835	2,280,141	0.34
L'Oreal SA	EUR	817	188,339	0.03
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	16,389	4,848,401	0.73
Pernod Ricard SA	EUR	24,752	4,063,931	0.61
Safran SA	EUR	21,746	2,626,092	0.40
TOTAL SA	EUR	3,486	184,447	0.03
Valeo SA	EUR	4,806	140,470	0.02
			28,045,297	4.23
<i>Germany</i>				
adidas AG	EUR	6,063	1,267,075	0.19
Bayer AG	EUR	15,516	1,076,603	0.16
Bayerische Motoren Werke AG	EUR	11,646	943,379	0.14
Carl Zeiss Meditec AG	EUR	29,989	2,346,781	0.35
Daimler AG	EUR	5,850	307,718	0.05
Evonik Industries AG	EUR	29,100	726,841	0.11
Henkel AG & Co. KGaA Preference	EUR	7,084	774,313	0.12
Infineon Technologies AG	EUR	34,146	679,367	0.10
LANXESS AG	EUR	12,174	560,724	0.08
Symrise AG	EUR	4,314	318,808	0.05
Volkswagen AG Preference	EUR	5,671	902,639	0.14
			9,904,248	1.49
<i>Greece</i>				
Eurobank Ergasias SA	EUR	903,239	558,838	0.08
JUMBO SA	EUR	112,977	1,646,520	0.25
			2,205,358	0.33
<i>Hong Kong</i>				
AIA Group Ltd.	HKD	1,236,037	10,260,188	1.55
BeiGene Ltd., ADR	USD	5,700	799,482	0.12

Chow Sang Sang Holdings International Ltd.	HKD	397,000	589,125	0.09
CK Asset Holdings Ltd.	HKD	127,363	931,984	0.14
Galaxy Entertainment Group Ltd.	HKD	510,000	3,243,471	0.49
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	HKD	11,100	321,213	0.05
Jardine Matheson Holdings Ltd.	USD	22,452	1,562,210	0.23
Melco Resorts & Entertainment Ltd., ADR	USD	157,856	2,781,423	0.42
Sands China Ltd.	HKD	368,400	1,613,705	0.24
Shangri-La Asia Ltd.	HKD	308,000	456,267	0.07
Sun Hung Kai Properties Ltd.	HKD	36,000	513,071	0.08
Wynn Macau Ltd.	HKD	855,600	1,866,247	0.28
			24,938,386	3.76
<i>Hungary</i>				
Wizz Air Holdings plc, Reg. S	GBP	15,708	561,000	0.08
			561,000	0.08
<i>India</i>				
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	INR	505,192	2,805,456	0.42
Axis Bank Ltd.	INR	226,884	2,014,544	0.30
Bajaj Finance Ltd.	INR	71,655	2,714,864	0.41
Bharat Financial Inclusion Ltd.	INR	16,141	234,133	0.04
Bharti Airtel Ltd.	INR	75,219	336,689	0.05
Eicher Motors Ltd.	INR	1,548	513,487	0.08
Godrej Consumer Products Ltd.	INR	279,640	3,247,012	0.49
Havells India Ltd.	INR	157,110	1,556,135	0.23
HDFC Bank Ltd., ADR	USD	6,874	712,078	0.11
HDFC Bank Ltd.	INR	337,855	10,267,521	1.55
Housing Development Finance Corp. Ltd.	INR	43,269	1,219,917	0.18
ICICI Bank Ltd., ADR	USD	62,995	648,219	0.10
ICICI Bank Ltd.	INR	204,272	1,053,764	0.16
Indus Gas Ltd.	GBP	324,657	1,001,415	0.15
IndusInd Bank Ltd.	INR	35,103	804,128	0.12
Kotak Mahindra Bank Ltd.	INR	473,733	8,526,041	1.28
MakeMyTrip Ltd.	USD	44,510	1,082,928	0.16
Maruti Suzuki India Ltd.	INR	8,063	862,198	0.13
Motherson Sumi Systems Ltd.	INR	112,174	268,083	0.04
Pidilite Industries Ltd.	INR	81,673	1,296,017	0.20
Piramal Enterprises Ltd.	INR	18,452	629,493	0.09
Reliance Industries Ltd.	INR	796,283	12,788,546	1.93
Shriram Transport Finance Co. Ltd.	INR	65,629	1,165,605	0.18
Tata Steel Ltd.	INR	93,644	698,893	0.11
UPL Ltd.	INR	111,141	1,207,085	0.18
			57,654,251	8.69
<i>Indonesia</i>				
Astra International Tbk. PT	IDR	1,575,000	900,861	0.14
Bank Central Asia Tbk. PT	IDR	2,068,900	3,740,709	0.56
Matahari Department Store Tbk. PT	IDR	1,068,600	416,145	0.06
			5,057,715	0.76
<i>Ireland</i>				
Ryanair Holdings plc, ADR	USD	5,903	421,120	0.06
			421,120	0.06
<i>Israel</i>				
Teva Pharmaceutical Industries Ltd., ADR	USD	41,239	635,905	0.10
			635,905	0.10
<i>Italy</i>				
Enel SpA	EUR	45,229	261,386	0.04
Ferrari NV	EUR	4,322	429,729	0.07
UniCredit SpA	EUR	53,680	608,519	0.09
			1,299,634	0.20
<i>Japan</i>				
Asahi Group Holdings Ltd.	JPY	6,400	249,273	0.04
Asahi Intecc Co. Ltd.	JPY	49,600	2,099,758	0.32
Daikin Industries Ltd.	JPY	8,200	874,951	0.13
Disco Corp.	JPY	1,900	222,755	0.03
FANUC Corp.	JPY	1,300	197,719	0.03
Hamamatsu Photonics KK	JPY	16,400	552,876	0.08

