

## 【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】	2024年6月14日提出
【発行者名】	キャピタル・インターナショナル株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 小泉 徹也
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目2番3号 丸の内二重橋ビル
【事務連絡者氏名】	原田 伸健
【電話番号】	03(6366)1000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型／米ドル売り円買い） キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース（成長型／為替ヘッジなし） キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算／米ドル売り円買い） キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算／為替ヘッジなし）
【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(2023年12月15日から2024年12月19日まで) キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型／米ドル売り円買い） 1兆円を上限とします。 キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース（成長型／為替ヘッジなし） 1兆円を上限とします。 キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算／米ドル売り円買い） 1兆円を上限とします。 キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算／為替ヘッジなし） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

本日、有価証券報告書を提出しましたので、2023年12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。2023年12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 (2023年10月31日現在)

(以下略)

<訂正後>

(前略)

ファミリーファンド方式

(中略)

・委託会社は、マザーファンドに投資を行なう当ファンド以外のベビーファンドの設定・運用を行なうことがあります。2024年6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 (2024年4月30日現在)

(以下略)

#### 2【投資方針】

##### (2)【投資対象】

<訂正前>

(前略)

<参考情報2> 投資対象ファンドの概要等

(中略)

上記は、2023年10月31日現在のものであり、今後、投資顧問会社等の判断その他理由により変更される場合があります。

(中略)

上記は、2023年10月31日現在のものであり、今後、委託会社等の判断その他理由により変更される場合があります。

(以下略)

<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、2024年4月30日現在のものであり、今後、投資顧問会社等の判断その他理由により変更される場合があります。

（中略）

上記は、2024年4月30日現在のものであり、今後、委託会社等の判断その他理由により変更される場合があります。

（以下略）

### （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（2023年10月31日現在）

運用開発部（5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2023年10月31日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

<訂正後>

（前略）

内部管理体制

（中略）

（参考情報）

キャピタル・インターナショナル株式会社の運用部門等の人員体制（2024年4月30日現在）

運用開発部（6名）／法務コンプライアンス部（3名）／オペレーション部（10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2024年4月30日現在の運用体制等です。運用体制等は、今後、予告なく変更される場合があります。

### 3【投資リスク】

<訂正前>

（前略）

<リスク管理体制>

（中略）

<参考情報> 投資対象ファンドにおけるリスク管理体制

（中略）

2．三菱UFJアセットマネジメント株式会社の投資リスクに対する管理体制

三菱UFJアセットマネジメント株式会社では、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い、ファンド管理委員会およびリスク管理委員会において、それらの状況の報告を行なうほか、必要に応じて改善策を審議しています。

（中略）

上記は2023年10月31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）

<リスク管理体制>

（中略）

&lt;参考情報&gt; 投資対象ファンドにおけるリスク管理体制

（中略）

## 2. 三菱UFJアセットマネジメント株式会社の投資リスクに対する管理体制

三菱UFJアセットマネジメント株式会社では、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い、ファンド管理委員会およびリスク管理委員会においてそれらの状況の報告を行なうほか、必要に応じて改善策を検討しています。

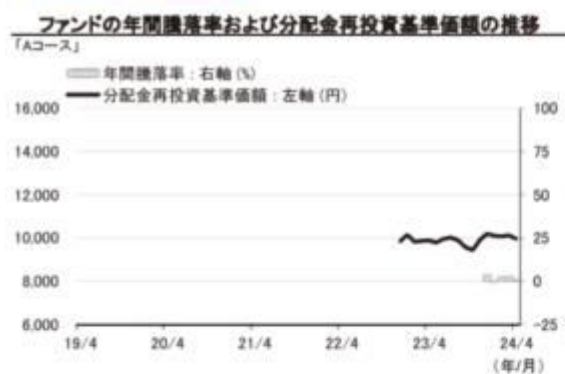
（中略）

上記は2024年4月30日現在のリスク管理体制等です。リスク管理体制は、今後、予告なく変更される場合があります。

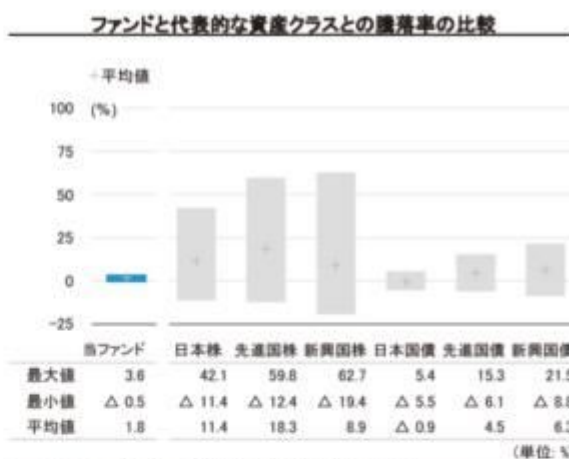
原届出書の第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 3投資リスク リスクの定量的比較につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

&lt;更新・訂正後&gt;

## リスクの定量的比較



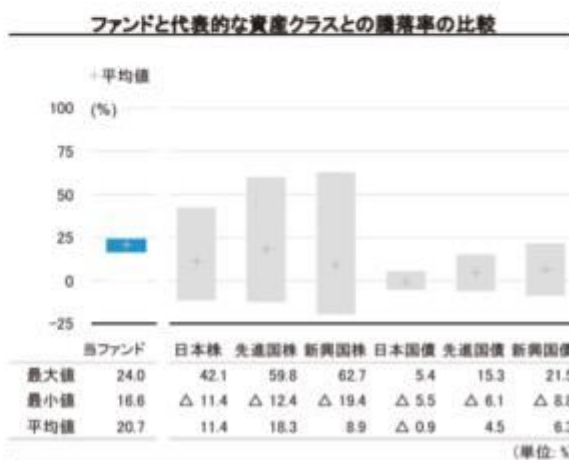
- (注1) 分配金再投資基準価額は、設定日(2022年12月15日)を10,000円とした基準価額で、2022年12月から2024年4月までの各月末における当該基準価額を表示しています。  
(注2) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額であり、実際の基準価額と異なる場合があります。  
(注3) 年間騰落率は、2023年12月から2024年4月までの各月末における1年間の騰落率を表示したもので、分配金再投資基準価額を基に算出しています。



- (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、2019年5月から2024年4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) 当ファンドの騰落率は、2023年12月から2024年4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。

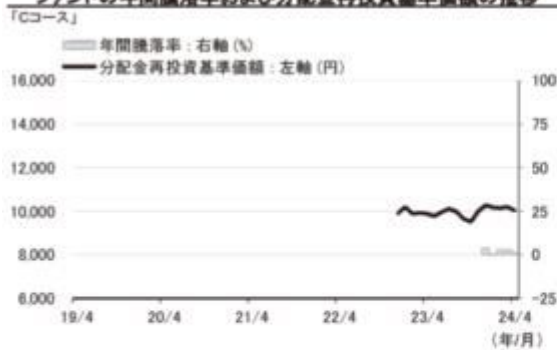


- (注1) 分配金再投資基準価額は、設定日(2022年12月15日)を10,000円とした基準価額で、2022年12月から2024年4月までの各月末における当該基準価額を表示しています。  
(注2) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額であり、実際の基準価額と異なる場合があります。  
(注3) 年間騰落率は、2023年12月から2024年4月までの各月末における1年間の騰落率を表示したもので、分配金再投資基準価額を基に算出しています。



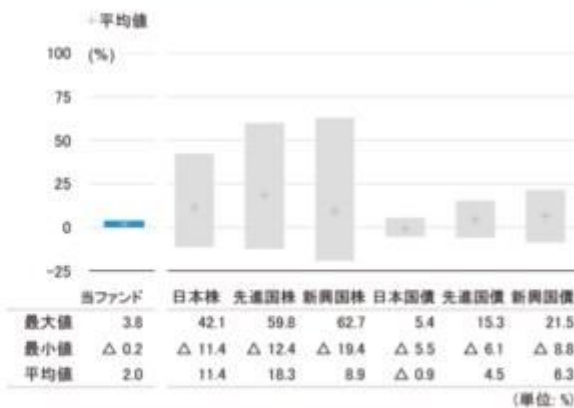
- (注1) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。  
(注2) 代表的な資産クラスの騰落率は、2019年5月から2024年4月までの5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
(注3) 当ファンドの騰落率は、2023年12月から2024年4月までの各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

## 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



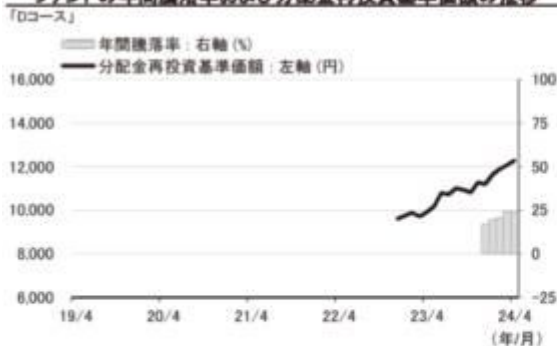
- (注1) 分配金再投資基準価額は、設定日(2022年12月15日)を10,000円とした基準価額で、2022年12月から2024年4月までの各月末における当該基準価額を表示しています。
- (注2) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額であり、実際の基準価額と異なる場合があります。
- (注3) 年間騰落率は、2023年12月から2024年4月までの各月末における1年間の騰落率を表示したもので、分配金再投資基準価額を基に算出しています。

## ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



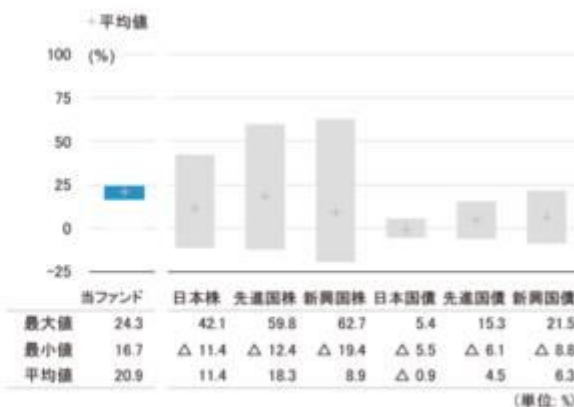
- (注1) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- (注2) 代表的な資産クラスの騰落率は、2019年5月から2024年4月までの5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- (注3) 当ファンドの騰落率は、2023年12月から2024年4月までの各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

## 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) 分配金再投資基準価額は、設定日(2022年12月15日)を10,000円とした基準価額で、2022年12月から2024年4月までの各月末における当該基準価額を表示しています。
- (注2) 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た基準価額であり、実際の基準価額と異なる場合があります。
- (注3) 年間騰落率は、2023年12月から2024年4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。

## 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、2019年5月から2024年4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) 当ファンドの騰落率は、2023年12月から2024年4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JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」)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JPXが有しています。なお、ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、JPXは、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産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、知的財産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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRIC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRICに帰属します。なお、NFRIC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、JP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JP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>

（前略）

<投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担>

（中略）

（＊１）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）（クラスCh-JPY）／（クラスC）／（クラスCfdmh-JPY）／（クラスCfdm）の投資顧問会社への報酬は、委託会社が支払います。このため、当該ファンドに信託報酬はかかりませんが、後記「（４）その他の手数料等」に表示するファンド管理費用（上限年率0.15%）が別途かかります。

（以下略）

<訂正後>

（前略）

<投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な負担>

（中略）

（＊１）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）（クラスCh-JPY）／（クラスC）／（クラスCfdmh-JPY）／（クラスCfdm）の投資顧問会社への報酬は、委託会社が支払います。このため、当該ファンドに信託報酬はかかりませんが、後記「（４）その他の手数料等」に表示するファンド管理費用が別途かかります。なお、当該ファンド管理費用の総経費率は、後記「（５）課税上の取扱い」の（参考情報）ファンドの総経費率に表示する「投資先ファンドの運用管理費用以外」の比率でご覧いただけます。

（以下略）

### （４）【その他の手数料等】

<訂正前>

（前略）

上記４．に定める費用は、外国の法律により設定された投資対象ファンドについては、当該投資対象ファンド設定国における慣行等に鑑みて著しく異ならない範囲の額とします。ただし、当該費用は当該投資対象ファンドの合計純資産額に対して年率10,000分の15を超えないものとします。

（以下略）

<訂正後>

（前略）

上記４．に定める費用は、外国の法律により設定された投資対象ファンドについては、当該投資対象ファンド設定国における慣行等に鑑みて著しく異ならない範囲の額で、契約先との適正な価格設定により、当該ファンドから適切な費用の支払いを受けることができるものとします。

（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、2023年10月31日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご留意ください。また、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が以下と異なる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

<個人受益者に対する課税>

（中略）

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」

公募株式投資信託は税法上、NISA（少額投資非課税制度）の適用対象であり、2024年1月1日以降は一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度です。

NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となりますが、2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（中略）

（注）税法等が改正された場合には、上記の内容が変更になることがあります。

&lt;訂正後&gt;

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、2024年4月30日現在のものであり、今後、税制改正等により変更される場合がありますのでご留意ください。また、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が以下と異なる場合があります。

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

&lt;個人受益者に対する課税&gt;

（中略）

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。当ファンドは、NISAの対象ではありません。

（中略）

（注）税法等が改正された場合には、上記の内容が変更になることがあります。

（参考情報）ファンドの総経費率

対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除きます。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）、その内訳は下記のとおりです。

ファンド略称	総経費率 ( + + + )	当ファンドの運用管理費用			当ファン ドのその他 費用	投資先ファ ンドの運用管 理費用	投資先ファ ンドの運用管 理費用以外
		委託 会社	販売 会社	受託 会社			
「Aコース（成 長型/米ドル売 り円買い）」	1.71%	1.56%			0.05%	0.00%	0.10%
		0.77%	0.77%	0.02%			
「Bコース（成 長型/為替ヘッ ジなし）」	1.71%	1.56%			0.05%	0.00%	0.10%
		0.77%	0.77%	0.02%			
「Cコース（分 配型年6回決算/ 米ドル売り円買 い）」	1.73%	1.56%			0.05%	0.00%	0.12%
		0.77%	0.77%	0.02%			
「Dコース（分 配型年6回決算/		1.56%					



為替ヘッジなし)	1.73%	0.77%	0.77%	0.02%	0.05%	0.00%	0.12%
----------	-------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

・上記の対象期間は、2023年9月21日から2024年3月21日までのものです。

・上記値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

・投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

・当ファンドの費用には、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。また、当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なります。

・投資先ファンドの運用管理費用以外の費用には、外国ファンドにおけるカストディアン等のファンド管理費用が含まれています。

## 5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

### (1)【投資状況】

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型／米ドル売り円買い）

2024年4月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	66,063,804	100.17
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		113,367	0.17
合計（純資産総額）		65,950,437	100.00

(注)投資比率とは、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。

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース（成長型／為替ヘッジなし）

2024年4月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,565,994,087	97.57
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		38,929,178	2.42
合計（純資産総額）		1,604,923,265	100.00

(注)投資比率とは、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。

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算／米ドル売り円買い）

2024年4月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	11,693,867	100.10
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		11,799	0.10
合計（純資産総額）		11,682,068	100.00

(注)投資比率とは、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。

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算／為替ヘッジなし）

2024年4月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	141,046,092	93.65
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,561,423	6.34

合計(純資産総額)	150,607,515	100.00
-----------	-------------	--------

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(参考) キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(米ドル売り円買い)

2024年4月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	4,065,879	0.01
投資証券	ルクセンブルク	22,686,106,218	99.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		20,482,733	0.09
合計(純資産総額)		22,710,654,830	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・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(為替ヘッジなし)

2024年4月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	4,993	0.00
投資証券	ルクセンブルク	17,640,779,926	99.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,382,239	0.07
合計(純資産総額)		17,654,167,158	100.00

(注)投資比率とは、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・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(分配型/米ドル売り円買い)

2024年4月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	4,993	0.04
投資証券	ルクセンブルク	11,672,515	99.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		16,115	0.13
合計(純資産総額)		11,693,623	100.00

(注)投資比率とは、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・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(分配型)

2024年4月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	4,993	0.00
投資証券	ルクセンブルク	140,834,557	99.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		206,062	0.14
合計(純資産総額)		141,045,612	100.00

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

(参考) キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ(LUX)

2024年4月30日現在

資産の種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	米国	3,545,824,433	1.60
	ブラジル	222,120,541	0.10
	英国	94,215,627	0.04

米国	89,663,694,311	40.42
メキシコ	12,356,473,628	5.57
ブラジル	9,308,117,011	4.20
南アフリカ	6,581,659,490	2.97
インドネシア	6,338,930,374	2.86
コロンビア	6,078,041,066	2.74
ポーランド	4,579,291,452	2.06
イスラエル	4,192,154,141	1.89
サウジアラビア	4,047,583,003	1.82
インド	3,800,731,966	1.71
エジプト	3,346,151,676	1.51
マレーシア	3,112,710,654	1.40
トルコ	3,019,973,670	1.36
カナダ	2,924,559,753	1.32
パナマ	2,908,113,333	1.31
ペルー	2,729,424,956	1.23
タイ	2,707,565,318	1.22
中国	2,650,494,538	1.19
英国	2,613,357,128	1.18
ハンガリー	2,464,852,390	1.11
アラブ首長国連邦	2,418,338,394	1.09
ルーマニア	2,193,247,232	0.99
チリ	2,160,923,730	0.97
香港	1,990,268,590	0.90
ドミニカ共和国	1,939,320,036	0.87
アルゼンチン	1,823,416,870	0.82
ザンビア	1,514,806,785	0.68
ギリシャ	1,060,353,389	0.48
セネガル	1,039,086,781	0.47
スプラ ナショナル	997,560,061	0.45
コートジボワール	993,578,532	0.45
ホンジュラス	859,654,988	0.39
アンゴラ	807,408,958	0.36
チェコ共和国	705,030,498	0.32
ルクセンブルク	663,458,150	0.30
パラグアイ	632,165,991	0.28
カザフスタン	576,102,212	0.26
フィリピン	543,024,279	0.24
ナミビア	521,237,434	0.23
オーストラリア	520,932,273	0.23
ウクライナ	519,205,754	0.23
セルビア	484,871,155	0.22
アルバニア	478,413,565	0.22
フランス	390,117,507	0.18
ブルガリア	370,663,268	0.17
オランダ	364,866,841	0.16
ベナン	292,681,424	0.13
モロッコ	292,217,659	0.13
グアテマラ	291,482,259	0.13