Hoya Corp.	JPY	9,300	561,284	0.08
Inpex Corp.	JPY	40,300	360,955	0.05
Kansai Paint Co. Ltd.	JPY	48,400	933,512	0.14
Kao Corp.	JPY	4,100	305,017	0.05
Keyence Corp.	JPY	8,600	4,368,852	0.66
Kirin Holdings Co. Ltd.	JPY	90,614	1,900,244	0.29
Komatsu Ltd.	JPY	10,300	222,295	0.03
Lion Corp.	JPY	21,200	439,068	0.07
MISUMI Group, Inc.	JPY	11,400	241,199	0.04
Murata Manufacturing Co. Ltd.	JPY	31,200	4,257,069	0.64
Nidec Corp.	JPY	17,600	2,003,193	0.30
Pigeon Corp.	JPY	11,400	488,846	0.07
Renesas Electronics Corp.	JPY	42,345	193,171	0.03
Ryohin Keikaku Co. Ltd.	JPY	9,500	2,301,218	0.35
Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	JPY	9,600	747,645	0.11
SMC Corp.	JPY	9,900	3,002,381	0.45
SoftBank Group Corp.	JPY	10,800	719,803	0.11
Sony Corp.	JPY	39,400	1,914,551	0.29
Suzuki Motor Corp.	JPY	13,800	700,922	0.11
Tokyo Electron Ltd.	JPY	10,522	1,201,431	0.18
Topcon Corp.	JPY	23,180	309,405	0.05
Toyota Motor Corp.	JPY	4,300	251,319	0.04
Unicharm Corp.	JPY	21,500	698,130	0.10
			32,318,842	4.87
<i>Malaysia</i>				
IHH Healthcare Bhd.	MYR	646,700	843,488	0.13
			843,488	0.13
<i>Mexico</i>				
America Movil SAB de CV, ADR 'L'	USD	111,989	1,595,843	0.24
America Movil SAB de CV	MXN	56,809	40,384	0.01
Coca-Cola Femsa SAB de CV	MXN	68,960	418,110	0.06
Fibra Uno Administracion SA de CV, REIT	MXN	315,581	350,722	0.05
Fomento Economico Mexicano SAB de CV, ADR	USD	1,584	136,303	0.02
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	MXN	100,294	861,125	0.13
Genomma Lab Internacional SAB de CV 'B'	MXN	826,015	490,521	0.07
Gruma SAB de CV 'B'	MXN	43,828	496,673	0.08
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	MXN	88,338	329,361	0.05
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 'A'	MXN	242,917	385,295	0.06
Wal-Mart de Mexico SAB de CV, ADR 'V'	USD	2,994	76,197	0.01
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	MXN	388,970	989,064	0.15
			6,169,598	0.93
<i>Netherlands</i>				
Akzo Nobel NV	EUR	10,422	840,647	0.13
ASML Holding NV	EUR	22,111	3,474,767	0.52
Koninklijke DSM NV	EUR	6,434	526,638	0.08
Koninklijke Philips NV	EUR	40,649	1,440,521	0.22
			6,282,573	0.95
<i>New Zealand</i>				
a2 Milk Co. Ltd.	AUD	103,828	754,714	0.11
			754,714	0.11
<i>Norway</i>				
Yara International ASA	NOK	20,575	793,588	0.12
			793,588	0.12
<i>Peru</i>				
Credicorp Ltd.	USD	2,262	501,418	0.08
			501,418	0.08
<i>Philippines</i>				
Alliance Global Group, Inc.	PHP	3,334,600	754,621	0.11
Ayala Corp.	PHP	27,330	467,757	0.07
Ayala Land, Inc.	PHP	1,794,100	1,385,195	0.21
Bank of the Philippine Islands	PHP	944,215	1,687,862	0.26
Emperador, Inc.	PHP	3,992,100	539,770	0.08
International Container Terminal Services, Inc.	PHP	2,088,830	3,972,292	0.60
Metropolitan Bank & Trust Co.	PHP	299,059	460,375	0.07