債券

韓国	248,557,908	0.11
モンゴル	212,667,311	0.10
ジョージア	185,626,396	0.08
ガーナ	134,409,522	0.06
ガボン	124,383,825	0.06
ボスニア・ヘルツェゴビナ	123,361,906	0.06
スイス	120,977,596	0.05
ヨルダン	95,038,176	0.04
銀行預金、その他資産（負債控除後）	13,876,989,155	6.26
合計	221,852,486,868	100.00

(注) 投資比率は、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)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

2024年1月24日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	11,093,929,000	54.95
地方債	日本	99,919,000	0.49
特殊債券	日本	700,085,000	3.47
社債券	日本	7,792,355,850	38.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		503,971,673	2.50
合計(純資産総額)		20,190,260,523	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(2024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・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース(成長型/米ドル売り円買い)

#### a. 上位30銘柄

2024年4月30日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(米ドル売り円買い)	50,492,055	1.3285	67,078,695	1.3084	66,063,804	100.17

(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

2024年4月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.17
合計	100.17

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース(成長型/為替ヘッジなし)

#### a. 上位30銘柄

2024年4月30日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	キャピタル・グローバル・ハイ インカム債券マザーファンド（為替 ヘッジなし）	1,250,594,224	1.2250	1,531,990,842	1.2522	1,565,994,087	97.57

(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

2024年4月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.57
合計	97.57

## キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算/米ドル売り円買い）

## a. 上位30銘柄

2024年4月30日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	キャピタル・グローバル・ハイ インカム債券マザーファンド（分配 型/米ドル売り円買い）	11,354,372	1.0458	11,874,402	1.0299	11,693,867	100.10

(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

2024年4月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.10
合計	100.10

## キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算/為替ヘッジなし）

## a. 上位30銘柄

2024年4月30日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	キャピタル・グローバル・ハイ インカム債券マザーファンド（分配 型）	112,146,054	1.2301	137,957,646	1.2577	141,046,092	93.65

(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

2024年4月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	93.65
合計	93.65

(参考) キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（米ドル売り円買い）

## a. 上位30銘柄

2024年4月30日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
----	------	----	-----	-----------	-------------	-------------	-------------	-------------	-----------------

1	ルクセンブルク	投資証券	キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（LUX）（クラスCh-JPY）	3,660,820.755	6,072.79	22,231,420,388	6,197	22,686,106,218	99.89
2	日本	投資信託受益証券	日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）	3,887,074	1.0482	4,074,430	1.046	4,065,879	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

2024年4月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	0.01
投資証券	99.89
合計	99.90

(参考) キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（為替ヘッジなし）

#### a. 上位30銘柄

2024年4月30日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ルクセンブルク	投資証券	キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（LUX）（クラスC）	1,804,498.765	9,559.54	17,250,180,438	9,776	17,640,779,926	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）	4,774	1.0471	4,998	1.046	4,993	0.00

(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銘柄の評価金額の比率をいいます。

#### b. 種類別投資比率

2024年4月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	0.00
投資証券	99.92
合計	99.92

(参考) キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型/米ドル売り円買い）

#### a. 上位30銘柄

2024年4月30日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ルクセンブルク	投資証券	キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（LUX）（クラスCfdmh-JPY）	1,630.012	7,312.77	11,919,910	7,161	11,672,515	99.81
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）	4,774	1.0471	4,998	1.046	4,993	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

2024年4月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	0.04
投資証券	99.81
合計	99.86

(参考) キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型）

## a. 上位30銘柄

2024年4月30日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	口数 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1		投資証券	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)(クラスCfdm)	15,704.121	8,816.9	138,461,810	8,968	140,834,557	99.85
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)	4,774	1.0471	4,998	1.046	4,993	0.00

(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銘柄の評価金額の比率をいいます。

## b. 種類別投資比率

2024年4月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.00
投資証券	99.85
合計	99.85

(参考)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)

## 上位30銘柄

2024年4月30日現在

順位	銘柄	利率(%) (上段) 償還日 (下段)	国/地域(上段) 資産(中段) 業種/種類(下段)	数量	評価単価(上段) 通貨(下段)	評価金額(円)	投資 比率 (%)
1	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA ZAR 8.875% 02-28-35	8.875 2035/2/28	南アフリカ 債券 国債・政府機関債 等	423,200,000	80.545 南アフリカ・ランド	2,853,684,726	1.29
2	POLAND GOVERNMENT BOND PLN 6.0% 10-25-33	6.0 2033/10/25	ポーランド 債券 国債・政府機関債 等	67,300,000	102.0902 ポーランド・ズロチ	2,662,797,588	1.20
3	ROTECH HEALTHCARE INC.	- -	米国 株式 ヘルスケア	153,793	105 米ドル	2,519,452,305	1.14
4	BONOS MEXICAN MXN 8.5% 11-18-38	8.5 2038/11/18	メキシコ 債券 国債・政府機関債 等	231,000,000	88.71 メキシコ・ペソ	1,878,750,345	0.85
5	NOTA DO TESOURO NACIONAL BRL 10.0% 01-01-29	10.0 2029/1/1	ブラジル 債券 国債・政府機関債 等	5,939,000	957.103 ブラジル・リアル	1,733,881,347	0.78
6	BRAZIL NTN BRL 10.0% 01-01-31	10.0 2031/1/1	ブラジル 債券 国債・政府機関債 等	53,660,000	93.3593 ブラジル・リアル	1,528,112,732	0.69
7	COLOMBIA COLTES COP 9.25% 05-28-42	9.25 2042/5/28	コロンビア 債券 国債・政府機関債 等	43,753,000,000	85.6467 コロンビア・ペソ	1,512,299,805	0.68
8	STATE OF ISRAEL 5.5% 03-12-34	5.5 2034/3/12	イスラエル 債券 国債・政府機関債 等	9,800,000	94.807 米ドル	1,449,595,238	0.65
9	BRAZIL NTN BRL I/L 6.0% 08-15-50	6.0 2050/8/15	ブラジル 債券 国債・政府機関債 等	1,097,000	4203.649 ブラジル・リアル	1,406,631,843	0.63

10	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS 111 BV SR UNSEC 5.125% 05-09-29	5.125 2029/5/9	イスラエル 債券 社債	8,745,000	95.025 米ドル	1,296,516,118	0.58
11	US TREASURY BOND 3.875% 08-15-33	3.875 2033/8/15	米国 債券 国債・政府機関債 等	8,285,000	94.3576 米ドル	1,219,691,040	0.55
12	MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) GO 6.338% 05-04-53	6.338 2053/5/4	メキシコ 債券 国債・政府機関債 等	7,610,000	94.311 米ドル	1,119,766,424	0.50
13	AMERICA MOVIL SAB DE CV MXN SR UNSEC 10.125% 01-22-29	10.125 2029/1/22	メキシコ 債券 社債	116,000,000	98.75 メキシコ・ペソ	1,050,218,364	0.47
14	POLAND GOVT BOND PLN 3.75% 05-25-27	3.75 2027/5/25	ポーランド 債券 国債・政府機関債 等	27,875,000	95.4924 ポーランド・ズロ チ	1,031,626,644	0.47
15	REPUBLIC OF ARGENTINA SF 0.75% 07-09-30	0.75 2030/7/9	アルゼンチン 債券 国債・政府機関債 等	11,048,700	58.101 米ドル	1,001,555,596	0.45
16	DISH NETWORK CORP 144A LIFE SR SEC 1ST LIEN 11.75% 11-15-27	11.75 2027/11/15	米国 債券 社債	6,245,000	101.3541 米ドル	987,538,505	0.45
17	INDONESIA GOVERNMENT IDR 8.25% 05-15-29	8.25 2029/5/15	インドネシア 債券 国債・政府機関債 等	97,167,000,000	104.875 インドネシア・ル ピア	978,101,821	0.44
18	GACI FIRST INVESTMENT CO REG S SR UNSEC 5.25% 01-29-34	5.25 2034/1/29	サウジアラビア 債券 国債・政府機関 債等	6,400,000	95.7472 米ドル	956,062,601	0.43
19	REPUBLIC OF TURKIYE 4.25% 04-14-26	4.25 2026/4/14	トルコ 債券 国債・政府機関債 等	6,144,000	96.85 米ドル	928,391,393	0.42
20	DIEBOLD NIXDORF, INC.	-	米国 株式 情報技術	181,850	32.6 米ドル	924,934,926	0.42
21	CHINA GOVT BOND CNY 3.12% 10-25-52	3.12 2052/10/25	中国 債券 国債・政府機関債 等	38,480,000	110.4813 中国元	915,313,638	0.41
22	PERU PEN 6.15% 08-12- 32	6.15 2032/8/12	ペルー 債券 国債・政府機関債 等	22,522,000	94.2954 ペルー・ソル	888,021,769	0.40
23	ARAB REPUBLIC OF EGYPT BILL ZERO CPN 18/MAR/2025 0.000% 18-03-2025	0.0 2025/3/18	エジプト 債券 国債・政府機関債 等	331,500,000	81.7049 エジプト・ポンド	883,140,696	0.40
24	DISH DBS CORP SR UNSEC 5.875% 11-15-24	5.875 2024/11/15	米国 債券 社債	5,879,000	94.1777 米ドル	863,836,564	0.39
25	INDIA GOVERNMENT BOND INR 7.18% 07-24-37	7.18 2037/7/24	インド 債券 国債・政府機関債 等	458,000,000	99.1848 インド・ルピー	849,014,234	0.38
26	COMPASS GROUP DIVERSIFIED HOLDINGS LLC 144A LIFE SR UNSEC 5.25% 04-15-29	5.25 2029/4/15	米国 債券 社債	5,649,000	93.981 米ドル	828,307,751	0.37
27	INDONESIA GOVERNMENT IDR 8.25% 05-15-36	8.25 2036/5/15	インドネシア 債券 国債・政府機関債 等	78,762,000,000	108.608 インドネシア・ル ピア	821,054,247	0.37



28	EMIRATE OF ABU DHABI REG S 2.5% 09-30-29	2.5 2029/9/30	アラブ首長国連邦 債券 国債・政府機関債 等	5,920,000	88.1817 米ドル	814,480,043	0.37
29	ROMANIA GOVT BOND EUR REG S 2.124% 07-16-31	2.124 2031/7/16	ルーマニア 債券 国債・政府機関債 等	5,920,000	80.7713 ユーロ	799,823,354	0.36
30	SAUDI INTERNATIONAL BOND REG S 5.0% 01- 16-34	5.0 2034/1/16	サウジアラビア 債券 国債・政府機関債 等	5,300,000	96.3411 米ドル	796,650,336	0.36

(注) 投資比率は、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)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  
2024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449回利付国債(2年)	0.005	2025/6/1	国債	1,100,000	100.006	1,100,066,000	5.45
日本	第452回利付国債(2年)	0.005	2025/9/1	国債	200,000	99.976	199,952,000	0.99
日本	第452回利付国債(2年)	0.005	2025/9/1	国債	500,000	99.976	499,880,000	2.48
日本	第452回利付国債(2年)	0.005	2025/9/1	国債	1,000,000	99.976	999,760,000	4.95
日本	第452回利付国債(2年)	0.005	2025/9/1	国債	1,000,000	99.976	999,760,000	4.95
日本	第453回利付国債(2年)	0.005	2025/10/1	国債	500,000	99.957	499,785,000	2.48
日本	第453回利付国債(2年)	0.005	2025/10/1	国債	1,500,000	99.957	1,499,355,000	7.43
日本	第454回利付国債(2年)	0.100	2025/11/1	国債	400,000	100.123	400,492,000	1.98
日本	第455回利付国債(2年)	0.005	2025/12/1	国債	900,000	99.926	899,334,000	4.45
日本	第455回利付国債(2年)	0.005	2025/12/1	国債	500,000	99.926	499,630,000	2.47
日本	第456回利付国債(2年)	0.100	2026/1/1	国債	1,500,000	100.067	1,501,005,000	7.43
日本	第150回利付国債(5年)	0.005	2026/12/20	国債	1,000,000	99.811	998,110,000	4.94
日本	第151回利付国債(5年)	0.005	2027/3/20	国債	500,000	99.733	498,665,000	2.47
日本	第153回利付国債(5年)	0.005	2027/6/20	国債	500,000	99.627	498,135,000	2.47
日本	第81回神奈川県公募債(5年)	0.020	2025/3/19	地方債	100,000	99.919	99,919,000	0.49
日本	第287回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.091	2026/9/11	特殊債	200,000	99.687	199,374,000	0.99
日本	第68回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.355	2025/1/28	特殊債	100,000	100.245	100,245,000	0.50
日本	第72回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.529	2025/5/28	特殊債	200,000	100.514	201,028,000	1.00
日本	第99回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.225	2027/8/27	特殊債	200,000	99.719	199,438,000	0.99
日本	第35回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2021)	0.279	2026/10/21	社債券	100,000	98.314	98,314,000	0.49
日本	第6回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー(非上位円貨社債)(2019)	1.258	2024/1/25	社債券	100,000	99.997	99,997,000	0.50

日本	第15回クレディ・アグリコル・エス・エー期限前償還条項付非上位円貨社債(2024)	0.000	2028/1/26	社債券	200,000	100.001	200,002,000	0.99
日本	第12回ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー期限前償還条項付円貨社債(2023)	1.377	2027/12/1	社債券	200,000	99.9	199,800,000	0.99
日本	第1回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債(2019)	0.463	2024/12/5	社債券	200,000	99.742	199,484,000	0.99
日本	第24回ルノー円貨社債(2021)	1.540	2024/7/5	社債券	200,000	100.327	200,654,000	0.99
日本	第508回関西電力(一般担保付)	0.455	2027/4/23	社債券	105,000	99.977	104,975,850	0.52
日本	第509回関西電力(一般担保付)	0.470	2027/5/25	社債券	100,000	100.003	100,003,000	0.50
日本	第477回東北電力(一般担保付)	0.741	2025/2/25	社債券	100,000	100.55	100,550,000	0.50
日本	第483回東北電力(一般担保付)	0.300	2026/5/25	社債券	200,000	99.849	199,698,000	0.99
日本	第503回九州電力(一般担保付)	0.360	2027/4/23	社債券	200,000	99.737	199,474,000	0.99
日本	第18回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)	0.340	2025/4/30	社債券	100,000	100.163	100,163,000	0.50
日本	第22回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)	0.130	2025/9/12	社債券	200,000	99.821	199,642,000	0.99
日本	第29回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)	0.210	2025/10/27	社債券	100,000	99.979	99,979,000	0.50
日本	第12回アサヒグループホールディングス(特定社債間限定同順位特約付)	0.330	2027/6/11	社債券	200,000	99.656	199,312,000	0.99
日本	第12回アサヒグループホールディングス(特定社債間限定同順位特約付)	0.330	2027/6/11	社債券	200,000	99.656	199,312,000	0.99
日本	第14回森ビル(社債間限定同順位特約付)	0.861	2024/8/14	社債券	100,000	100.345	100,345,000	0.50
日本	第12回セブン&アイ・ホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.781	2025/6/20	社債券	100,000	100.754	100,754,000	0.50
日本	第14回セブン&アイ・ホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.190	2025/12/19	社債券	100,000	99.774	99,774,000	0.49
日本	第15回セブン&アイ・ホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.280	2027/12/20	社債券	200,000	99.184	198,368,000	0.98
日本	第63回神戸製鋼所(社債間限定同順位特約付)	0.924	2025/5/21	社債券	100,000	100.654	100,654,000	0.50
日本	第67回神戸製鋼所(社債間限定同順位特約付)	0.200	2026/6/10	社債券	100,000	99.245	99,245,000	0.49
日本	第19回日立製作所(社債間限定同順位特約付)	0.160	2027/3/12	社債券	200,000	99.183	198,366,000	0.98
日本	第18回デンソー(社債間限定同順位特約付)	0.315	2028/3/17	社債券	200,000	99.27	198,540,000	0.98
日本	第43回IHI(社債間限定同順位特約付)	0.200	2024/10/17	社債券	100,000	99.875	99,875,000	0.49
日本	第49回IHI(社債間限定同順位特約付)(トランジション・ボンド)	0.390	2027/6/4	社債券	100,000	99.166	99,166,000	0.49
日本	第8回JA三井リース(社債間限定同順位特約付)	0.310	2024/9/13	社債券	100,000	100.062	100,062,000	0.50
日本	第25回JA三井リース(社債間限定同順位特約付)	0.390	2026/9/1	社債券	100,000	99.808	99,808,000	0.49
日本	第27回JA三井リース(社債間限定同順位特約付)	0.430	2027/1/25	社債券	100,000	99.822	99,822,000	0.49
日本	第78回伊藤忠商事(社債間限定同順位特約付)	0.785	2024/5/30	社債券	100,000	100.245	100,245,000	0.50

日本	第19回三井住友信託銀行(社債間限定同順位特約付)	0.140	2026/4/28	社債券	200,000	99.385	198,770,000	0.98
日本	第2回NTTファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.260	2026/12/18	社債券	200,000	99.588	199,176,000	0.99
日本	第16回NTTファイナンス(日本電信電話株式会社保証付)	0.180	2025/12/19	社債券	200,000	99.661	199,322,000	0.99
日本	第80回ホンダファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.260	2026/6/19	社債券	100,000	99.758	99,758,000	0.49
日本	第81回ホンダファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.389	2028/6/20	社債券	200,000	99.238	198,476,000	0.98
日本	第18回SBIホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.690	2024/5/30	社債券	100,000	100.011	100,011,000	0.50
日本	第25回SBIホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.600	2024/7/26	社債券	100,000	99.925	99,925,000	0.49
日本	第29回SBIホールディングス(社債間限定同順位特約付)	1.000	2025/7/22	社債券	100,000	99.995	99,995,000	0.50
日本	第96回トヨタファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.060	2026/4/15	社債券	100,000	99.436	99,436,000	0.49
日本	第100回トヨタファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.370	2026/10/13	社債券	100,000	100.131	100,131,000	0.50
日本	第42回リコーリース(社債間限定同順位特約付)	0.390	2027/6/1	社債券	100,000	99.463	99,463,000	0.49
日本	第17回イオンフィナンシャルサービス(社債間限定同順位特約付)	0.340	2026/7/31	社債券	200,000	99.371	198,742,000	0.98
日本	第20回イオンフィナンシャルサービス(社債間限定同順位特約付)	0.590	2026/2/24	社債券	100,000	100.026	100,026,000	0.50
日本	第69回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	1.210	2024/9/26	社債券	100,000	100.62	100,620,000	0.50
日本	第79回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.290	2025/2/28	社債券	100,000	99.939	99,939,000	0.49
日本	第80回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.280	2026/2/26	社債券	100,000	99.55	99,550,000	0.49
日本	第84回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.550	2026/12/18	社債券	100,000	99.903	99,903,000	0.49
日本	第57回日立キャピタル(社債間限定同順位特約付)	0.616	2024/12/20	社債券	100,000	100.339	100,339,000	0.50
日本	第219回オリックス(社債間限定同順位特約付)	0.430	2026/11/27	社債券	100,000	99.977	99,977,000	0.50
日本	第1回三井住友ファイナンス&リース(社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)	0.170	2025/3/12	社債券	100,000	99.869	99,869,000	0.49
日本	第35回三井住友ファイナンス&リース(社債間限定同順位特約付)	0.709	2028/2/2	社債券	100,000	100.276	100,276,000	0.50
日本	第32回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付)	0.695	2024/10/25	社債券	100,000	100.36	100,360,000	0.50
日本	第75回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付)	0.220	2025/1/23	社債券	100,000	99.947	99,947,000	0.50
日本	第18回大和証券グループ本社(社債間限定同順位特約付)	0.871	2024/8/28	社債券	100,000	100.335	100,335,000	0.50
日本	第40回大和証券グループ本社(社債間限定同順位特約付)	0.575	2026/11/27	社債券	100,000	100.047	100,047,000	0.50
日本	第3回野村ホールディングス(担保提供制限等財務上特約無)	0.280	2026/9/4	社債券	100,000	98.948	98,948,000	0.49
日本	第27回野村ホールディングス	2.107	2025/9/24	社債券	100,000	102.451	102,451,000	0.51
日本	第37回イオンモール(社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)	1.107	2028/12/14	社債券	100,000	100.406	100,406,000	0.50