SM Prime Holdings, Inc.	PHP	719,241	489,661	0.07
			9,757,533	1.47
<i>Russian Federation</i>				
Aeroflot PJSC	USD	274,443	398,538	0.06
Lenta Ltd., Reg. S, GDR	USD	26,440	81,567	0.01
LUKOIL PJSC, ADR	USD	6,482	463,333	0.07
Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC	USD	587,557	683,059	0.10
Novatek PJSC, Reg. S, GDR	USD	2,805	479,655	0.07
Rosneft Oil Co. PJSC, Reg. S, GDR	USD	50,601	312,714	0.05
Sberbank of Russia PJSC, ADR	USD	334,248	3,663,358	0.55
TCS Group Holding plc, Reg. S, GDR	USD	1,800	28,008	0.01
Yandex NV 'A'	USD	36,576	1,000,354	0.15
			7,110,586	1.07
<i>South Africa</i>				
Capitec Bank Holdings Ltd.	ZAR	47,344	3,678,929	0.55
Discovery Ltd.	ZAR	39,427	437,883	0.07
FirstRand Ltd.	ZAR	32,189	146,677	0.02
Mr Price Group Ltd.	ZAR	49,302	843,488	0.13
MTN Group Ltd.	ZAR	84,656	523,676	0.08
Naspers Ltd. 'N'	ZAR	20,869	4,195,224	0.63
Remgro Ltd.	ZAR	44,803	606,425	0.09
Shoprite Holdings Ltd.	ZAR	84,755	1,120,150	0.17
			11,552,452	1.74
<i>South Korea</i>				
Amorepacific Corp.	KRW	1,329	249,530	0.04
Hugel, Inc.	KRW	1,653	565,172	0.08
Hyundai Mobis Co. Ltd.	KRW	4,142	705,306	0.11
Hyundai Motor Co.	KRW	27,563	2,927,241	0.44
Samsung Electronics Co. Ltd. Preference	KRW	4,065	115,669	0.02
Samsung Electronics Co. Ltd.	KRW	212,979	7,386,886	1.11
Samsung SDI Co. Ltd.	KRW	5,337	1,047,502	0.16
SK Hynix, Inc.	KRW	80,338	4,356,022	0.65
			17,353,328	2.61
<i>Spain</i>				
Amadeus IT Group SA 'A'	EUR	47,856	3,335,919	0.50
Grifols SA, ADR Preference	USD	7,816	143,502	0.02
Grifols SA Preference 'B'	EUR	60,715	1,122,766	0.17
Industria de Diseno Textil SA	EUR	56,201	1,439,168	0.22
			6,041,355	0.91
<i>Sweden</i>				
Assa Abloy AB 'B'	SEK	44,343	791,254	0.12
Hexagon AB 'B'	SEK	7,127	328,087	0.05
Spotify Technology SA	USD	2,056	233,356	0.03
			1,352,697	0.20
<i>Switzerland</i>				
DKSH Holding AG	CHF	1,320	91,120	0.01
LafargeHolcim Ltd.	CHF	20,960	863,648	0.13
Nestle SA	CHF	63,773	5,177,623	0.78
Novartis AG	CHF	41,951	3,586,898	0.54
SIG Combibloc Group AG	CHF	38,826	413,185	0.06
Sika AG	CHF	6,516	826,019	0.12
Straumann Holding AG	CHF	1,548	973,308	0.15
Temenos AG	CHF	10,283	1,233,458	0.19
			13,165,259	1.98
<i>Taiwan</i>				
Largan Precision Co. Ltd.	TWD	16,000	1,673,553	0.25
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	USD	27,769	1,024,954	0.16
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	1,478,670	10,848,166	1.63
			13,546,673	2.04
<i>Thailand</i>				
Central Pattana PCL	THB	141,200	324,162	0.05
CP ALL PCL	THB	252,700	533,573	0.08
Intouch Holdings PCL 'F'	THB	168,800	247,549	0.04