日本	第184回東日本旅客鉄道(社債間限定同順位特約付)	0.210	2025/10/14	社債券	100,000	99.922	99,922,000	0.49
日本	第184回東日本旅客鉄道(社債間限定同順位特約付)	0.210	2025/10/14	社債券	100,000	99.922	99,922,000	0.49
日本	第6回ファーストリテイリング(特定社債間限定同順位特約付)	0.220	2025/6/6	社債券	100,000	99.93	99,930,000	0.49

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

(注)当該情報は委託会社が入手可能な直近日(2024年1月24日)現在の情報です。

#### 【投資不動産物件】

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース(成長型/米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース(成長型/為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース(分配型年6回決算/米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース(分配型年6回決算/為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

(参考)キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

(参考)キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

(参考)キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(分配型/米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

(参考)キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(分配型)

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース(成長型/米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース(成長型/為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース(分配型年6回決算/米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース(分配型年6回決算/為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

(参考)キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(米ドル売り円買い)

該当事項はありません。

（参考）キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

（参考）キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型／米ドル売り円買い）

該当事項はありません。

（参考）キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型）

該当事項はありません。

### （3）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型／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 (2023年 3月20日)	97,262	97,262	0.9726	0.9726
第2期 (2023年 9月20日)	52,534,915	52,534,915	0.9772	0.9772
第3期 (2024年 3月21日)	67,082,705	67,082,705	1.0129	1.0129
2023年 4月末日	98,971		0.9897	
5月末日	8,384,311		0.9781	
6月末日	12,913,653		0.9960	
7月末日	42,379,904		1.0025	
8月末日	47,659,174		0.9890	
9月末日	61,384,315		0.9581	
10月末日	62,000,180		0.9445	
11月末日	66,304,010		0.9909	
12月末日	68,230,619		1.0197	
2024年 1月末日	73,909,586		1.0102	
2月末日	66,715,307		1.0073	
3月末日	67,089,268		1.0130	
4月末日	65,950,437		0.9958	

(注)表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース（成長型／為替ヘッジなし）

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 (2023年 3月20日)	95,113	95,113	0.9511	0.9511
第2期 (2023年 9月20日)	487,269,871	487,269,871	1.1011	1.1011
第3期 (2024年 3月21日)	1,424,304,353	1,424,304,353	1.2007	1.2007
2023年 4月末日	10,814,840		0.9894	
5月末日	34,933,863		1.0141	
6月末日	89,161,595		1.0685	
7月末日	159,290,152		1.0661	

8月末日	318,502,421		1.0990
9月末日	530,710,117		1.0913
10月末日	591,653,833		1.0802
11月末日	783,231,308		1.1251
12月末日	973,365,007		1.1178
2024年 1月末日	1,104,784,175		1.1612
2月末日	1,328,355,956		1.1868
3月末日	1,487,882,045		1.2042
4月末日	1,604,923,265		1.2252

(注)表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

#### キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算/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特定期間 (2023年 3月20日)	97,351	97,851	0.9735	0.9785
第2特定期間 (2023年 9月20日)	11,531,000	11,566,431	0.9763	0.9793
第3特定期間 (2024年 3月21日)	11,883,112	11,942,170	1.0060	1.0110
2023年 4月末日	11,613,888		0.9833	
5月末日	11,473,070		0.9714	
6月末日	11,688,317		0.9896	
7月末日	11,838,932		1.0024	
8月末日	11,685,686		0.9894	
9月末日	11,299,987		0.9567	
10月末日	11,137,020		0.9429	
11月末日	11,677,787		0.9887	
12月末日	12,015,730		1.0173	
2024年 1月末日	11,887,982		1.0065	
2月末日	11,852,289		1.0035	
3月末日	11,883,711		1.0060	
4月末日	11,682,068		0.9890	

(注)分配付の金額は、特定期間末の金額に特定期間中の各計算期間末の分配金を加算した金額です。

(注)表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

#### キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算/為替ヘッジなし）

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特定期間 (2023年 3月20日)	94,598	95,098	0.9460	0.9510
第2特定期間 (2023年 9月20日)	67,584,409	67,729,880	1.0935	1.0965
第3特定期間 (2024年 3月21日)	129,077,043	129,989,893	1.1845	1.1935
2023年 4月末日	10,842,214		0.9855	
5月末日	42,065,259		1.0108	
6月末日	46,585,615		1.0721	
7月末日	60,032,544		1.0635	

8月末日	66,583,627		1.0930
9月末日	66,988,925		1.0839
10月末日	67,645,550		1.0727
11月末日	97,052,183		1.1169
12月末日	112,719,867		1.1090
2024年 1月末日	116,864,842		1.1498
2月末日	128,032,347		1.1749
3月末日	129,362,411		1.1882
4月末日	150,607,515		1.2087

(注)分配付の金額は、特定期間末の金額に特定期間中の各計算期間末の分配金を加算した金額です。

(注)表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

### 【分配の推移】

#### キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型／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	2022年12月15日～2023年 3月20日	0.0000
第2期	2023年 3月21日～2023年 9月20日	0.0000
第3期	2023年 9月21日～2024年 3月21日	0.0000

#### キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース（成長型／為替ヘッジなし）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2022年12月15日～2023年 3月20日	0.0000
第2期	2023年 3月21日～2023年 9月20日	0.0000
第3期	2023年 9月21日～2024年 3月21日	0.0000

#### キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算／米ドル売り円買い）

期	特定期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	2022年12月15日～2023年 3月20日	0.0050
第2特定期間	2023年 3月21日～2023年 9月20日	0.0030
第3特定期間	2023年 9月21日～2024年 3月21日	0.0050

(注)各特定期間の1口当たりの分配金は、特定期間中の各計算期間末の分配金を加算した金額です。

#### キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算／為替ヘッジなし）

期	特定期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	2022年12月15日～2023年 3月20日	0.0050
第2特定期間	2023年 3月21日～2023年 9月20日	0.0030
第3特定期間	2023年 9月21日～2024年 3月21日	0.0090

(注)各特定期間の1口当たりの分配金は、特定期間中の各計算期間末の分配金を加算した金額です。

### 【収益率の推移】

#### キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型／米ドル売り円買い）

期	計算期間	収益率（％）
第1期	2022年12月15日～2023年 3月20日	2.7

第2期	2023年 3月21日～2023年 9月20日	0.5
第3期	2023年 9月21日～2024年 3月21日	3.7

(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。

#### キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース（成長型／為替ヘッジなし）

期	計算期間	収益率（％）
第1期	2022年12月15日～2023年 3月20日	4.9
第2期	2023年 3月21日～2023年 9月20日	15.8
第3期	2023年 9月21日～2024年 3月21日	9.0

(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。

#### キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算／米ドル売り円買い）

期	特定期間	収益率（％）
第1特定期間	2022年12月15日～2023年 3月20日	2.2
第2特定期間	2023年 3月21日～2023年 9月20日	0.6
第3特定期間	2023年 9月21日～2024年 3月21日	3.6

(注)第1特定期間の収益率は、第1特定期間末の基準価額（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、特定期間末の基準価額（分配付の額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間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。

#### キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算／為替ヘッジなし）

期	特定期間	収益率（％）
第1特定期間	2022年12月15日～2023年 3月20日	4.9
第2特定期間	2023年 3月21日～2023年 9月20日	15.9
第3特定期間	2023年 9月21日～2024年 3月21日	9.1

(注)第1特定期間の収益率は、第1特定期間末の基準価額（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、特定期間末の基準価額（分配付の額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。

#### （４）【設定及び解約の実績】

#### キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型／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	2022年12月15日～2023年 3月20日	100,000		100,000
第2期	2023年 3月21日～2023年 9月20日	53,662,634		53,762,634
第3期	2023年 9月21日～2024年 3月21日	19,399,136	6,931,649	66,230,121

(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。



## キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース（成長型／為替ヘッジなし）

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	2022年12月15日～2023年3月20日	100,000		100,000
第2期	2023年3月21日～2023年9月20日	442,427,630		442,527,630
第3期	2023年9月21日～2024年3月21日	761,484,581	17,752,000	1,186,260,211

(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。

## キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算／米ドル売り円買い）

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

期	特定期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1特定期間	2022年12月15日～2023年3月20日	100,000		100,000
第2特定期間	2023年3月21日～2023年9月20日	11,711,039		11,811,039
第3特定期間	2023年9月21日～2024年3月21日	1,283		11,812,322

(注)第1特定期間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。

## キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算／為替ヘッジなし）

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

期	特定期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1特定期間	2022年12月15日～2023年3月20日	100,000		100,000
第2特定期間	2023年3月21日～2023年9月20日	61,704,774		61,804,774
第3特定期間	2023年9月21日～2024年3月21日	50,868,095	3,697,334	108,975,535

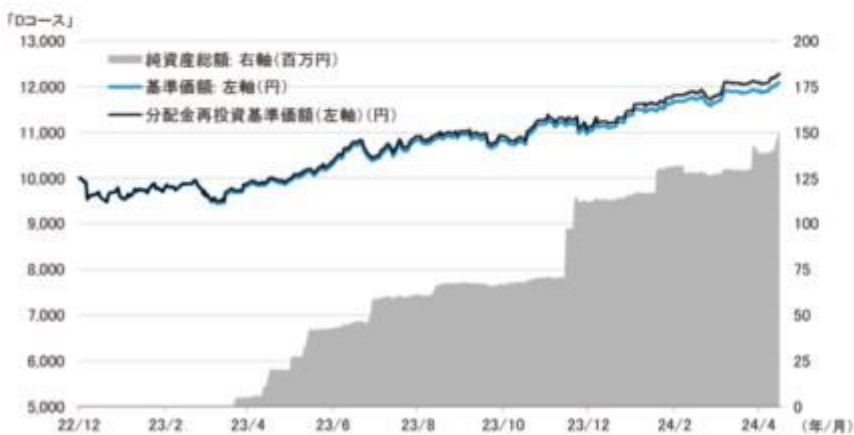
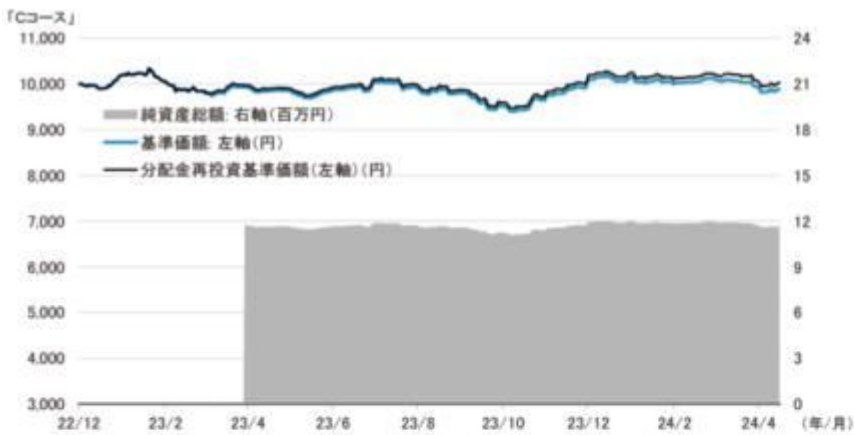
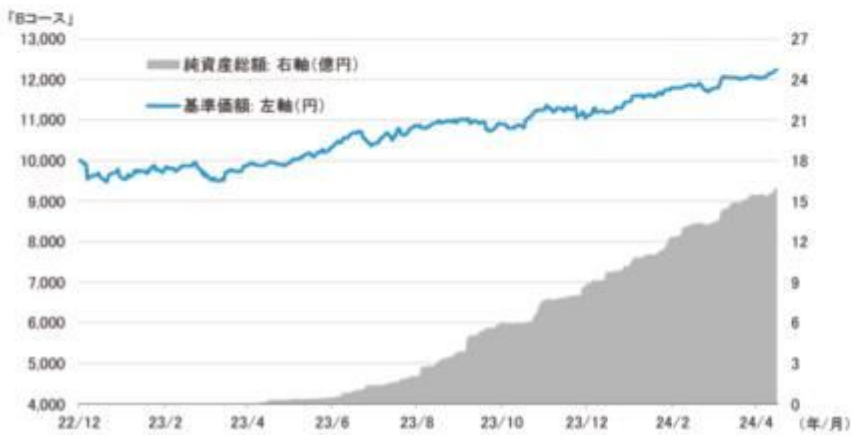
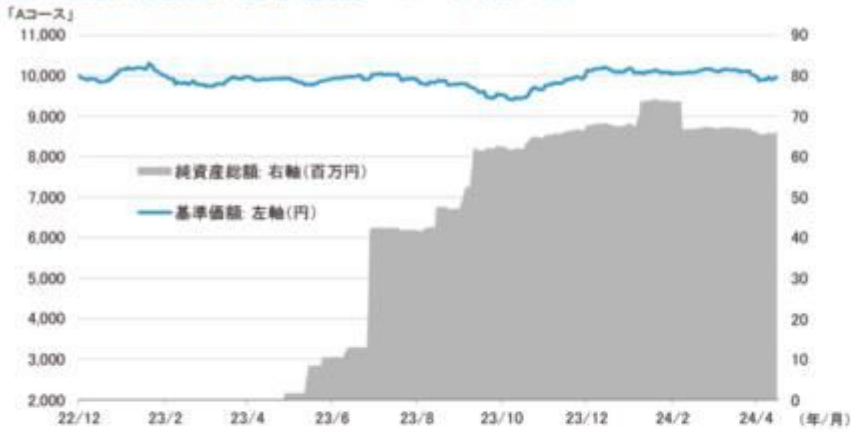
(注)第1特定期間の設定口数には当初申込期間中の設定口数を含みます。

(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

2024年4月30日現在

## 基準価額・純資産の推移(設定～2024年4月30日)



## 分配金の推移

第3期	2024年3月	0円
第2期	2023年9月	0円
第1期	2023年3月	0円
	設定来累計	0円
	分配金は1万口当たり、税引前	

第3期	2024年3月	0円
第2期	2023年9月	0円
第1期	2023年3月	0円
	設定来累計	0円
	分配金は1万口当たり、税引前	

第7期	2024年3月	30円
第6期	2024年1月	10円
第5期	2023年11月	10円
第4期	2023年9月	10円
第3期	2023年7月	10円
	設定来累計	130円
	分配金は1万口当たり、税引前	

第7期	2024年3月	50円
第6期	2024年1月	30円
第5期	2023年11月	10円
第4期	2023年9月	10円
第3期	2023年7月	10円
	設定来累計	170円
	分配金は1万口当たり、税引前	

## 主要な資産の状況(2024年4月30日現在)

「Aコース」

＜キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(米ドル売り円買い)の主要な資産の状況等＞

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ(LUX)(クラスCh-JPY)	99.89
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.01

「Bコース」

＜キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(為替ヘッジなし)の主要な資産の状況等＞

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ(LUX)(クラスC)	99.92
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.00

「Cコース」

＜キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(分配型/米ドル売り円買い)の主要な資産の状況等＞

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ(LUX)(クラスCfdmh-JPY)	99.81
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.04

「Dコース」

＜キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド(分配型)の主要な資産の状況等＞

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ(LUX)(クラスCfdm)	99.85
2	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	0.00

＜各コースが実質的に投資するキャピタル・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)の主要な資産の状況等＞ (2024年4月30日現在)

上位10銘柄

順位	銘柄名	国名/地域名	証券種別	投資比率(%)
1	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA ZAR 8.875% 02-28-35	南アフリカ	国債・政府機関債等	1.29
2	POLAND GOVERNMENT BOND PLN 6.0% 10-25-33	ポーランド	国債・政府機関債等	1.20
3	ROTECH HEALTHCARE INC.	米国	株式	1.14
4	BONOS MEXICAN MXN 8.5% 11-18-38	メキシコ	国債・政府機関債等	0.85
5	NOTA DO TESOURO NACIONAL BRL 10.0% 01-01-29	ブラジル	国債・政府機関債等	0.78
6	BRAZIL NTNB BRL 10.0% 01-01-31	ブラジル	国債・政府機関債等	0.69
7	COLOMBIA COLTES COP 9.25% 05-28-42	コロンビア	国債・政府機関債等	0.68
8	STATE OF ISRAEL 5.5% 03-12-34	イスラエル	国債・政府機関債等	0.65
9	BRAZIL NTNB BRL 1/L 6.0% 08-15-50	ブラジル	国債・政府機関債等	0.63
10	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS III BV SR UNSEC 5.125% 05-09-28	イスラエル	社債	0.58