Kasikornbank PCL	THB	3,300	18,699	
Kasikornbank PCL, NVDR	THB	83,600	475,000	0.07
Thai Beverage PCL	SGD	1,481,100	662,879	0.10
			2,261,862	0.34
<i>Turkey</i>				
Akbank T.A.S.	TRY	451,971	585,833	0.09
BIM Birlesik Magazalar A/S	TRY	22,303	366,625	0.05
Haci Omer Sabanci Holding A/S	TRY	213,695	303,634	0.05
KOC Holding A/S	TRY	293,105	786,413	0.12
Turkiye Garanti Bankasi A/S	TRY	879,360	1,322,571	0.20
			3,365,076	0.51
<i>United Arab Emirates</i>				
DP World Ltd.	USD	47,777	816,987	0.12
			816,987	0.12
<i>United Kingdom</i>				
Associated British Foods plc	GBP	23,951	623,686	0.10
AstraZeneca plc	GBP	49,368	3,695,553	0.56
BHP Group plc	GBP	40,400	850,472	0.13
British American Tobacco plc	GBP	137,866	4,393,100	0.66
Coca-Cola HBC AG	GBP	8,374	261,714	0.04
Energean Oil & Gas plc	GBP	198,689	1,591,164	0.24
Glencore plc	GBP	329,706	1,224,379	0.19
Gulf Keystone Petroleum Ltd.	GBP	289,255	667,319	0.10
GVC Holdings plc	GBP	20,429	175,502	0.03
Halma plc	GBP	16,048	279,003	0.04
Hikma Pharmaceuticals plc	GBP	14,365	314,193	0.05
Inchcape plc	GBP	46,164	324,506	0.05
InterContinental Hotels Group plc	GBP	11,477	619,813	0.09
Johnson Matthey plc	GBP	26,543	946,950	0.14
NMC Health plc	GBP	11,953	416,838	0.06
Prudential plc	GBP	133,890	2,392,600	0.36
Reckitt Benckiser Group plc	GBP	13,666	1,047,385	0.16
Rio Tinto plc	GBP	28,053	1,333,712	0.20
Rolls-Royce Holdings plc Preference	GBP	5,175,782	6,597	
Rolls-Royce Holdings plc	GBP	90,209	954,337	0.14
Royal Dutch Shell plc, ADR 'B'	USD	6,993	419,160	0.06
Royal Dutch Shell plc 'A'	GBP	14,199	417,612	0.06
Royal Dutch Shell plc 'B'	GBP	115,101	3,432,961	0.52
Sirius Minerals plc	GBP	2,098,914	556,457	0.08
Vivo Energy plc, Reg. S	GBP	257,594	410,412	0.06
			27,355,425	4.12
<i>United States of America</i>				
Abbott Laboratories	USD	45,372	3,281,757	0.49
AbbVie, Inc.	USD	32,432	2,989,906	0.45
Acacia Communications, Inc.	USD	20,911	794,618	0.12
Activision Blizzard, Inc.	USD	35,762	1,665,436	0.25
Adobe, Inc.	USD	946	214,023	0.03
Air Products & Chemicals, Inc.	USD	2,411	385,881	0.06
Alcoa Corp.	USD	26,455	703,174	0.11
Alphabet, Inc. 'A'	USD	2,365	2,471,330	0.37
Alphabet, Inc. 'C'	USD	8,669	8,977,703	1.35
American Tower Corp., REIT	USD	11,305	1,788,338	0.27
Amphenol Corp. 'A'	USD	8,354	676,841	0.10
Apple, Inc.	USD	1,631	257,274	0.04
Baker Hughes a GE Co.	USD	17,359	373,218	0.06
BioMarin Pharmaceutical, Inc.	USD	32,007	2,725,396	0.41
Boeing Co. (The)	USD	7,976	2,572,260	0.39
Booking Holdings, Inc.	USD	2,181	3,756,598	0.57
Broadcom, Inc.	USD	22,649	5,759,188	0.87
Caterpillar, Inc.	USD	1,423	180,821	0.03
Celanese Corp.	USD	7,056	634,828	0.10
Chevron Corp.	USD	4,827	525,129	0.08
Chubb Ltd.	USD	1,372	177,235	0.03
Coca-Cola Co. (The)	USD	25,396	1,202,501	0.18
Cummins, Inc.	USD	5,226	698,403	0.10
Danaher Corp.	USD	2,681	276,465	0.04