資産別構成比率

証券種別	投資比率(%)
社債	56.25
国債・政府機関債等	35.49
その他債券	0.26
株式	1.74
現金・その他	6.26

国別構成比率

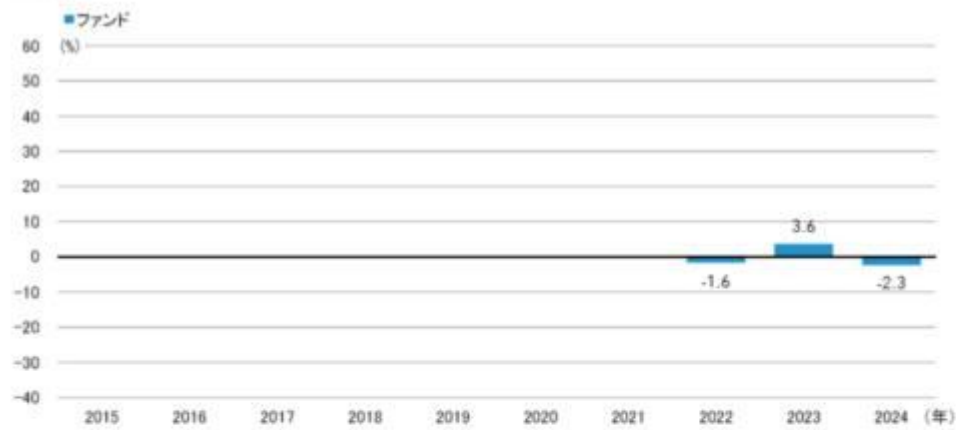
国名	投資比率(%)
米国	42.01
メキシコ	5.57
ブラジル	4.30
南アフリカ	2.97
インドネシア	2.86
その他国	36.04
現金・その他	6.26

通貨別構成比率

通貨名	投資比率(%)
米ドル	70.85
ユーロ	3.37
ブラジル・レアル	2.80
インドネシア・ルピア	2.61
メキシコ・ペソ	2.59
その他通貨	11.52
現金・その他	6.26

## 年間収益率の推移

「Aコース」

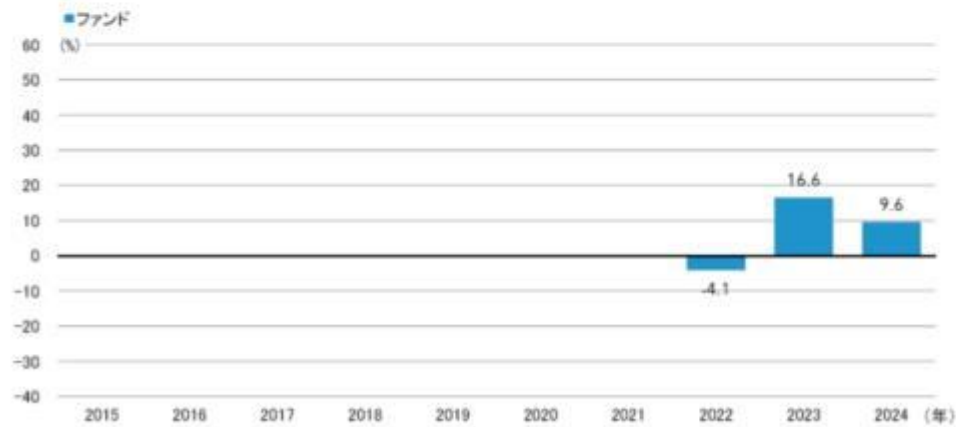


ファンドにはベンチマークはありません。

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しています。

2022年は設定日(2022年12月15日)から年末までの収益率を表示。2024年は年初から4月末までの収益率を表示。

「Bコース」

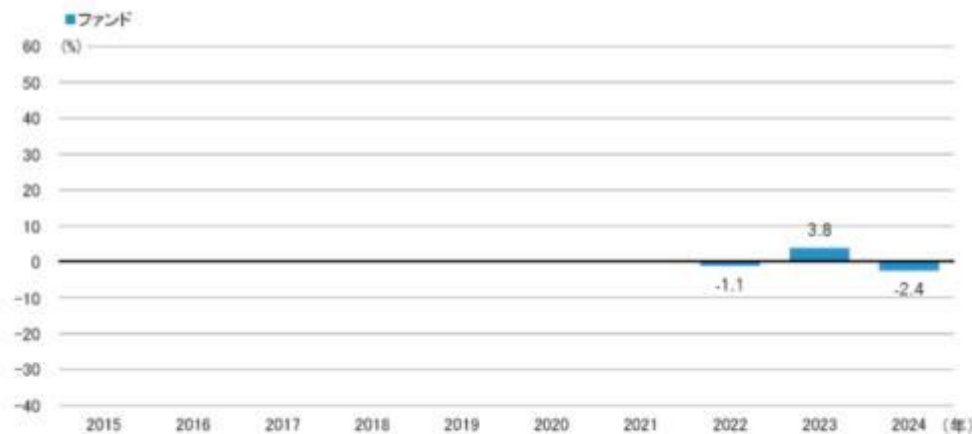


ファンドにはベンチマークはありません。

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しています。

2022年は設定日(2022年12月15日)から年末までの収益率を表示。2024年は年初から4月末までの収益率を表示。

「Cコース」

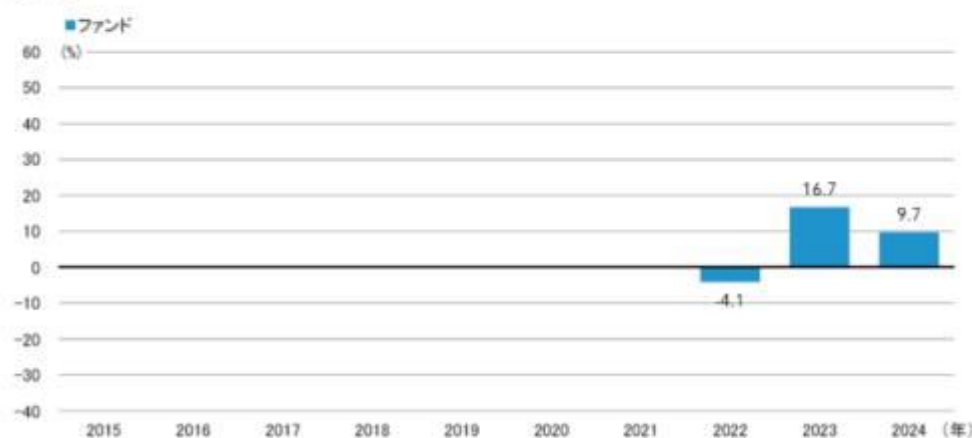


ファンドにはベンチマークはありません。

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しています。

2022年は設定日(2022年12月15日)から年末までの収益率を表示。2024年は年初から4月末までの収益率を表示。

「Dコース」



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しています。

2022年は設定日(2022年12月15日)から年末までの収益率を表示。2024年は年初から4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2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

（前略）

（2）取得の申込みの受付は、申込不可日（\*1）を除く販売会社の営業日（\*2）に行なわれます。

（中略）

（\*2）原則として、午後3時までに取得の申込みが行なわれ、かつ当該申込の受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを、当日の受付分とします。この受付時間を過ぎてからの取得の受付は、特に指定がない場合、翌営業日の取扱いとなります。

（以下略）

<訂正後>

（前略）

（2）取得の申込みの受付は、申込不可日（\*1）を除く販売会社の営業日（\*2）に行なわれます。

（中略）

（\*2）原則として、午後3時までに取得の申込みが行なわれ、かつ当該申込の受付にかかる販売会社所

定の事務手続きが完了したものを、当日の受付分とします(2024年11月5日からは、原則として午後3時30分までに取得の申込みが行なわれ、かつ当該申込の受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを、当日の受付分とします。)。この受付時間を過ぎてからの取得の受付は、特に指定がない場合、翌営業日の取扱いとなります。

(以下略)

## 2【換金(解約)手続等】

<訂正前>

(前略)

(2)換金の申込みの受付は、申込不可日(\*1)を除く販売会社の営業日(\*2)に行なわれます。

(中略)

(\*2)原則として、午後3時までに換金の申込みが行なわれ、かつ当該換金の受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを、当日の受付分とします。この受付時間を過ぎてからの換金の受付は、特に指定がない場合、翌営業日の取扱いとなります。

(以下略)

<訂正後>

(前略)

(2)換金の申込みの受付は、申込不可日(\*1)を除く販売会社の営業日(\*2)に行なわれます。

(中略)

(\*2)原則として、午後3時までに換金の申込みが行なわれ、かつ当該換金の受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを、当日の受付分とします(2024年11月5日からは、原則として午後3時30分までに換金の申込みが行なわれ、かつ当該申込の受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを、当日の受付分とします。)。この受付時間を過ぎてからの換金の受付は、特に指定がない場合、翌営業日の取扱いとなります。

(以下略)

### 第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型/米ドル売り円買い）  
キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース（成長型/為替ヘッジなし）

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2023年9月21日から2024年3月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算/米ドル売り円買い）  
キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算/為替ヘッジなし）

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
- (3) 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、当特定期間（2023年9月21日から2024年3月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

### 1【財務諸表】

【キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型/米ドル売り円買い）】

#### (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2023年9月20日現在	第3期 2024年3月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	163,261	457,816
親投資信託受益証券	52,487,681	67,078,695
未収入金	42,000	82,000
流動資産合計	52,692,942	67,618,511
資産合計	52,692,942	67,618,511
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	2,152	7,306
未払委託者報酬	151,022	511,941
その他未払費用	4,853	16,559

	第2期 2023年9月20日現在	第3期 2024年3月21日現在
流動負債合計	158,027	535,806
負債合計	158,027	535,806
純資産の部		
元本等		
元本	53,762,634	66,230,121
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,227,719	852,584
元本等合計	52,534,915	67,082,705
純資産合計	52,534,915	67,082,705
負債純資産合計	52,692,942	67,618,511

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	第3期 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	376,581	3,063,014
営業収益合計	376,581	3,063,014
営業費用		
支払利息	155	145
受託者報酬	2,152	7,306
委託者報酬	151,022	511,941
その他費用	4,874	16,559
営業費用合計	158,203	535,951
営業利益又は営業損失（ ）	534,784	2,527,063
経常利益又は経常損失（ ）	534,784	2,527,063
当期純利益又は当期純損失（ ）	534,784	2,527,063
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-	197,546
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,738	1,227,719
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	154,570
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	154,570
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	690,197	403,784
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	690,197	403,784
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,227,719	852,584

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として毎年3月21日から9月20日、9月21日から翌年3月20日までとなっておりますが、第3期計算期間は信託約款の定めにより、2023年9月21日から2024年3月21日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期 2023年9月20日現在	第3期 2024年3月21日現在
1. 当該計算期間の末日における受益権の総数	53,762,634口	66,230,121口



項目	第2期 2023年9月20日現在		第3期 2024年3月21日現在	
	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	1,227,719円	元本の欠損
3. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9772円 (9,772円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0129円 (10,129円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日			第3期 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	1,843,442円
収益調整金額	C	- 円	収益調整金額	C	- 円
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	- 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,843,442円
当ファンドの期末残存口数	F	53,762,634口	当ファンドの期末残存口数	F	66,230,121口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	- 円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	278.33円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日		第3期 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日	
	1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に基づき、有価証券等の金融商品に対して投資を行います。		同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(4)附属明細表」に記載しております。なお、当ファンドが実質保有する金融商品の種類から、当ファンドは、組入証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク、及びカウンターリスクに晒されております。		同左	
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	委託会社において次の独立した組織によりリスク管理に取り組んでおります。 投資委員会は、運用内容が投資目的に則しているかを確認します。 法務コンプライアンス部は、運用状況についてファンドの基本方針及び運用計画等に基づくモニタリングを行い、管理徹底を図っております。 オペレーション部は、発注の適正な執行及び決済を図り、管理徹底に努めております。 なお、問題が生じた場合には、関係部署等が速やかに協議を行ない訂正処理等の必要な措置を講じます。		同左	
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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	

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日		第3期 自 2023年9月21日 至 2024年3月21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。		同左
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券		(1)親投資信託受益証券	

項目	第2期 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	第3期 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
		「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第2期 2023年9月20日現在	第3期 2024年3月21日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	373,759	2,817,456
合計	373,759	2,817,456

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 当ファンドの計算期間における元本額の変動

項目	第2期 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	第3期 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
	期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	53,662,634円	19,399,136円
期中一部解約元本額	- 円	6,931,649円

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## 株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（米ドル売り円買い）	50,492,055	67,078,695	
合計		50,492,055	67,078,695	

(注)券面総額の数値は受益証券の口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース（成長型／為替ヘッジなし）】

## (1)【貸借対照表】

	第2期 2023年9月20日現在	第3期 2024年3月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	99,898,574	58,214,389
親投資信託受益証券	388,282,317	1,373,314,578
未収入金	-	100,000
未収利息	-	15
流動資産合計	488,180,891	1,431,628,982
資産合計	488,180,891	1,431,628,982
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	12,428	99,960
未払委託者報酬	870,124	6,997,536
未払利息	273	-
その他未払費用	28,195	227,133
流動負債合計	911,020	7,324,629
負債合計	911,020	7,324,629
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	442,527,630	1,186,260,211
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	44,742,241	238,044,142
元本等合計	487,269,871	1,424,304,353
純資産合計	487,269,871	1,424,304,353
負債純資産合計	488,180,891	1,431,628,982

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第2期 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	第3期 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	15
有価証券売買等損益	12,755,207	98,832,261
営業収益合計	12,755,207	98,832,276
<b>営業費用</b>		
支払利息	2,405	6,235
受託者報酬	12,428	99,960
委託者報酬	870,124	6,997,536
その他費用	28,198	227,238
営業費用合計	913,155	7,330,969
営業利益又は営業損失（ ）	11,842,052	91,501,307
経常利益又は経常損失（ ）	11,842,052	91,501,307
当期純利益又は当期純損失（ ）	11,842,052	91,501,307
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-	995,631
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,887	44,742,241
剰余金増加額又は欠損金減少額	32,905,076	104,939,585
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	32,905,076	104,939,585
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	2,143,360
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	2,143,360
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	44,742,241	238,044,142

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として毎年3月21日から9月20日、9月21日から翌年3月20日までとなっておりますが、第3期計算期間は信託約款の定めにより、2023年9月21日から2024年3月21日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期 2023年9月20日現在	第3期 2024年3月21日現在
1. 当該計算期間の末日における受益権の総数	442,527,630口	1,186,260,211口
2. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1011円 (11,011円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2007円 (12,007円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日			第3期 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	11,841,391円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	90,513,026円
収益調整金額	C	32,911,641円	収益調整金額	C	135,875,795円
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	11,655,321円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	44,753,032円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	238,044,142円
当ファンドの期末残存口数	F	442,527,630口	当ファンドの期末残存口数	F	1,186,260,211口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,011.29円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,006.66円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	第3期 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に基づき、有価証券等の金融商品に対して投資を行います。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(4)附属明細表」に記載しております。なお、当ファンドが実質保有する金融商品の種類から、当ファンドは、組入証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク、及びカウンターリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	委託会社において次の独立した組織によりリスク管理に取り組んでおります。 投資委員会は、運用内容が投資目的に則しているかを確認します。 法務コンプライアンス部は、運用状況についてファンドの基本方針及び運用計画等に基づくモニタリングを行い、管理徹底を図っております。 オペレーション部は、発注の適正な執行及び決済を図り、管理徹底に努めております。 なお、問題が生じた場合には、関係部署等が速やかに協議を行ない訂正処理等の必要な措置を講じます。	同左

項目	第2期	第3期
	自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期	第3期
	自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	自 2023年9月21日 至 2024年3月21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。	同左
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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	2023年9月20日現在	2024年3月21日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	12,755,207	98,270,181
合計	12,755,207	98,270,181

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 当ファンドの計算期間における元本額の変動

項目	第2期	第3期
	自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
期首元本額	100,000円	442,527,630円
期中追加設定元本額	442,427,630円	761,484,581円
期中一部解約元本額	- 円	17,752,000円

## (4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表  
株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（為替ヘッジなし）	1,121,805,733	1,373,314,578	
	合計	1,121,805,733	1,373,314,578	

(注) 券面総額の数値は受益証券の口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

【キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算/米ドル売り円買い）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2特定期間 2023年9月20日現在	第3特定期間 2024年3月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	11,973	4,979
親投資信託受益証券	11,522,659	11,874,402
未収入金	40,000	70,000
流動資産合計	11,574,632	11,949,381
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	11,811	35,436
未払受託者報酬	434	416
未払委託者報酬	30,424	29,473
その他未払費用	963	944
流動負債合計	43,632	66,269
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	11,811,039	11,812,322
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	280,039	70,790
元本等合計	11,531,000	11,883,112
<b>負債純資産合計</b>		
	11,574,632	11,949,381

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2特定期間 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	第3特定期間 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	66,192	503,743
営業収益合計	66,192	503,743
<b>営業費用</b>		
支払利息	31	-
受託者報酬	1,121	1,283
委託者報酬	78,441	89,715
その他費用	2,474	2,863
営業費用合計	82,067	93,861
営業利益又は営業損失( )	148,259	409,882
経常利益又は経常損失( )	148,259	409,882
当期純利益又は当期純損失( )	148,259	409,882
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	-	-
期首剰余金又は期首欠損金( )	2,649	280,039
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	5

	第2特定期間	第3特定期間
	自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	5
剰余金減少額又は欠損金増加額	93,700	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	93,700	-
分配金	35,431	59,058
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	280,039	70,790

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間及び特定期間 当ファンドの計算期間は、原則として毎年1月21日から3月20日まで、3月21日から5月20日まで、5月21日から7月20日まで、7月21日から9月20日まで、9月21日から11月20日まで、11月21日から翌年1月20日までとなっております。また、特定期間は、原則として毎年3月21日から9月20日、9月21日から翌年3月20日までとなっておりますが、当特定期間は信託約款の定めにより、2023年9月21日から2024年3月21日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2特定期間 2023年9月20日現在	第3特定期間 2024年3月21日現在
1. 当該特定期間の末日における受益権の総数	11,811,039口	11,812,322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 280,039円	元本の欠損 - 円
3. 当該特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.9763円 (9,763円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0060円 (10,060円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2特定期間 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日			第3特定期間 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日		
分配金の計算過程 第2期 自 2023年3月21日 至 2023年5月22日			分配金の計算過程 第5期 自 2023年9月21日 至 2023年11月20日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	44,357円	費用控除後の配当等収益額	A	99,215円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	13,669円	収益調整金額	C	13,672円
分配準備積立金額	D	113円	分配準備積立金額	D	244,649円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	58,139円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	357,536円
当ファンドの期末残存口数	F	11,810,849口	当ファンドの期末残存口数	F	11,811,143口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	49.21円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	302.69円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	11,810円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	11,811円
第3期 自 2023年5月23日 至 2023年7月20日			第6期 自 2023年11月21日 至 2024年1月22日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	118,450円	費用控除後の配当等収益額	A	119,261円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	20,338円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	13,669円	収益調整金額	C	13,675円
分配準備積立金額	D	32,660円	分配準備積立金額	D	332,053円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	185,117円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	464,989円
当ファンドの期末残存口数	F	11,810,953口	当ファンドの期末残存口数	F	11,811,247口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	156.71円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	393.66円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	11,810円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	11,811円