Deere & Co.	USD	4,251	634,122	0.09
Domino's Pizza, Inc.	USD	4,724	1,171,505	0.18
Elastic NV	USD	1,434	102,502	0.01
Electronic Arts, Inc.	USD	4,504	355,411	0.05
EPAM Systems, Inc.	USD	8,724	1,012,071	0.15
Exxon Mobil Corp.	USD	13,587	926,497	0.14
Facebook, Inc. 'A'	USD	28,086	3,681,794	0.55
Freeport-McMoRan, Inc. 'B'	USD	30,841	317,971	0.05
General Motors Co.	USD	49,299	1,649,052	0.25
Halliburton Co.	USD	25,678	682,521	0.10
Herbalife Nutrition Ltd.	USD	12,597	742,593	0.11
Illumina, Inc.	USD	4,091	1,227,014	0.18
Inphi Corp.	USD	10,501	337,607	0.05
Intel Corp.	USD	15,842	743,465	0.11
International Flavors & Fragrances, Inc.	USD	7,939	1,065,969	0.16
Johnson Controls International plc	USD	6,475	191,984	0.03
Kosmos Energy Ltd.	USD	371,530	1,512,127	0.23
Linde plc	USD	5,920	923,757	0.14
Marriott International, Inc. 'A'	USD	32,596	3,538,622	0.53
Mastercard, Inc. 'A'	USD	36,876	6,956,657	1.05
Mellanox Technologies Ltd.	USD	4,082	377,095	0.06
MercadoLibre, Inc.	USD	12,089	3,540,264	0.53
Merck & Co., Inc.	USD	9,793	748,283	0.11
MGM Resorts International	USD	9,307	225,788	0.03
Micron Technology, Inc.	USD	154,027	4,887,277	0.74
Microsoft Corp.	USD	59,983	6,092,473	0.92
Mondelez International, Inc. 'A'	USD	5,926	237,218	0.04
Moody's Corp.	USD	6,701	938,408	0.14
NIKE, Inc. 'B'	USD	21,185	1,570,656	0.24
Noble Energy, Inc.	USD	42,501	797,319	0.12
NVIDIA Corp.	USD	1,985	264,997	0.04
Occidental Petroleum Corp.	USD	13,138	806,410	0.12
PepsiCo, Inc.	USD	8,232	909,471	0.14
PerkinElmer, Inc.	USD	18,319	1,438,957	0.22
Pfizer, Inc.	USD	10,040	438,246	0.07
Samsonite International SA	HKD	659,013	1,872,555	0.28
Schlumberger Ltd.	USD	15,858	572,157	0.09
Skyworks Solutions, Inc.	USD	8,884	595,406	0.09
TE Connectivity Ltd.	USD	4,410	333,528	0.05
Thermo Fisher Scientific, Inc.	USD	17,886	4,002,708	0.60
TransDigm Group, Inc.	USD	1,881	639,653	0.10
Trimble, Inc.	USD	16,599	546,273	0.08
Twenty-First Century Fox, Inc. 'A'	USD	8,407	404,545	0.06
Visa, Inc. 'A'	USD	27,045	3,568,317	0.54
Waters Corp.	USD	6,602	1,245,467	0.19
Western Union Co. (The)	USD	20,052	342,087	0.05
Wynn Resorts Ltd.	USD	4,816	476,351	0.07
Yum! Brands, Inc.	USD	3,009	276,587	0.04
Zoetis, Inc.	USD	19,848	1,697,798	0.26
			110,707,858	16.68
<i>Viet Nam</i>				
Vinhomes JSC, Reg. S	VND	142,269	450,207	0.07
			450,207	0.07
株式合計			560,986,475	84.51
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			593,772,340	89.45
その他の規制のある市場で取引されている譲渡可能な有価証券と短期金融商品				
債券				
<i>Argentina</i>				
Argentina Government Bond, FRN 51.865% 11/03/2019	ARS	3,233,760	85,941	0.01
			85,941	0.01
<i>Dominican Republic</i>				
Dominican Republic Government Bond, 144A 7.45% 30/04/2044	USD	125,000	130,312	0.02
			130,312	0.02