第4期			第7期		
自 2023年7月21日 至 2023年9月20日			自 2024年1月23日 至 2024年3月21日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	96,822円	費用控除後の配当等収益額	A	102,311円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	13,670円	収益調整金額	C	13,721円
分配準備積立金額	D	159,638円	分配準備積立金額	D	439,503円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	270,130円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	555,535円
当ファンドの期末残存口数	F	11,811,039口	当ファンドの期末残存口数	F	11,812,322口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	228.69円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	470.28円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	30円
収益分配金額	I=F × H/10,000	11,811円	収益分配金額	I=F × H/10,000	35,436円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2特定期間 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	第3特定期間 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に基づき、有価証券等の金融商品に対して投資を行います。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(4)附属明細表」に記載しております。なお、当ファンドが実質保有する金融商品の種類から、当ファンドは、組入証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク、及びカウンターリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	委託会社において次の独立した組織によりリスク管理に取り組んでおります。投資委員会は、運用内容が投資目的に則しているかを確認します。法務コンプライアンス部は、運用状況についてファンドの基本方針及び運用計画等に基づくモニタリングを行い、管理徹底を図っております。オペレーション部は、発注の適正な執行及び決済を図り、管理徹底に努めております。なお、問題が生じた場合には、関係部署等が速やかに協議を行ない訂正処理等の必要な措置を講じます。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2特定期間 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	第3特定期間 自 2023年9月21日 至 2024年3月21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	同左
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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

第2特定期間 2023年9月20日現在	第3特定期間 2024年3月21日現在



種類	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	301,352	95,376
合計	301,352	95,376

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

当ファンドの特定期間における元本額の変動

項目	第2特定期間 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	第3特定期間 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
期首元本額	100,000円	11,811,039円
期中追加設定元本額	11,711,039円	1,283円
期中一部解約元本額	-円	-円

## （４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表  
株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型／米ドル売り円買い）	11,354,372	11,874,402	
	合計	11,354,372	11,874,402	

（注）券面総額の数値は受益証券の口数を表示しております。

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算／為替ヘッジなし）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2特定期間 2023年9月20日現在	第3特定期間 2024年3月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	133,223	182,468
親投資信託受益証券	67,559,655	129,037,108
未収入金	125,000	731,000
流動資産合計	67,817,878	129,950,576
資産合計	67,817,878	129,950,576
負債の部		
流動負債		

	第2特定期間 2023年9月20日現在	第3特定期間 2024年3月21日現在
未払収益分配金	61,804	544,877
未払受託者報酬	2,347	4,485
未払委託者報酬	164,012	314,000
その他未払費用	5,306	10,171
流動負債合計	233,469	873,533
負債合計	233,469	873,533
純資産の部		
元本等		
元本	61,804,774	108,975,535
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,779,635	20,101,508
元本等合計	67,584,409	129,077,043
純資産合計	67,584,409	129,077,043
負債純資産合計	67,817,878	129,950,576

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2特定期間 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	第3特定期間 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	5,427,299	10,411,453
営業収益合計	5,427,299	10,411,453
営業費用		
支払利息	331	241
受託者報酬	4,292	10,989
委託者報酬	300,350	769,439
その他費用	9,724	24,920
営業費用合計	314,697	805,589
営業利益又は営業損失（ ）	5,112,602	9,605,864
経常利益又は経常損失（ ）	5,112,602	9,605,864
当期純利益又は当期純損失（ ）	5,112,602	9,605,864
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-	69,251
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,402	5,779,635
剰余金増加額又は欠損金減少額	817,906	6,245,944
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	817,906	6,245,944
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	547,834
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	547,834
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	145,471	912,850
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,779,635	20,101,508

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間及び特定期間 当ファンドの計算期間は、原則として毎年1月21日から3月20日まで、3月21日から5月20日まで、5月21日から7月20日まで、7月21日から9月20日まで、9月21日から11月20日まで、11月21日から翌年1月20日までとなっております。また、特定期間は、原則として毎年3月21日から9月20日、9月21日から翌年3月20日までとなっておりますが、当特定期間は信託約款の定めにより、2023年9月21日から2024年3月21日までとなっております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	第2特定期間 2023年9月20日現在	第3特定期間 2024年3月21日現在
1. 当該特定期間の末日における受益権の総数	61,804,774口	108,975,535口
2. 当該特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0935円 (1万口当たり純資産額) (10,935円)	1.1845円 (1万口当たり純資産額) (11,845円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

第2特定期間 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日			第3特定期間 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日		
分配金の計算過程 第2期 自 2023年3月21日 至 2023年5月22日			分配金の計算過程 第5期 自 2023年9月21日 至 2023年11月20日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	56,478円	費用控除後の配当等収益額	A	672,961円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	393,786円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	927,597円
収益調整金額	C	58,198円	収益調整金額	C	1,115,955円
分配準備積立金額	D	84円	分配準備積立金額	D	4,961,729円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	508,546円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,678,242円
当ファンドの期末残存口数	F	27,218,285口	当ファンドの期末残存口数	F	63,059,972口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	186.83円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,217.57円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	27,218円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	63,059円
第3期 自 2023年5月23日 至 2023年7月20日			第6期 自 2023年11月21日 至 2024年1月22日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	452,413円	費用控除後の配当等収益額	A	1,007,351円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	1,889,746円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	2,428,665円
収益調整金額	C	641,584円	収益調整金額	C	5,849,476円
分配準備積立金額	D	423,130円	分配準備積立金額	D	6,499,228円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,406,873円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,784,720円
当ファンドの期末残存口数	F	56,449,275口	当ファンドの期末残存口数	F	101,638,230口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	603.49円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,553.00円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	56,449円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	304,914円
第4期 自 2023年7月21日 至 2023年9月20日			第7期 自 2024年1月23日 至 2024年3月21日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	623,825円	費用控除後の配当等収益額	A	1,264,609円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	1,690,868円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額	B	3,235,430円
収益調整金額	C	987,814円	収益調整金額	C	7,348,518円
分配準備積立金額	D	2,708,840円	分配準備積立金額	D	9,314,302円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,011,347円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	21,162,859円
当ファンドの期末残存口数	F	61,804,774口	当ファンドの期末残存口数	F	108,975,535口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	972.61円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,941.96円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	61,804円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	544,877円

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2特定期間 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	第3特定期間 自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に基づき、有価証券等の金融商品に対して投資を行います。	同左

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2特定期間 自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	第3特定期間 自 2023年9月21日 至 2024年3月21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。	同左
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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第2特定期間 2023年9月20日現在	第3特定期間 2024年3月21日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,487,414	4,816,853
合計	2,487,414	4,816,853

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

当ファンドの特定期間における元本額の変動

項目	第2特定期間	第3特定期間
	自 2023年3月21日 至 2023年9月20日	自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
期首元本額	100,000円	61,804,774円
期中追加設定元本額	61,704,774円	50,868,095円
期中一部解約元本額	- 円	3,697,334円

## (4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表  
株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型）	104,942,346	129,037,108	
合計		104,942,346	129,037,108	

(注) 券面総額の数値は受益証券の口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

## キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（米ドル売り円買い）

「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型/米ドル売り円買い）」は、「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（米ドル売り円買い）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

## 貸借対照表

(単位：円)

2024年3月21日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	49,564,058
投資信託受益証券	4,070,155
投資証券	21,774,494,207
未収利息	13
流動資産合計	21,828,128,433
資産合計	21,828,128,433
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	20,000,000
未払解約金	82,000
流動負債合計	20,082,000
負債合計	20,082,000
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	16,416,026,723
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,392,019,710
元本等合計	21,808,046,433

2024年3月21日現在

純資産合計	21,808,046,433
負債純資産合計	21,828,128,433

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 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 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	2024年3月21日現在	
1. 計算日における受益権の総数		16,416,026,723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 (1万口当たり純資産額)	1.3285円 (13,285円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に基づき、有価証券等の金融商品に対して投資を行います。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。なお、当ファンドが実質保有する金融商品の種類から、当ファンドは、組入証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク、及びカントリーリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	委託会社において次の独立した組織によりリスク管理に取り組んでおります。投資委員会は、運用内容が投資目的に則しているかを確認します。 法務コンプライアンス部は、運用状況についてファンドの基本方針及び運用計画等に基づくモニタリングを行い、管理徹底を図っております。 オペレーション部は、発注の適正な執行及び決済を図り、管理徹底に努めております。 なお、問題が生じた場合には、関係部署等が速やかに協議を行ない訂正処理等の必要な措置を講じます。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	自 2023年9月21日 至 2024年3月21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>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年3月21日現在	
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		4,275
投資証券		792,374,509
合計		792,370,234

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

項目	2024年3月21日現在
同計算期間の期首元本額	23,104,820,851円
同計算期間の追加設定元本額	3,566,153,573円
同計算期間の一部解約元本額	10,254,947,701円
計算日の元本額	16,416,026,723円
元本額の内訳	
キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドF（米ドル売り円買い）	16,365,534,668円
キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型/米ドル売り円買い）	50,492,055円

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### 株式

該当事項はありません。

#### 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
投資信託受益証券	日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）	3,887,074.00	4,070,155	
投資信託受益証券 合計		3,887,074.00	4,070,155	
投資証券	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）（クラスCh-JPY）	3,460,663.415	21,774,494,207	
投資証券 合計		3,460,663.415	21,774,494,207	
合計		7,347,737.415	21,778,564,362	

(注)券面総額の数値は受益証券の口数を表示しております。

### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（為替ヘッジなし）

「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース（成長型/為替ヘッジなし）」は、「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（為替ヘッジなし）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

## 貸借対照表

(単位：円)

2024年3月21日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	22,281,801
投資信託受益証券	4,998
投資証券	16,452,671,738
未収利息	6
流動資産合計	16,474,958,543
資産合計	16,474,958,543
負債の部	
流動負債	
未払金	10,000,000
未払解約金	100,000
流動負債合計	10,100,000
負債合計	10,100,000
純資産の部	
元本等	
元本	13,449,635,914
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,015,222,629
元本等合計	16,464,858,543
純資産合計	16,464,858,543
負債純資産合計	16,474,958,543

## 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	2024年3月21日現在
1. 計算日における受益権の総数	13,449,635,914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 1.2242円 (1万口当たり純資産額) (12,242円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に基づき、有価証券等の金融商品に対して投資を行います。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。なお、当ファンドが実質保有する金融商品の種類から、当ファンドは、組入証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク、及びカントリーリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	委託会社において次の独立した組織によりリスク管理に取り組んでおります。 投資委員会は、運用内容が投資目的に則しているかを確認します。 法務コンプライアンス部は、運用状況についてファンドの基本方針及び運用計画等に基づくモニタリングを行い、管理徹底を図っております。 オペレーション部は、発注の適正な執行及び決済を図り、管理徹底に努めております。 なお、問題が生じた場合には、関係部署等が速やかに協議を行ない訂正処理等の必要な措置を講じます。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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る場合、当該価額が異なることもあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項



項目	自 2023年9月21日 至 2024年3月21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	(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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年3月21日現在	
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券		2
投資証券		782,104,454
合計		782,104,452

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

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

項目	2024年3月21日現在
同計算期間の期首元本額	349,580,753円
同計算期間の追加設定元本額	13,146,625,215円
同計算期間の一部解約元本額	46,570,054円
計算日の元本額	13,449,635,914円
元本額の内訳	
キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース(成長型/為替ヘッジなし)	1,121,805,733円
キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドF	12,327,830,181円

## 附属明細表

第1 有価証券明細表  
株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	4,774.00	4,998	
投資信託受益証券 合計		4,774.00	4,998	
投資証券	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)(クラスC)	1,721,530.997	16,452,671,738	
投資証券 合計		1,721,530.997	16,452,671,738	
	合計	1,726,304.997	16,452,676,736	

(注)券面総額の数値は受益証券の口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型／米ドル売り円買い）

「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算／米ドル売り円買い）」は、「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型／米ドル売り円買い）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

開示対象ファンドの計算期間末日及び特定期間末日（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）

2024年3月21日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	86,376
投資信託受益証券	4,998
投資証券	11,852,910
流動資産合計	11,944,284
資産合計	11,944,284
負債の部	
流動負債	
未払解約金	70,000
流動負債合計	70,000
負債合計	70,000
純資産の部	
元本等	
元本	11,354,372
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	519,912
元本等合計	11,874,284
純資産合計	11,874,284
負債純資産合計	11,944,284

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	2024年3月21日現在	
1. 計算日における受益権の総数		11,354,372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 (1万口当たり純資産額)	1.0458円 (10,458円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に基づき、有価証券等の金融商品に対して投資を行います。

項目	自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。なお、当ファンドが実質保有する金融商品の種類から、当ファンドは、組入証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク、及びカントリーリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	委託会社において次の独立した組織によりリスク管理に取り組んでおります。 投資委員会は、運用内容が投資目的に則しているかを確認します。 法務コンプライアンス部は、運用状況についてファンドの基本方針及び運用計画等に基づくモニタリングを行い、管理徹底を図っております。 オペレーション部は、発注の適正な執行及び決済を図り、管理徹底に努めております。 なお、問題が生じた場合には、関係部署等が速やかに協議を行ない訂正処理等の必要な措置を講じます。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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る場合、当該価額が異なることもあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	自 2023年9月21日 至 2024年3月21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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年3月21日現在	
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		2
投資証券		268,437
合計		268,439

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

開示対象ファンドの計算期間及び特定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	2024年3月21日現在
同計算期間及び特定期間の期首元本額	11,501,956円
同計算期間及び特定期間の追加設定元本額	- 円
同計算期間及び特定期間の一部解約元本額	147,584円
計算日の元本額	11,354,372円
元本額の内訳	
キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算/米ドル売り円買い）	11,354,372円

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表 株式

該当事項はありません。

### 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
投資信託受益証券	日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）	4,774.00	4,998	
投資信託受益証券 合計		4,774.00	4,998	
投資証券	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）（クラスCfdmh-JPY）	1,620.8	11,852,910	
投資証券 合計		1,620.8	11,852,910	
合計		6,394.8	11,857,908	

(注) 券面総額の数値は受益証券の口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型）

「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算ノ為替ヘッジなし）」は、「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

開示対象ファンドの計算期間末日及び特定期間末日（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）

2024年3月21日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	921,422
投資信託受益証券	4,998
投資証券	128,841,264
流動資産合計	129,767,684
資産合計	129,767,684
負債の部	
流動負債	
未払解約金	731,000
流動負債合計	731,000
負債合計	731,000
純資産の部	
元本等	
元本	104,942,346
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	24,094,338
元本等合計	129,036,684
純資産合計	129,036,684
負債純資産合計	129,767,684

### 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	2024年3月21日現在	
1. 計算日における受益権の総数		104,942,346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 (1万口当たり純資産額)	1.2296円 (12,296円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年9月21日 至 2024年3月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に基づき、有価証券等の金融商品に対して投資を行います。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。なお、当ファンドが実質保有する金融商品の種類から、当ファンドは、組入証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク、及びカントリーリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	委託会社において次の独立した組織によりリスク管理に取り組んでおります。 投資委員会は、運用内容が投資目的に則しているかを確認します。 法務コンプライアンス部は、運用状況についてファンドの基本方針及び運用計画等に基づくモニタリングを行い、管理徹底を図っております。 オペレーション部は、発注の適正な執行及び決済を図り、管理徹底に努めております。 なお、問題が生じた場合には、関係部署等が速やかに協議を行ない訂正処理等の必要な措置を講じます。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	自 2023年9月21日 至 2024年3月21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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年3月21日現在	
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		2
投資証券		10,998,274
合計		10,998,272

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）  
該当事項はありません。

（その他の注記）

開示対象ファンドの計算期間及び特定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	2024年3月21日現在
同計算期間及び特定期間の期首元本額	60,521,057円
同計算期間及び特定期間の追加設定元本額	49,302,129円
同計算期間及び特定期間の一部解約元本額	4,880,840円
計算日の元本額	104,942,346円
元本額の内訳	
キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算／為替ヘッジなし）	104,942,346円

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表 株式

該当事項はありません。

#### 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
投資信託受益証券	日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）	4,774.00	4,998	
投資信託受益証券 合計		4,774.00	4,998	
投資証券	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）（クラスCfdm）	14,614.481	128,841,264	
投資証券 合計		14,614.481	128,841,264	
合計		19,388.481	128,846,262	

（注）券面総額の数値は受益証券の口数を表示しております。

### 第2 信用取引契約残高明細表 該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表 該当事項はありません。

## キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（LUX）

「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（米ドル売り円買い）」、「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（為替ヘッジなし）」、「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型／米ドル売り円買い）」および「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型）」は、円建ての「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）」（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、2022年12月31日付けで、ルクセンブルクにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務書類が作成されております。この財務書類は独立監査人であるブライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コオペラティブの監査を受けております。以下の「投資明細表」および「損益および純資産変動計算書」は、原文の財務書類から委託会社が抜粋・翻訳したものでありますが、これらは監査意見の対象外であります。

### キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（LUX） 投資明細表

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<b>Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing</b>				
<b>Bonds</b>				
<i>Angola</i>				
Angola Government Bond, Reg. S 8% 26/11/2029	USD	2,000,000	1,760,560	0.12
			<u>1,760,560</u>	<u>0.12</u>
<i>Argentina</i>				
Argentina Government Bond 1% 09/07/2029	USD	1,713,573	459,165	0.03
Argentina Government Bond 0.5% 09/07/2030	USD	42,731,912	11,631,184	0.80
Argentina Government Bond, FRN 1.5% 09/07/2035	USD	34,716,893	8,892,580	0.62
YPF Energia Electrica SA, 144A 10% 25/07/2026	USD	2,000,000	1,738,893	0.12
			<u>22,721,822</u>	<u>1.57</u>
<i>Austria</i>				
Suzano Austria GmbH 3.75% 15/01/2031	USD	871,000	732,669	0.05
			<u>732,669</u>	<u>0.05</u>
<i>Bermuda</i>				
Investment Energy Resources Ltd., 144A 6.25% 26/04/2029	USD	2,300,000	2,202,054	0.15
			<u>2,202,054</u>	<u>0.15</u>
<i>Bosnia and Herzegovina</i>				
SRPSKA Treasury, Reg. S 4.75% 27/04/2026	EUR	905,000	883,991	0.06
			<u>883,991</u>	<u>0.06</u>
<i>Brazil</i>				
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/07/2025	BRL	16,400,000	2,309,458	0.16
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/01/2026	BRL	5,880,000	7,792,658	0.54
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2025	BRL	17,700,000	3,207,314	0.22
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2027	BRL	65,300,000	11,373,115	0.79
Brazil Notas do Tesouro Nacional Inflation Linked Bond, FRN 6% 15/08/2026	BRL	1,560,000	11,939,145	0.83
Light Servicos de Eletricidade SA, 144A 4.375% 18/06/2026	USD	2,500,000	2,088,879	0.14
MV24 Capital BV, Reg. S 6.748% 01/06/2034	USD	2,483,850	2,274,053	0.16
			<u>40,984,622</u>	<u>2.84</u>
<i>Canada</i>				
Aris Mining Corp., 144A 6.875% 09/08/2026	USD	1,690,000	1,327,512	0.09
			<u>1,327,512</u>	<u>0.09</u>
<i>Chile</i>				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, Reg. S, 144A 5% 01/10/2028	CLP	1,795,000,000	2,046,895	0.14
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, Reg. S, 144A 4.7% 01/09/2030	CLP	3,720,000,000	4,231,933	0.29
Chile Government Bond 3.1% 07/05/2041	USD	3,310,000	2,389,281	0.17
Chile Government Bond 4.34% 07/03/2042	USD	2,855,000	2,422,869	0.17
			<u>11,090,978</u>	<u>0.77</u>
<i>China</i>				
Bluestar Finance Holdings Ltd., Reg. S, FRN 3.1% 31/12/2164	USD	388,000	371,613	0.02
BOC Aviation Ltd., Reg. S 3% 11/09/2029	USD	1,141,000	989,914	0.07
BOC Aviation Ltd., Reg. S 2.625% 17/09/2030	USD	459,000	380,110	0.03
China Development Bank 3.48% 08/01/2029	CNY	82,680,000	12,254,413	0.85
China Government Bond 2.8% 24/03/2029	CNY	77,220,000	11,119,904	0.77
China Government Bond 3.29% 23/05/2029	CNY	14,350,000	2,135,549	0.15

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
China Government Bond 3.86% 22/07/2049	CNY	31,800,000	5,063,911	0.35
ENN Clean Energy International Investment Ltd., Reg. S 3.375% 12/05/2026	USD	2,100,000	1,831,713	0.13
ENN Energy Holdings Ltd., Reg. S 2.625% 17/09/2030	USD	3,300,000	2,678,545	0.18
Export-Import Bank of China (The) 2.93% 02/03/2025	CNY	6,930,000	1,005,122	0.07
Huarong Finance 2017 Co. Ltd., Reg. S 4.75% 27/04/2027	USD	500,000	436,875	0.03
Meituan, 144A 3.05% 28/10/2030	USD	4,800,000	3,706,131	0.26
Tencent Holdings Ltd., Reg. S 3.975% 11/04/2029	USD	886,000	817,281	0.06
Tencent Holdings Ltd., Reg. S 3.24% 03/06/2050	USD	1,200,000	760,875	0.05
Vigorous Champion International Ltd., Reg. S 4.25% 28/05/2029	USD	200,000	179,817	0.01
			<u>43,731,773</u>	<u>3.03</u>
<i>Colombia</i>				
Colombia Government Bond 3% 30/01/2030	USD	339,000	260,297	0.02
Colombia Government Bond 3.125% 15/04/2031	USD	4,037,000	3,010,446	0.21
Colombia Government Bond 3.25% 22/04/2032	USD	2,766,000	2,020,418	0.14
Colombia Government Bond 8% 20/04/2033	USD	2,510,000	2,520,661	0.17
Colombia Government Bond 5.625% 26/02/2044	USD	496,000	366,233	0.03
Colombia Government Bond 5% 15/06/2045	USD	2,401,000	1,642,418	0.11
Colombia Government Bond 5.2% 15/05/2049	USD	375,000	256,814	0.02
Colombia Titulos De Tesoreria 5.75% 03/11/2027	COP	66,513,200,000	10,406,954	0.72
Colombia Titulos De Tesoreria 7% 26/03/2031	COP	57,133,500,000	8,347,243	0.58
Colombia Titulos De Tesoreria 9.25% 28/05/2042	COP	17,735,400,000	2,651,496	0.18
Colombia Titulos De Tesoreria 7.25% 26/10/2050	COP	6,518,000,000	765,144	0.05
Colombia Titulos De Tesoreria 7.75% 18/09/2030	COP	4,811,300,000	748,238	0.05
Empresas Publicas de Medellin ESP, Reg. S 8.375% 08/11/2027	COP	6,415,000,000	995,042	0.07
Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter, Reg. S 7.875% 12/08/2024	COP	2,008,000,000	376,899	0.03
Oleoducto Central SA, 144A 4% 14/07/2027	USD	645,000	570,127	0.04
Oleoducto Central SA, Reg. S 4% 14/07/2027	USD	3,895,000	3,442,861	0.24
			<u>38,381,291</u>	<u>2.66</u>
<i>Costa Rica</i>				
Costa Rica Government Bond, Reg. S 6.125% 19/02/2031	USD	2,153,000	2,098,936	0.15
Costa Rica Government Bond, Reg. S 5.625% 30/04/2043	USD	222,000	182,672	0.01
Costa Rica Government Bond, Reg. S 7% 04/04/2044	USD	1,654,000	1,563,721	0.11
Instituto Costarricense de Electricidad, Reg. S 6.75% 07/10/2031	USD	4,720,000	4,552,062	0.31
			<u>8,397,391</u>	<u>0.58</u>
<i>Dominican Republic</i>				
Dominican Republic Government Bond, 144A 5.5% 22/02/2029	USD	1,935,000	1,787,671	0.12
Dominican Republic Government Bond, 144A 6% 22/02/2033	USD	965,000	874,099	0.06
Dominican Republic Government Bond, 144A 5.3% 21/01/2041	USD	2,637,000	2,044,660	0.14
Dominican Republic Government Bond, 144A 6.4% 05/06/2049	USD	1,220,000	990,919	0.07



## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Dominican Republic Government Bond, 144A 5.875% 30/01/2060	USD	700,000	516,019	0.04
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 8.9% 15/02/2023	DOP	106,400,000	1,887,986	0.13
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 4.5% 30/01/2030	USD	2,759,000	2,359,136	0.16
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.5% 15/02/2048	USD	775,000	641,329	0.05
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.4% 05/06/2049	USD	1,140,000	925,941	0.06
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.875% 29/01/2026	USD	4,508,000	4,560,206	0.32
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 8.625% 20/04/2027	USD	2,375,000	2,478,781	0.17
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 7.45% 30/04/2044	USD	2,300,000	2,152,700	0.15
Dominican Republic Government Bond, Reg. S 6.85% 27/01/2045	USD	1,330,000	1,159,731	0.08
			<u>22,379,178</u>	<u>1.55</u>
<i>Egypt</i>				
Egypt Government Bond, 144A 4.75% 16/04/2026	EUR	3,300,000	2,948,018	0.20
Egypt Government Bond, 144A 5.625% 16/04/2030	EUR	2,650,000	1,975,756	0.14
Egypt Government Bond, 144A 7.053% 15/01/2032	USD	3,800,000	2,790,568	0.19
Egypt Government Bond, Reg. S 4.75% 16/04/2026	EUR	500,000	446,669	0.03
Egypt Government Bond, Reg. S 6.588% 21/02/2028	USD	5,500,000	4,500,452	0.31
Egypt Government Bond, Reg. S 5.625% 16/04/2030	EUR	680,000	506,987	0.04
Egypt Government Bond, Reg. S 8.875% 29/05/2050	USD	4,165,000	2,830,621	0.20
Egypt Government Bond, Reg. S 8.75% 30/09/2051	USD	4,980,000	3,362,496	0.23
Egypt Government Bond, Reg. S 7.5% 31/01/2027	USD	5,300,000	4,766,820	0.33
			<u>24,128,387</u>	<u>1.67</u>
<i>France</i>				
Altice France SA, 144A 5.125% 15/07/2029	USD	1,220,000	916,864	0.06
			<u>916,864</u>	<u>0.06</u>
<i>Georgia</i>				
Georgia Government Bond, 144A 2.75% 22/04/2026	USD	1,281,000	1,163,938	0.08
			<u>1,163,938</u>	<u>0.08</u>
<i>Ghana</i>				
Ghana Government Bond, Reg. S 6.375% 11/02/2027	USD	3,595,000	1,393,170	0.10
Ghana Government Bond, Reg. S 7.625% 16/05/2029	USD	4,395,000	1,659,552	0.11
Ghana Government Bond, Reg. S 8.125% 18/01/2026	USD	2,305,000	945,419	0.07
			<u>3,998,141</u>	<u>0.28</u>
<i>Honduras</i>				
Honduras Government Bond, 144A 5.625% 24/06/2030	USD	1,885,000	1,520,425	0.10
Honduras Government Bond, Reg. S 5.625% 24/06/2030	USD	5,315,000	4,287,035	0.30
Honduras Government Bond, Reg. S 6.25% 19/01/2027	USD	6,367,000	5,633,631	0.39
			<u>11,441,091</u>	<u>0.79</u>

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Hong Kong</i>				
China Ping An Insurance Overseas Holdings Ltd., Reg. S 2.85% 12/08/2031	USD	281,000	219,723	0.01
CMB International Leasing Management Ltd., Reg. S 2.75% 12/08/2030	USD	3,750,000	2,878,071	0.20
Huarong Finance 2019 Co. Ltd., Reg. S 2.5% 24/02/2023	USD	200,000	198,500	0.01
Huarong Finance 2019 Co. Ltd., Reg. S 3.75% 29/05/2024	USD	200,000	190,171	0.01
Huarong Finance 2019 Co. Ltd., Reg. S 3.25% 13/11/2024	USD	400,000	369,432	0.03
Huarong Finance 2019 Co. Ltd., Reg. S 3.875% 13/11/2029	USD	2,206,000	1,745,440	0.12
Huarong Finance 2019 Co. Ltd., Reg. S, FRN 5.824% 24/02/2023	USD	271,000	270,144	0.02
Huarong Finance 2019 Co. Ltd., Reg. S, FRN 6.007% 24/02/2025	USD	400,000	377,000	0.03
Huarong Finance II Co. Ltd., Reg. S 4.625% 03/06/2026	USD	2,142,000	1,892,992	0.13
Huarong Finance II Co. Ltd., Reg. S 4.875% 22/11/2026	USD	400,000	358,157	0.02
Kasikornbank PCL, Reg. S, FRN 3.343% 02/10/2031	USD	5,396,000	4,755,302	0.33
Melco Resorts Finance Ltd., 144A 5.75% 21/07/2028	USD	845,000	707,873	0.05
Melco Resorts Finance Ltd., 144A 5.375% 04/12/2029	USD	1,300,000	1,045,317	0.07
Sands China Ltd. 5.625% 08/08/2025	USD	1,000,000	957,392	0.07
Xiaomi Best Time International Ltd., Reg. S 2.875% 14/07/2031	USD	530,000	384,833	0.03
Xiaomi Best Time International Ltd., Reg. S 4.1% 14/07/2051	USD	975,000	567,154	0.04
			<u>16,917,501</u>	<u>1.17</u>
<i>Hungary</i>				
Hungary Government Bond 5.5% 24/06/2025	HUF	918,400,000	2,156,270	0.15
			<u>2,156,270</u>	<u>0.15</u>
<i>India</i>				
Export-Import Bank of India, Reg. S 3.25% 15/01/2030	USD	3,630,000	3,154,549	0.22
HDFC Bank Ltd., FRN, 144A 3.7% 31/12/2164	USD	4,490,000	3,863,645	0.27
India Government Bond 8.24% 15/02/2027	INR	222,300,000	2,779,438	0.19
Power Finance Corp. Ltd., 144A 3.95% 23/04/2030	USD	5,550,000	4,882,479	0.34
			<u>14,680,111</u>	<u>1.02</u>
<i>Indonesia</i>				
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk. PT, Reg. S 3.398% 09/06/2031	USD	4,296,000	3,577,458	0.25
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk. PT, Reg. S 3.541% 27/04/2032	USD	1,184,000	977,173	0.07
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk. PT, Reg. S 4.745% 09/06/2051	USD	1,700,000	1,258,137	0.09
Indonesia Government Bond 9% 15/03/2029	IDR	124,192,000,000	8,890,208	0.61
Indonesia Government Bond 8.25% 15/05/2029	IDR	131,854,000,000	9,128,842	0.63
Indonesia Government Bond 6.5% 15/02/2031	IDR	47,055,000,000	2,941,032	0.20
Indonesia Government Bond 8.75% 15/05/2031	IDR	28,829,000,000	2,068,086	0.14

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Indonesia Government Bond 4.2% 15/10/2050	USD	278,000	230,768	0.02
			<u>29,071,704</u>	<u>2.01</u>
<i>Ivory Coast</i>				
Ivory Coast Government Bond, 144A 5.875% 17/10/2031	EUR	1,810,000	1,630,496	0.11
Ivory Coast Government Bond, 144A 4.875% 30/01/2032	EUR	3,540,000	3,005,330	0.21
Ivory Coast Government Bond, Reg. S 5.25% 22/03/2030	EUR	2,540,000	2,306,778	0.16
Ivory Coast Government Bond, Reg. S 5.75% 31/12/2032	USD	1,999,955	1,896,567	0.13
			<u>8,839,171</u>	<u>0.61</u>
<i>Jordan</i>				
Jordan Government Bond, Reg. S 6.125% 29/01/2026	USD	1,130,000	1,120,617	0.08
Jordan Government Bond, Reg. S 5.75% 31/01/2027	USD	405,000	391,445	0.03
			<u>1,512,062</u>	<u>0.11</u>
<i>Kazakhstan</i>				
Development Bank of Kazakhstan JSC, 144A 10.95% 06/05/2026	KZT	2,352,000,000	4,086,698	0.28
Kazakhstan Government Bond, Reg. S 6.5% 21/07/2045	USD	843,000	880,750	0.06
			<u>4,967,448</u>	<u>0.34</u>
<i>Kenya</i>				
Kenya Government Bond, 144A 6.3% 23/01/2034	USD	6,499,000	5,036,660	0.35
Kenya Government Bond, Reg. S 7.25% 28/02/2028	USD	3,700,000	3,254,927	0.22
Kenya Government Bond, Reg. S 6.875% 24/06/2024	USD	270,000	249,273	0.02
Kenya Infrastructure Bond 10.9% 11/08/2031	KES	70,000,000	535,220	0.04
			<u>9,076,080</u>	<u>0.63</u>
<i>Korea, Republic of</i>				
Hana Bank, Reg. S 3.25% 30/03/2027	USD	2,000,000	1,851,791	0.13
			<u>1,851,791</u>	<u>0.13</u>
<i>Luxembourg</i>				
ARD Finance SA, 144A 6.5% 30/06/2027	USD	850,000	592,546	0.04
			<u>592,546</u>	<u>0.04</u>
<i>Malaysia</i>				
Misc Capital Two Labuan Ltd., 144A 3.75% 06/04/2027	USD	2,833,000	2,570,832	0.18
			<u>2,570,832</u>	<u>0.18</u>
<i>Mexico</i>				
Alpek SAB de CV, Reg. S 3.25% 25/02/2031	USD	1,585,000	1,322,994	0.09
Braskem Idesa SAPI, Reg. S 7.45% 15/11/2029	USD	2,850,000	2,254,695	0.16
Comision Federal de Electricidad, 144A 3.875% 26/07/2033	USD	1,130,000	859,705	0.06
Corp. Inmobiliaria Vesta SAB de CV, 144A 3.625% 13/05/2031	USD	2,480,000	1,994,540	0.14
Grupo Televisa SAB 7.25% 14/05/2043	MXN	9,290,000	294,625	0.02
Mexican Bonos 8.5% 31/05/2029	MXN	275,700,000	13,770,639	0.95
Mexican Bonos 8% 07/11/2047	MXN	100,200,000	4,589,460	0.32
Mexican Bonos 5.75% 05/03/2026	MXN	73,800,000	3,430,418	0.24
Mexican Bonos 7.5% 03/06/2027	MXN	465,360,000	22,532,819	1.56
Mexican Udibonos Inflation Linked Bond, FRN 2.75% 27/11/2031	MXN	4,400,000	1,545,905	0.11

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Mexican Udibonos Inflation Linked Bond, FRN 4.5% 04/12/2025	MXN	20,040,000	7,828,756	0.54
Mexico City Airport Trust, 144A 5.5% 31/07/2047	USD	724,000	559,178	0.04
Mexico City Airport Trust, Reg. S 4.25% 31/10/2026	USD	1,164,000	1,112,167	0.08
Mexico City Airport Trust, Reg. S 3.875% 30/04/2028	USD	1,085,000	994,143	0.07
Mexico City Airport Trust, Reg. S 5.5% 31/10/2046	USD	1,384,000	1,068,087	0.07
Mexico City Airport Trust, Reg. S 5.5% 31/07/2047	USD	4,028,000	3,111,006	0.21
Mexico Government Bond 3.25% 16/04/2030	USD	1,065,000	930,436	0.06
Mexico Government Bond 4.75% 27/04/2032	USD	8,800,000	8,265,090	0.57
Mexico Government Bond 4.875% 19/05/2033	USD	1,345,000	1,237,322	0.09
Mexico Government Bond 4.28% 14/08/2041	USD	4,450,000	3,442,174	0.24
Mexico Government Bond 3.75% 19/04/2071	USD	839,000	524,427	0.04
Mexico Government Bond 5.75% 12/10/2110	USD	4,100,000	3,464,928	0.24
			<u>85,133,514</u>	<u>5.90</u>
<i>Mongolia</i>				
Mongolia Government Bond, Reg. S 4.45% 07/07/2031	USD	450,000	351,098	0.02
			<u>351,098</u>	<u>0.02</u>
<i>Netherlands</i>				
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 6% 15/04/2024	USD	3,058,000	3,003,378	0.21
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026	USD	2,030,000	1,779,356	0.12
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.75% 09/05/2027	USD	910,000	823,686	0.06
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 5.125% 09/05/2029	USD	8,545,000	7,620,834	0.53
VZ Secured Financing BV, 144A 5% 15/01/2032	USD	2,950,000	2,402,573	0.16
Ziggo Bond Co. BV, 144A 5.125% 28/02/2030	USD	1,025,000	829,363	0.06
Ziggo BV, 144A 4.875% 15/01/2030	USD	800,000	670,744	0.05
			<u>17,129,934</u>	<u>1.19</u>
<i>Oman</i>				
Oman Government Bond, 144A 6.25% 25/01/2031	USD	10,550,000	10,647,883	0.74
Oman Sovereign Sukuk Co., 144A 4.875% 15/06/2030	USD	610,000	593,203	0.04
			<u>11,241,086</u>	<u>0.78</u>
<i>Panama</i>				
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA, 144A 4% 11/08/2041	USD	960,000	792,414	0.05
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA, 144A 5.125% 11/08/2061	USD	680,000	558,863	0.04
Panama Bonos del Tesoro 3.362% 30/06/2031	USD	5,600,000	4,550,000	0.32
Panama Government Bond 3.16% 23/01/2030	USD	663,000	572,490	0.04
Panama Government Bond 4.5% 16/04/2050	USD	3,670,000	2,782,171	0.19
Panama Government Bond 4.5% 01/04/2056	USD	1,750,000	1,282,391	0.09
Panama Notas del Tesoro 3.75% 17/04/2026	USD	863,000	813,817	0.06
			<u>11,352,146</u>	<u>0.79</u>
<i>Paraguay</i>				
Paraguay Government Bond, Reg. S 2.739% 29/01/2033	USD	838,000	675,903	0.05
Paraguay Government Bond, Reg. S 5.6% 13/03/2048	USD	1,790,000	1,569,501	0.11