<i>Egypt</i>					
Egypt Treasury Bill 0% 04/06/2019	EGP	9,700,000	503,124	0.08	
			503,124	0.08	
<i>Italy</i>					
UniCredit SpA, Reg. S, FRN 8% Perpetual	USD	500,000	445,750	0.07	
			445,750	0.07	
<i>Mexico</i>					
Petroleos Mexicanos 6.875% 04/08/2026	USD	20,000	19,490		
			19,490		
<i>Netherlands</i>					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 6% 15/04/2024	USD	290,000	280,038	0.04	
			280,038	0.04	
<i>Nigeria</i>					
Nigeria Treasury Bill 0% 07/02/2019	NGN	35,000,000	94,740	0.01	
			94,740	0.01	
<i>Paraguay</i>					
Paraguay Government Bond, 144A 5.6% 13/03/2048	USD	200,000	197,500	0.03	
			197,500	0.03	
債券合計			1,756,895	0.26	
株式					
<i>China</i>					
Ping An Healthcare and Technology Co. Ltd.	HKD	143,300	505,087	0.08	
			505,087	0.08	
<i>India</i>					
Axis Bank Ltd. ¹	INR	105,385	284,789	0.04	
			284,789	0.04	
株式合計			789,876	0.12	
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			2,546,771	0.38	
その他譲渡可能な有価証券と短期金融商品					
株式					
<i>Russian Federation</i>					
EN+ Group plc, Reg. S, GDR ¹	USD	254,662	1,531,079	0.23	
			1,531,079	0.23	
<i>Viet Nam</i>					
Vietnam Technological & Commercial Joint Stock Bank	VND	657,202	789,096	0.12	
			789,096	0.12	
株式合計			2,320,175	0.35	
パーティシペーション・ノート					
<i>China</i>					
Aier Eye Hospital Group Co. Ltd. 'A' 0% 19/07/2019 ¹	USD	260,100	996,339	0.15	
			996,339	0.15	
パーティシペーション・ノート合計			996,339	0.15	
その他譲渡可能な有価証券と短期金融商品の合計			3,316,514	0.50	
UCITS準拠ファンド、もしくは他の譲渡可能証券への集合投資事業					
集団投資スキーム - UCITS					
<i>Luxembourg</i>					
JPMorgan US Dollar Treasury Liquidity Fund - JPM US Dollar Treasury Liquidity Institutional (dist.)	USD	42,737,963	42,737,963	6.44	
			42,737,963	6.44	
集団投資スキーム合計 - UCITS			42,737,963	6.44	
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			42,737,963	6.44	

投資総額	642,373,588	96.77
銀行預金	20,566,411	3.10
その他の純資産/(負債)	858,993	0.13
純資産総額	663,798,992	100.00

¹ 証券は取締役会により公正な価値で評価されている。

² 債務不履行中。

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 (%)
BRL	150,000	USD	38,261	10/01/2019	Citibank	415	
BRL	2,150,000	USD	550,520	10/01/2019	Morgan Stanley	3,847	
USD	672,622	BRL	2,560,000	10/01/2019	Citibank	12,539	
MXN	8,170,000	USD	399,941	11/01/2019	Citibank	15,368	
EUR	86,300	USD	98,572	14/01/2019	Citibank	399	
USD	494,679	BRL	1,901,000	14/01/2019	Goldman Sachs	4,613	
USD	1,554,722	CNH	10,650,000	18/01/2019	HSBC	4,135	
先物為替予約の未実現益						41,316	
AUD Hedged Share Class							
USD	21,402	AUD	30,037	18/01/2019	JP. Morgan	239	
EUR Hedged Share Class							
EUR	5,914,056	USD	6,740,069	18/01/2019	JP. Morgan	44,771	0.01
JPY Hedged Share Class							
JPY	8,502,970,115	USD	75,353,885	18/01/2019	JP. Morgan	2,323,587	0.35
ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現益						2,368,597	0.36
先物為替予約の未実現益合計						2,409,913	0.36
USD	401,982	MXN	8,170,000	11/01/2019	BNY Mellon	(13,327)	
USD	98,635	EUR	86,300	14/01/2019	JP. Morgan	(335)	
USD	279,560	INR	20,085,000	22/01/2019	Citibank	(7,485)	
USD	368,600	GBP	293,000	28/01/2019	BNY Mellon	(5,348)	
先物為替予約の未実現損						(26,495)	
AUD Hedged Share Class							
AUD	748,355	USD	538,114	18/01/2019	JP. Morgan	(10,841)	
EUR Hedged Share Class							
USD	311,308	EUR	272,804	18/01/2019	JP. Morgan	(1,665)	
JPY Hedged Share Class							
USD	6,319,112	JPY	705,324,382	18/01/2019	JP. Morgan	(124,261)	(0.02)
ヘッジ・シェアクラスの先物為替予約の未実現損						(136,767)	(0.02)
先物為替予約の未実現損合計						(163,262)	(0.02)
先物為替予約の未実現損益総額						2,246,651	0.34