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Paraguay Government Bond, Reg. S 5.4% 30/03/2050	USD	200,000	173,089	0.01
			2,418,493	0.17
<i>Peru</i>				
Lima Metro Line 2 Finance Ltd., 144A 5.875% 05/07/2034	USD	946,209	920,693	0.06
Peru Bonos De Tesoreria 5.4% 12/08/2034	PEN	609,000	128,448	0.01
Peru Bonos De Tesoreria 6.15% 12/08/2032	PEN	34,832,000	8,064,131	0.56
Peru Government Bond 3% 15/01/2034	USD	1,480,000	1,170,538	0.08
Peru Government Bond 3.55% 10/03/2051	USD	1,300,000	930,576	0.07
Peru Government Bond, Reg. S 6.95% 12/08/2031	PEN	1,255,000	311,651	0.02
Peru Government Bond, Reg. S 5.4% 12/08/2034	PEN	5,600,000	1,181,131	0.08
			12,707,168	0.88
<i>Philippines</i>				
Philippines Government Bond 9.5% 02/02/2030	USD	3,000,000	3,836,400	0.27
Philippines Government Bond 1.648% 10/06/2031	USD	3,200,000	2,565,346	0.18
Philippines Government Bond 3.95% 20/01/2040	USD	1,700,000	1,445,938	0.10
Philippines Government Bond 2.95% 05/05/2045	USD	7,480,000	5,420,277	0.37
			13,267,961	0.92
<i>Poland</i>				
Poland Government Bond 2.25% 25/10/2024	PLN	13,900,000	2,940,125	0.20
Poland Government Bond 3.75% 25/05/2027	PLN	40,625,000	8,182,117	0.57
Poland Government Bond 2.5% 25/07/2027	PLN	17,585,000	3,345,940	0.23
Poland Government Bond 5.75% 16/11/2032	USD	1,920,000	2,051,065	0.14
			16,519,247	1.14
<i>Russian Federation</i>				
Russian Federation Bond - Eurobond, 144A 4.375% 21/03/2029	USD	1,600,000	656,000	0.05
Russian Federation Bond - Eurobond, 144A 5.1% 28/03/2035	USD	2,400,000	984,000	0.07
Russian Federation Bond - Eurobond, Reg. S 4.375% 21/03/2029	USD	3,400,000	1,394,000	0.10
Russian Federation Bond - Eurobond, Reg. S 5.1% 28/03/2035	USD	3,200,000	1,312,000	0.09
Russian Federation Bond - Eurobond, Reg. S 5.25% 23/06/2047	USD	1,600,000	656,000	0.04
Russian Federation Bond - OFZ 8.5% 17/09/2031	RUB	300,342,000	1,303,179	0.09
Russian Federation Bond - OFZ 7.25% 10/05/2034	RUB	234,335,000	1,016,776	0.07
Russian Federation Bond - OFZ 6.1% 18/07/2035	RUB	212,409,000	921,639	0.06
Russian Federation Inflation Linked Bond, FRN 2.5% 02/02/2028	RUB	249,600,000	411,862	0.03
			8,655,456	0.60
<i>Senegal</i>				
Senegal Government Bond, 144A 5.375% 08/06/2037	EUR	2,900,000	2,096,682	0.15
Senegal Government Bond, Reg. S 4.75% 13/03/2028	EUR	3,500,000	3,243,597	0.22
			5,340,279	0.37
<i>South Africa</i>				
South Africa Government Bond 7% 28/02/2031	ZAR	41,200,000	1,958,372	0.14
South Africa Government Bond 8.25% 31/03/2032	ZAR	39,300,000	1,972,835	0.14
South Africa Government Bond 5.875% 20/04/2032	USD	8,000,000	7,245,400	0.50

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
South Africa Government Bond 8.875% 28/02/2035	ZAR	318,390,000	15,802,150	1.09
South Africa Government Bond 8.5% 31/01/2037	ZAR	93,900,000	4,386,836	0.30
South Africa Government Bond 8% 31/01/2030	ZAR	237,900,000	12,485,681	0.87
South Africa Government Bond 8.75% 28/02/2048	ZAR	84,259,000	3,877,414	0.27
			47,728,688	3.31
<i>Spain</i>				
Grifols Escrow Issuer SA, 144A 4.75% 15/10/2028	USD	705,000	609,578	0.04
			609,578	0.04
<i>Sri Lanka</i>				
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.85% 03/11/2025	USD	2,837,000	915,196	0.06
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.825% 18/07/2026	USD	2,745,000	879,104	0.06
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 7.55% 28/03/2030	USD	463,000	147,734	0.01
			1,942,034	0.13
<i>Thailand</i>				
Bangkok Bank PCL, Reg. S 4.45% 19/09/2028	USD	1,026,000	979,983	0.07
GC Treasury Center Co. Ltd., 144A 4.4% 30/03/2032	USD	1,013,000	899,934	0.06
GC Treasury Center Co. Ltd., Reg. S 4.4% 30/03/2032	USD	1,200,000	1,064,139	0.07
			2,944,056	0.20
<i>Tunisia</i>				
Tunisia Government Bond, 144A 6.75% 31/10/2023	EUR	2,875,000	2,595,154	0.18
Tunisia Government Bond, Reg. S 6.75% 31/10/2023	EUR	2,415,000	2,179,930	0.15
Tunisia Government Bond, Reg. S 5.625% 17/02/2024	EUR	3,228,000	2,723,325	0.19
Tunisia Government Bond, Reg. S 5.75% 30/01/2025	USD	3,200,000	2,228,787	0.15
			9,727,196	0.67
<i>Turkey</i>				
Turkey Government Bond 6.375% 14/10/2025	USD	2,810,000	2,703,726	0.19
Turkey Government Bond 6.5% 20/09/2033	USD	3,270,000	2,731,892	0.19
Turkey Government Bond 4.25% 14/04/2026	USD	7,264,000	6,489,483	0.45
			11,925,101	0.83
<i>Ukraine</i>				
Ukraine Government Bond, 144A 6.75% 20/06/2028	EUR	2,125,000	421,787	0.03
Ukraine Government Bond, 144A 7.253% 15/03/2035	USD	3,700,000	700,199	0.05
Ukraine Government Bond 10% 23/08/2023	UAH	50,800,000	823,255	0.06
Ukraine Government Bond 15.84% 26/02/2025	UAH	100,536,000	1,686,703	0.12
Ukraine Government Bond, Reg. S 7.75% 01/09/2024	USD	2,400,000	596,870	0.04
Ukraine Government Bond, Reg. S 8.994% 01/02/2026	USD	3,096,000	693,117	0.05
Ukraine Government Bond, Reg. S 7.75% 01/09/2027	USD	1,500,000	323,438	0.02
Ukraine Government Bond, Reg. S, FRN 0% 01/08/2041	USD	2,700,000	783,948	0.05
			6,029,317	0.42
<i>United Arab Emirates</i>				
Abu Dhabi Government Bond, Reg. S 2.5% 30/09/2029	USD	5,000,000	4,493,520	0.31

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Abu Dhabi Government Bond, Reg. S 3.875% 16/04/2050	USD	4,900,000	4,169,042	0.29
			8,662,562	0.60
<i>United Kingdom</i>				
Ashtead Capital, Inc., 144A 5.5% 11/08/2032	USD	1,280,000	1,228,025	0.08
HSBC Holdings plc, FRN 8.113% 03/11/2033	USD	5,000,000	5,305,451	0.37
MARB BondCo plc, Reg. S 3.95% 29/01/2031	USD	1,900,000	1,462,295	0.10
Vmed O2 UK Financing I plc, 144A 4.25% 31/01/2031	USD	725,000	588,533	0.04
			8,584,304	0.59
<i>United States of America</i>				
ATI, Inc. 4.875% 01/10/2029	USD	1,898,000	1,679,739	0.12
ATI, Inc. 5.125% 01/10/2031	USD	1,017,000	900,502	0.06
B&G Foods, Inc. 5.25% 01/04/2025	USD	570,000	500,684	0.03
B&G Foods, Inc. 5.25% 15/09/2027	USD	2,130,000	1,636,837	0.11
Ball Corp. 3.125% 15/09/2031	USD	1,560,000	1,254,911	0.09
Bath & Body Works, Inc. 6.75% 01/07/2036	USD	56,000	49,319	-
Bath & Body Works, Inc. 6.875% 01/11/2035	USD	1,691,000	1,506,174	0.10
Centene Corp. 2.45% 15/07/2028	USD	1,995,000	1,687,710	0.12
Centene Corp. 3% 15/10/2030	USD	2,360,000	1,939,930	0.13
Diebold Nixdorf, Inc. 8.5% 15/04/2024	USD	2,800,000	1,687,000	0.12
DPL, Inc. 4.125% 01/07/2025	USD	440,000	414,137	0.03
Embarq Corp. 7.995% 01/06/2036	USD	1,976,000	923,197	0.06
Encompass Health Corp. 4.5% 01/02/2028	USD	575,000	523,221	0.04
Encompass Health Corp. 5.75% 15/09/2025	USD	540,000	534,436	0.04
EQM Midstream Partners LP 5.5% 15/07/2028	USD	1,290,000	1,155,779	0.08
Ford Motor Credit Co. LLC 5.125% 16/06/2025	USD	3,385,000	3,261,588	0.23
Ford Motor Credit Co. LLC 3.375% 13/11/2025	USD	570,000	516,296	0.04
Ford Motor Credit Co. LLC 4.542% 01/08/2026	USD	2,250,000	2,077,031	0.14
Ford Motor Credit Co. LLC 2.7% 10/08/2026	USD	940,000	817,471	0.06
Ford Motor Credit Co. LLC 4.95% 28/05/2027	USD	780,000	729,121	0.05
Ford Motor Credit Co. LLC 3.815% 02/11/2027	USD	760,000	669,195	0.05
Genesis Energy LP 5.625% 15/06/2024	USD	155,000	149,895	0.01
Genesis Energy LP 8% 15/01/2027	USD	1,180,000	1,116,068	0.08
Genesis Energy LP 7.75% 01/02/2028	USD	175,000	161,360	0.01
Genesis Energy LP 6.5% 01/10/2025	USD	995,000	952,504	0.07
HCA, Inc. 5.375% 01/02/2025	USD	150,000	149,940	0.01
HCA, Inc. 3.5% 01/09/2030	USD	2,480,000	2,144,768	0.15
MGIC Investment Corp. 5.25% 15/08/2028	USD	1,100,000	1,016,142	0.07
MGM Resorts International 5.5% 15/04/2027	USD	1,140,000	1,062,103	0.07
NGL Energy Partners LP 7.5% 01/11/2023	USD	1,000,000	975,300	0.07
NGL Energy Partners LP 6.125% 01/03/2025	USD	1,480,000	1,208,538	0.08
OneMain Finance Corp. 3.875% 15/09/2028	USD	332,000	264,445	0.02
Owens & Minor, Inc. 4.375% 15/12/2024	USD	4,235,000	4,100,134	0.28
Owl Rock Capital Corp. 3.75% 22/07/2025	USD	1,950,000	1,803,436	0.12
Owl Rock Capital Corp. 3.4% 15/07/2026	USD	1,370,000	1,197,835	0.08
Penske Automotive Group, Inc. 3.75% 15/06/2029	USD	1,000,000	812,944	0.06
PG&E Corp. 5.25% 01/07/2030	USD	2,500,000	2,278,838	0.16
Sasol Financing USA LLC 4.375% 18/09/2026	USD	3,155,000	2,796,899	0.19
Tenet Healthcare Corp. 4.625% 15/07/2024	USD	291,000	284,225	0.02
TK Elevator US Newco, Inc., 144A 5.25% 15/07/2027	USD	665,000	591,584	0.04

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
TransDigm, Inc. 5.5% 15/11/2027	USD	565,000	531,710	0.04
Triumph Group, Inc. 7.75% 15/08/2025	USD	1,685,000	1,435,906	0.10
United Rentals North America, Inc. 3.875% 15/02/2031	USD	1,675,000	1,407,913	0.10
United Rentals North America, Inc. 3.75% 15/01/2032	USD	730,000	596,505	0.04
US Treasury 3.25% 30/06/2027	USD	8,100,000	7,834,342	0.54
US Treasury Inflation Indexed, FRN 0.125% 15/04/2027	USD	11,500,000	11,308,945	0.78
Western Midstream Operating LP 4.3% 01/02/2030	USD	500,000	437,587	0.03
			<u>71,084,144</u>	<u>4.92</u>
<b>Total Bonds</b>			<b>681,831,140</b>	<b>47.21</b>
<b>Equities</b>				
<i>United States of America</i>				
Diamond Offshore Drilling, Inc.	USD	87,700	912,080	0.06
Mcdermott International Ltd.	USD	18,640	5,965	-
			<u>918,045</u>	<u>0.06</u>
<b>Total Equities</b>			<b>918,045</b>	<b>0.06</b>
<b>Total Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing</b>			<b>682,749,185</b>	<b>47.27</b>
<b>Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market</b>				
<b>Bonds</b>				
<i>Argentina</i>				
Argentina Government Bond, FRN 0% 15/12/2035	USD	17,350,000	104,100	0.01
			<u>104,100</u>	<u>0.01</u>
<i>Brazil</i>				
Braskem Netherlands Finance BV, Reg. S 4.5% 31/01/2030	USD	2,154,000	1,836,745	0.13
Brazil Government Bond 100% 01/01/2029	BRL	3,620,000	6,145,965	0.42
Brazil Treasury, FRN 237.877% 15/08/2024	BRL	630,000	4,731,835	0.33
Constellation Oil Services Holding SA 3% 31/12/2026	USD	451,482	267,221	0.02
Guara Norte S.A.R.L., 144A 5.198% 15/06/2034	USD	5,213,924	4,419,189	0.30
Hidrovias International Finance S.A.R.L., 144A 4.95% 08/02/2031	USD	4,011,000	2,976,167	0.21
Hidrovias International Finance S.A.R.L., Reg. S 4.95% 08/02/2031	USD	500,000	371,001	0.02
Natura Cosméticos S.A., 144A 4.125% 03/05/2028	USD	3,700,000	3,023,695	0.21
Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd., Reg. S 7.72% 01/12/2026	USD	7,445,234	1,991,600	0.14
			<u>25,763,418</u>	<u>1.78</u>
<i>Canada</i>				
Bausch Health Americas, Inc., 144A 8.5% 31/01/2027	USD	70,000	36,731	-
Bausch Health Cos., Inc., 144A 5.5% 01/11/2025	USD	4,445,000	3,785,258	0.26
Bausch Health Cos., Inc., 144A 5% 30/01/2028	USD	940,000	452,680	0.03
Bausch Health Cos., Inc., 144A 4.875% 01/06/2028	USD	4,300,000	2,743,021	0.19
Bausch Health Cos., Inc., 144A 5% 15/02/2029	USD	70,000	33,641	-
Bausch Health Cos., Inc., 144A 7.25% 30/05/2029	USD	84,000	40,692	-
Bausch Health Cos., Inc., 144A 5.25% 15/02/2031	USD	1,747,000	848,894	0.06
Bausch Health Cos., Inc., 144A 9% 15/12/2025	USD	630,000	498,160	0.04
Bombardier, Inc., 144A 7.125% 15/06/2026	USD	2,585,000	2,512,709	0.17



## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Bombardier, Inc., 144A 7.875% 15/04/2027	USD	4,805,000	4,670,632	0.32
Bombardier, Inc., 144A 6% 15/02/2028	USD	2,095,000	1,939,844	0.13
First Quantum Minerals Ltd., 144A 6.5% 01/03/2024	USD	812,000	795,557	0.06
First Quantum Minerals Ltd., 144A 6.875% 01/03/2026	USD	3,155,000	2,992,538	0.21
First Quantum Minerals Ltd., 144A 6.875% 15/10/2027	USD	4,610,000	4,334,706	0.30
Methanex Corp. 5.125% 15/10/2027	USD	4,125,000	3,833,032	0.27
NOVA Chemicals Corp., 144A 4.25% 15/05/2029	USD	1,770,000	1,449,577	0.10
Parkland Corp., 144A 4.625% 01/05/2030	USD	690,000	571,972	0.04
			<u>31,539,644</u>	<u>2.18</u>
<i>Chile</i>				
Alfa Desarrollo SpA, 144A 4.55% 27/09/2051	USD	1,524,423	1,161,070	0.08
CAP SA, 144A 3.9% 27/04/2031	USD	3,000,000	2,346,756	0.16
			<u>3,507,826</u>	<u>0.24</u>
<i>China</i>				
Tencent Holdings Ltd., Reg. S 3.68% 22/04/2041	USD	200,000	147,367	0.01
Tencent Holdings Ltd., Reg. S 3.84% 22/04/2051	USD	400,000	284,153	0.02
			<u>431,520</u>	<u>0.03</u>
<i>Colombia</i>				
Colombia Titulos De Tesoreria 704.807% 18/04/2029	COP	70,501,000	3,807,444	0.26
Empresas Publicas de Medellin ESP, Reg. S 4.25% 18/07/2029	USD	2,086,000	1,659,517	0.12
			<u>5,466,961</u>	<u>0.38</u>
<i>Hong Kong</i>				
Melco Resorts Finance Ltd., 144A 4.875% 06/06/2025	USD	1,500,000	1,380,086	0.10
Sands China Ltd., FRN 4.3% 08/01/2026	USD	1,450,000	1,340,019	0.09
			<u>2,720,105</u>	<u>0.19</u>
<i>Ireland</i>				
Castlelake Aviation Finance DAC, 144A 5% 15/04/2027	USD	1,460,000	1,272,301	0.09
Jazz Securities DAC, 144A 4.375% 15/01/2029	USD	1,055,000	942,194	0.06
			<u>2,214,495</u>	<u>0.15</u>
<i>Italy</i>				
International Game Technology plc, 144A 6.5% 15/02/2025	USD	1,955,000	1,970,093	0.13
International Game Technology plc, 144A 5.25% 15/01/2029	USD	4,600,000	4,294,281	0.30
			<u>6,264,374</u>	<u>0.43</u>
<i>Luxembourg</i>				
Allied Universal Holdco LLC, 144A 4.625% 01/06/2028	USD	880,000	714,598	0.05
Altice France Holding SA, 144A 10.5% 15/05/2027	USD	605,000	462,613	0.03
Intelsat Jackson Holdings SA, 144A 6.5% 15/03/2030	USD	1,800,000	1,613,682	0.11
Rede D'or Finance SARL, Reg. S 4.95% 17/01/2028	USD	320,000	296,070	0.02
Rede D'or Finance SARL, Reg. S 4.5% 22/01/2030	USD	2,565,000	2,211,017	0.16
Venator Finance SARL, 144A 9.5% 01/07/2025	USD	405,000	293,625	0.02
Venator Finance SARL, 144A 5.75% 15/07/2025	USD	5,055,000	1,734,269	0.12
			<u>7,325,874</u>	<u>0.51</u>