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)

損益および純資産変動計算書

2018年12月31日現在

(USD)

収益

受取配当金（源泉徴収税額控除後）	18,082,097
債券および転換社債に係る利息（源泉徴収税額控除後）	4,538,613
銀行預金利息	623,304
スワップ取引	
収益小計	23,244,014
費用	
運用報酬	827,574
管理手数料	513,038
専門家サービス	582,645
年次税	169,409
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	345,977
印刷費用	153,046
その他費用	166,835
当座貸越利息*	
スワップ取引	
費用小計	2,758,524
費用の払戻し	176,873
投資純利益 / (損失) (a)	20,662,363
実現純利益 / (損失)	
投資有価証券の売却取引	(2,070,683)
スワップ取引	
金融先物取引	
為替取引	(2,452,147)
当期実現純利益 / (損失) (b)	(4,522,830)
未実現評価利益 / (損失)の増減	
投資有価証券	(143,491,456)
スワップ取引	
為替取引	1,564,815
金融先物取引	
当期末実現評価利益 / (損失)の増減 (c)	(141,926,641)
当期損益 (a+b+c)	(125,787,108)
配当金の分配	(28,415)
当期投資証券の差引増減額	(598,185,842)
期首純資産総額	1,387,800,357
期末純資産総額	663,798,992

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

*主に中央銀行が実施するマイナス金利政策によるものです。

日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

「キャピタル・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(2007年9月26日)より各計算期間の財務諸表について、監査を受けております。なお、直近の計算期間は2018年7月24日から2019年1月23日までとなっております。ただし、同マザーファンド(「日本短期債券マザーファンド」)は当該監査の対象ではありません。

「日本短期債券マザーファンド」の組入有価証券の状況

(有価証券明細表)

(2019年1月23日現在)

国名	銘柄名	利率 (%)	償還日	種類	額面 (千円)	評価額	
						単価 (円)	評価金額(円)
日本	第4回クレディ・アグリ コル・エス・エー円貨社 債(2014)	0.425	2019/11/28	社債券	100,000	100.208	100,208,000
日本	第19回ルノー円貨社債 (2017)	0.36	2020/7/6	社債券	100,000	99.503	99,503,000
日本	第11回ウエストパック・ バンキング・コーポレー ション円貨社債(2016)	0.3	2021/1/22	社債券	100,000	100.213	100,213,000
日本	第3回ソシエテ・ジェネ ラル非上位円貨社債 (2018)	0.804	2023/10/12	社債券	100,000	98.616	98,616,000
日本	第488回中部電力	1.562	2019/2/25	社債券	100,000	100.127	100,127,000
日本	第521回関西電力	0.18	2023/9/20	社債券	100,000	99.863	99,863,000
日本	第4回富士フィルムホー ルディングス(社債間限 定同順位特約付)	0.005	2020/3/3	社債券	100,000	99.949	99,949,000
日本	第50回日本電気(社債間 限定同順位特約付)	0.29	2022/6/15	社債券	100,000	100.151	100,151,000
日本	第31回ソニー	0.23	2021/9/17	社債券	100,000	100.277	100,277,000
日本	第1回三井住友トラ スト・パナソニックファイ ナンス(社債間限定同順 位特約付)	0.12	2020/10/30	社債券	100,000	100.148	100,148,000
日本	第22回あおぞら銀行(社 債間限定同順位特約付)	0.1	2021/12/10	社債券	100,000	99.968	99,968,000
日本	第28回三菱東京UFJ銀 行(劣後特約付)	1.56	2021/1/20	社債券	100,000	102.834	102,834,000
日本	第6回りそな銀行(劣後 特約付)	2.084	2020/3/4	社債券	100,000	102.197	102,197,000
日本	第23回三井住友銀行(劣 後特約付)	1.61	2020/12/17	社債券	100,000	102.859	102,859,000
日本	第22回東京センチュリー リース(社債間限定同順 位特約付)	0.06	2021/4/13	社債券	100,000	99.898	99,898,000
日本	第75回アコム(特定社債 間限定同順位特約付)	0.309	2023/2/28	社債券	100,000	99.826	99,826,000

日本	第69回日立キャピタル (社債間限定同順位特約 付)	0.08	2020/12/18	社債券	100,000	100.026	100,026,000
日本	第33回三菱UFJリース (社債間限定同順位特約 付)	0.297	2020/6/4	社債券	100,000	100.321	100,321,000
合 計					1,800,000		1,806,984,000

2【ファンドの現況】

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

<更新・訂正後>

【純資産額計算書】

キャピタル・ニューワールド・ファンドF(米ドル売り円買い)

2019年6月28日現在

資産総額	1,008,867,247円
負債総額	2,382,188円
純資産総額(-)	1,006,485,059円
発行済口数	1,005,566,589口
1口当たり純資産額(/)	1.0009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)

2019年6月28日現在

資産総額	5,701,502,283円
負債総額	24,648,000円
純資産総額(-)	5,676,854,283円
発行済口数	5,087,551,618口
1口当たり純資産額(/)	1.1158円

(参考) 日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

2019年1月23日現在

資産総額	162,220,138円
負債総額	116,509円
純資産総額(-)	162,103,629円
発行済口数	153,924,025口

1口当たり純資産額(/)	1.0531円
----------------	---------

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

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

<訂正後>

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

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

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

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

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

<訂正後>

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

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

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

3【委託会社等の経理状況】

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

< 訂正前 >

1．財務諸表の作成方法について

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

財務諸表に記載している金額は、千円未満の端数を切捨てて表示しております。

2．監査証明について

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

< 訂正後 >

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

2．監査証明について

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

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

< 中間財務諸表 >

(3)【株主資本等変動計算書】

(1) 中間貸借対照表

当中間会計期間

(2018年12月31日現在)

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

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

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

(2) 中間損益計算書

当中間会計期間

(自 2018年 7月 1日 至 2018年 12月31日)

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

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自2018年7月1日 至2018年12月31日)

(単位:千円)

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

[重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

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

(2)無形固定資産

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

3．外貨建資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

4．引当金の計上基準

(1)賞与引当金

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

(2)役員賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

5．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

[表示方法の変更]

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更

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

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間
(2018年12月31日現在)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

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

[リース取引関係]

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

1. 所有権移転外ファイナンス・リース取引

当中間会計期間末現在、該当するリース取引はありません。

2. オペレーティング・リース取引

（借主側）

未経過リース料

1年以内 329,780千円

1年超 1,264,159千円

合計 1,593,939千円

[金融商品関係]

当中間会計期間

（自2018年7月1日 至2018年12月31日）

1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

(1)現金・預金、未収入金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬

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

(2)投資有価証券

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

(3)長期差入保証金

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

負債

(1)未払金

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

(注2)金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

[有価証券関係]

当中間会計期間
(2018年12月31日現在)

(その他有価証券)

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

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

[デリバティブ取引関係]

当中間会計期間
(自2018年7月1日 至2018年12月31日)

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

[資産除去債務関係]

当中間会計期間
(2018年12月31日現在)

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減

当事業年度期首残高 247,065千円

時の経過による調整額 1,798千円

当中間会計期間末残高 248,863千円

[セグメント情報等]

当中間会計期間
(自2018年7月1日 至2018年12月31日)

（セグメント情報）

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

（注）営業収益は、顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[1株当たり情報]

当中間会計期間

（自2018年7月1日 至2018年12月31日）

1株当たり純資産額 48,161.56円

1株当たり中間純利益金額 4,418.88円

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

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額：324,279百万円（2018年9月30日現在）

（中略）

(2) 販売会社

名称：みずほ証券株式会社

資本金の額：125,167百万円(2018年9月30日現在)
(中略)

<再信託受託会社の概要>

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

<訂正後>

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

<再信託受託会社の概要>

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

独立監査人の中間監査報告書

2019年7月16日

キャピタル・インターナショナル株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 中島紀子 印
業務執行社員

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2019年3月18日

キャピタル・インターナショナル株式会社
取締役 会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 誠 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 水野 龍也 印

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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