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Malaysia</i>				
Malaysia Government Bond 3.422% 30/09/2027	MYR	17,100,000	3,810,446	0.26
Malaysia Government Bond 3.733% 15/06/2028	MYR	4,100,000	920,126	0.06
Malaysia Government Bond 3.885% 15/08/2029	MYR	42,500,000	9,584,222	0.66
Malaysia Government Bond 4.127% 15/04/2032	MYR	11,185,000	2,549,530	0.18
Malaysia Government Bond 3.844% 15/04/2033	MYR	1,068,000	236,822	0.02
Malaysia Government Bond 4.642% 07/11/2033	MYR	1,572,000	372,219	0.03
Malaysia Government Bond 4.893% 08/06/2038	MYR	15,619,000	3,775,841	0.26
Malaysia Government Bond 3.955% 15/09/2025	MYR	5,570,000	1,271,012	0.09
Malaysia Government Bond 4.254% 31/05/2035	MYR	9,800,000	2,234,811	0.16
			<u>24,755,029</u>	<u>1.72</u>
<i>Mexico</i>				
Braskem Idesa SAPI, 144A 6.99% 20/02/2032	USD	4,530,000	3,242,182	0.23
Cibanco SA, REIT, 144A 4.375% 22/07/2031	USD	2,500,000	1,872,898	0.13
Industrias Penoles SAB de CV, Reg. S 4.75% 06/08/2050	USD	1,570,000	1,299,696	0.09
			<u>6,414,776</u>	<u>0.45</u>
<i>Netherlands</i>				
Arcos Dorados BV, Reg. S 6.125% 27/05/2029	USD	1,400,000	1,358,609	0.09
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 7.125% 31/01/2025	USD	1,490,000	1,484,070	0.10
UPC Broadband Finco BV, 144A 4.875% 15/07/2031	USD	1,120,000	933,867	0.07
			<u>3,776,546</u>	<u>0.26</u>
<i>Panama</i>				
AES Panama Generation Holdings SRL, Reg. S 4.375% 31/05/2030	USD	3,555,000	3,096,565	0.22
ENA Master Trust, 144A 4% 19/05/2048	USD	3,152,000	2,223,802	0.15
			<u>5,320,367</u>	<u>0.37</u>
<i>Paraguay</i>				
Rutas 2 and 7 Finance Ltd., 144A 0% 30/09/2036	USD	3,154,667	1,993,843	0.14
			<u>1,993,843</u>	<u>0.14</u>
<i>Peru</i>				
Banco de Credito del Peru SA, FRN, 144A 3.25% 30/09/2031	USD	4,310,000	3,795,597	0.26
InRetail Consumer, Reg. S 3.25% 22/03/2028	USD	2,810,000	2,420,194	0.17
Lima Metro Line 2 Finance Ltd., 144A 4.35% 05/04/2036	USD	1,700,325	1,514,321	0.11
Peru Government Bond, Reg. S 6.35% 12/08/2028	PEN	3,400,000	851,510	0.06
			<u>8,581,622</u>	<u>0.60</u>
<i>Poland</i>				
Canpack SA, 144A 3.875% 15/11/2029	USD	1,305,000	1,030,114	0.07
			<u>1,030,114</u>	<u>0.07</u>
<i>Spain</i>				
AI Candelaria Spain SA, 144A 5.75% 15/06/2033	USD	5,235,000	3,989,489	0.28
AI Candelaria Spain SA, Reg. S 5.75% 15/06/2033	USD	250,000	190,520	0.01
EnfraGen Energia Sur SA, Reg. S 5.375% 30/12/2030	USD	2,696,000	1,891,133	0.13
			<u>6,071,142</u>	<u>0.42</u>
<i>Sri Lanka</i>				
Sri Lanka Government Bond 5.75% 18/04/2023	USD	1,000,000	317,457	0.02
Sri Lanka Government Bond 5.75% 18/04/2023	USD	3,532,000	1,121,258	0.08
Sri Lanka Government Bond 6.825% 18/07/2026	USD	1,264,000	404,804	0.03
Sri Lanka Government Bond 6.2% 11/05/2027	USD	1,000,000	319,080	0.02
			<u>2,162,599</u>	<u>0.15</u>

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Thailand</i>				
Bangkok Bank PCL, Reg. S, FRN 3.733% 25/09/2034	USD	3,204,000	2,684,394	0.18
Thailand Government Bond 2.875% 17/12/2028	THB	66,700,000	2,013,357	0.14
Thailand Government Bond 2% 17/06/2042	THB	98,200,000	2,291,341	0.16
			<u>6,989,092</u>	<u>0.48</u>
<i>United Kingdom</i>				
Fresnillo plc, 144A 4.25% 02/10/2050	USD	933,000	736,179	0.05
			<u>736,179</u>	<u>0.05</u>
<i>United States of America</i>				
AdaptHealth LLC, 144A 5.125% 01/03/2030	USD	1,050,000	895,220	0.06
Advisor Group Holdings, Inc., 144A 10.75% 01/08/2027	USD	3,735,000	3,786,441	0.26
AG Issuer LLC, 144A 6.25% 01/03/2028	USD	4,544,000	4,182,913	0.29
AG TTMT Escrow Issuer LLC, 144A 8.625% 30/09/2027	USD	1,720,000	1,737,200	0.12
Albertsons Cos., Inc., 144A 3.5% 15/03/2029	USD	855,000	719,217	0.05
Alcoa Nederland Holding BV, 144A 4.125% 31/03/2029	USD	525,000	466,517	0.03
Alliant Holdings Intermediate LLC, 144A 4.25% 15/10/2027	USD	1,305,000	1,170,817	0.08
Alliant Holdings Intermediate LLC, 144A 6.75% 15/10/2027	USD	3,265,000	2,941,798	0.20
Alliant Holdings Intermediate LLC, 144A 5.875% 01/11/2029	USD	2,290,000	1,886,273	0.13
Allied Universal Holdco LLC, 144A 9.75% 15/07/2027	USD	1,030,000	898,315	0.06
Allied Universal Holdco LLC, 144A 4.625% 01/06/2028	USD	1,740,000	1,440,372	0.10
Allied Universal Holdco LLC, 144A 6% 01/06/2029	USD	2,000,000	1,454,119	0.10
Allison Transmission, Inc., 144A 3.75% 30/01/2031	USD	1,565,000	1,289,169	0.09
American Airlines, Inc., 144A 5.5% 20/04/2026	USD	1,000,000	963,402	0.07
AmWINS Group, Inc., 144A 4.875% 30/06/2029	USD	2,204,000	1,872,181	0.13
Arconic Corp., 144A 6.125% 15/02/2028	USD	800,000	751,988	0.05
Aretex Escrow Issuer, Inc., 144A 7.5% 01/04/2029	USD	4,140,000	3,425,677	0.24
Asbury Automotive Group, Inc., 144A 4.625% 15/11/2029	USD	2,840,000	2,396,449	0.17
Asbury Automotive Group, Inc., 144A 5% 15/02/2032	USD	385,000	317,240	0.02
AssuredPartners, Inc., 144A 5.625% 15/01/2029	USD	2,902,000	2,392,233	0.17
Avantor Funding, Inc., 144A 4.625% 15/07/2028	USD	1,670,000	1,520,902	0.11
Avantor Funding, Inc., 144A 3.875% 01/11/2029	USD	1,810,000	1,522,255	0.11
Avis Budget Car Rental LLC, 144A 5.75% 15/07/2027	USD	800,000	724,924	0.05
Avis Budget Car Rental LLC, 144A 5.375% 01/03/2029	USD	1,280,000	1,096,625	0.08
Axalta Coating Systems LLC, 144A 4.75% 15/06/2027	USD	1,340,000	1,240,773	0.09
Ball Corp. 6.875% 15/03/2028	USD	2,125,000	2,185,499	0.15
Bath & Body Works, Inc., 144A 6.625% 01/10/2030	USD	680,000	639,277	0.04
Blackstone Private Credit Fund, 144A 7.05% 29/09/2025	USD	2,105,000	2,090,447	0.14
Block, Inc. 3.5% 01/06/2031	USD	1,560,000	1,246,752	0.09

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Booz Allen Hamilton, Inc., 144A 4% 01/07/2029	USD	1,911,000	1,684,716	0.12
Boyd Gaming Corp., 144A 4.75% 15/06/2031	USD	1,360,000	1,184,805	0.08
Boyd Gaming Corp. 4.75% 01/12/2027	USD	1,000,000	932,840	0.06
Boyne USA, Inc., 144A 4.75% 15/05/2029	USD	2,165,000	1,918,881	0.13
Brink's Co. (The), 144A 4.625% 15/10/2027	USD	1,490,000	1,365,913	0.09
Brookfield Property REIT, Inc., REIT, 144A 5.75% 15/05/2026	USD	1,610,000	1,473,500	0.10
Builders FirstSource, Inc., 144A 4.25% 01/02/2032	USD	750,000	609,362	0.04
Caesars Entertainment, Inc., 144A 6.25% 01/07/2025	USD	2,500,000	2,434,264	0.17
Caesars Entertainment, Inc., 144A 4.625% 15/10/2029	USD	1,705,000	1,390,589	0.10
Caesars Resort Collection LLC, 144A 5.75% 01/07/2025	USD	1,210,000	1,186,243	0.08
Carnival Corp., 144A 4% 01/08/2028	USD	1,500,000	1,226,040	0.08
Catalent Pharma Solutions, Inc., 144A 5% 15/07/2027	USD	650,000	605,844	0.04
Catalent Pharma Solutions, Inc., 144A 3.125% 15/02/2029	USD	810,000	645,975	0.04
Catalent Pharma Solutions, Inc., 144A 3.5% 01/04/2030	USD	950,000	751,322	0.05
CCO Holdings LLC, 144A 4.75% 01/03/2030	USD	1,875,000	1,621,313	0.11
CCO Holdings LLC, 144A 4.5% 15/08/2030	USD	3,075,000	2,547,361	0.18
CCO Holdings LLC, 144A 4.25% 01/02/2031	USD	3,115,000	2,505,706	0.17
CCO Holdings LLC, 144A 4.75% 01/02/2032	USD	980,000	796,490	0.06
CCO Holdings LLC, 144A 4.5% 01/06/2033	USD	1,930,000	1,484,643	0.10
CCO Holdings LLC 4.5% 01/05/2032	USD	610,000	486,734	0.03
CDI Escrow Issuer, Inc., 144A 5.75% 01/04/2030	USD	1,925,000	1,729,004	0.12
Cedar Fair LP, 144A 5.5% 01/05/2025	USD	1,640,000	1,624,972	0.11
Centene Corp. 4.625% 15/12/2029	USD	1,055,000	966,476	0.07
Central Garden & Pet Co., 144A 4.125% 30/04/2031	USD	1,015,000	841,537	0.06
Central Garden & Pet Co. 4.125% 15/10/2030	USD	1,490,000	1,226,282	0.08
Central Parent, Inc., 144A 7.25% 15/06/2029	USD	825,000	808,002	0.06
Charles River Laboratories International, Inc., 144A 4.25% 01/05/2028	USD	2,020,000	1,863,935	0.13
Chart Industries, Inc., 144A 7.5% 01/01/2030	USD	945,000	951,180	0.07
Cheniere Energy Partners LP 4.5% 01/10/2029	USD	175,000	157,758	0.01
Cheniere Energy Partners LP 4% 01/03/2031	USD	812,000	692,401	0.05
Cheniere Energy, Inc. 4.625% 15/10/2028	USD	3,930,000	3,559,764	0.25
Chesapeake Energy Corp. 4.875% 15/04/2022 <sup>1</sup>	USD	2,110,000	47,475	-
Clarios Global LP, 144A 6.25% 15/05/2026	USD	355,000	347,532	0.02
Clarios Global LP, 144A 8.5% 15/05/2027	USD	500,000	489,278	0.03
Clarivate Science Holdings Corp., 144A 4.875% 01/07/2029	USD	480,000	408,792	0.03
Clarivate Science Holdings Corp., Reg. S 3.875% 01/07/2028	USD	710,000	615,979	0.04
Clarivate Science Holdings Corp., Reg. S 4.875% 01/07/2029	USD	1,395,000	1,188,052	0.08
Cleveland-Cliffs, Inc., 144A 6.75% 15/03/2026	USD	915,000	918,861	0.06
Cleveland-Cliffs, Inc., 144A 4.625% 01/03/2029	USD	1,000,000	888,945	0.06
CNX Midstream Partners LP, 144A 4.75% 15/04/2030	USD	245,000	201,381	0.01
Coinbase Global, Inc., 144A 3.375% 01/10/2028	USD	1,125,000	596,138	0.04

<sup>1</sup> Security is currently in default.

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Coinbase Global, Inc., 144A 3.625% 01/10/2031	USD	1,225,000	591,567	0.04
CommScope Technologies LLC, 144A 5% 15/03/2027	USD	25,000	17,020	-
CommScope, Inc., 144A 6% 01/03/2026	USD	1,225,000	1,133,064	0.08
CommScope, Inc., 144A 8.25% 01/03/2027	USD	125,000	97,072	0.01
Community Health Systems, Inc., 144A 5.625% 15/03/2027	USD	1,835,000	1,576,779	0.11
Compass Group Diversified Holdings LLC, 144A 5.25% 15/04/2029	USD	4,805,000	4,118,322	0.29
Compass Group Diversified Holdings LLC, 144A 5% 15/01/2032	USD	1,980,000	1,575,393	0.11
CoreLogic, Inc., 144A 4.5% 01/05/2028	USD	4,815,000	3,700,303	0.26
Coty, Inc., 144A 4.75% 15/01/2029	USD	1,250,000	1,133,056	0.08
Covanta Holding Corp., 144A 4.875% 01/12/2029	USD	1,325,000	1,087,255	0.08
CQP Holdco LP, 144A 5.5% 15/06/2031	USD	2,690,000	2,354,772	0.16
Crestwood Midstream Partners LP, 144A 8% 01/04/2029	USD	3,590,000	3,577,616	0.25
CSC Holdings LLC, 144A 3.375% 15/02/2031	USD	900,000	588,393	0.04
CVR Partners LP, 144A 6.125% 15/06/2028	USD	1,175,000	1,055,630	0.07
DaVita, Inc., 144A 4.625% 01/06/2030	USD	1,245,000	1,004,144	0.07
Delta Air Lines, Inc., 144A 4.75% 20/10/2028	USD	1,290,000	1,214,547	0.08
Diamond Foreign Asset Co. 9% 22/04/2027	USD	44,033	41,831	-
Diamond Offshore Drilling Overseas LLC 9% 23/04/2027	USD	38,775	36,836	-
Diamond Sports Group LLC, 144A 6.625% 15/08/2027	USD	1,880,000	21,150	-
Diebold Nixdorf, Inc., 144A 9.375% 15/07/2025	USD	8,730,000	5,951,023	0.41
Directv Financing LLC, 144A 5.875% 15/08/2027	USD	3,525,000	3,160,374	0.22
DISH Network Corp., 144A 11.75% 15/11/2027	USD	3,550,000	3,660,583	0.25
Dun & Bradstreet Corp. (The), 144A 5% 15/12/2029	USD	1,095,000	938,484	0.06
Entegris Escrow Corp., 144A 4.75% 15/04/2029	USD	780,000	712,883	0.05
EQM Midstream Partners LP, 144A 6.5% 01/07/2027	USD	2,320,000	2,221,400	0.15
EQM Midstream Partners LP, 144A 4.5% 15/01/2029	USD	500,000	420,699	0.03
EQM Midstream Partners LP, 144A 4.75% 15/01/2031	USD	1,165,000	954,665	0.07
Fair Isaac Corp., 144A 4% 15/06/2028	USD	1,225,000	1,113,863	0.08
Fertitta Entertainment LLC, 144A 4.625% 15/01/2029	USD	1,700,000	1,440,809	0.10
Fertitta Entertainment LLC, 144A 6.75% 15/01/2030	USD	850,000	687,204	0.05
First Student Bidco, Inc., 144A 4% 31/07/2029	USD	2,595,000	2,150,145	0.15
Frontier Communications Holdings LLC, 144A 5.875% 15/10/2027	USD	1,875,000	1,745,194	0.12
Frontier Communications Holdings LLC, 144A 5% 01/05/2028	USD	4,250,000	3,714,543	0.26
Frontier Communications Holdings LLC, 144A 6.75% 01/05/2029	USD	2,685,000	2,224,872	0.15
Frontier Communications Holdings LLC, 144A 6% 15/01/2030	USD	1,200,000	944,247	0.07
FS Energy and Power Fund, 144A 7.5% 15/08/2023	USD	1,955,000	1,961,324	0.14
FXI Holdings, Inc., 144A 7.875% 01/11/2024	USD	3,258,000	2,713,621	0.19
FXI Holdings, Inc., 144A 12.25% 15/11/2026	USD	1,865,000	1,546,980	0.11
Gap, Inc. (The), 144A 3.625% 01/10/2029	USD	311,000	219,793	0.02
Gap, Inc. (The), 144A 3.875% 01/10/2031	USD	207,000	144,711	0.01
Gartner, Inc., 144A 4.5% 01/07/2028	USD	600,000	560,460	0.04

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Gartner, Inc., 144A 3.75% 01/10/2030	USD	1,530,000	1,321,159	0.09
Graham Packaging Co., Inc., 144A 7.125% 15/08/2028	USD	750,000	626,979	0.04
Gray Escrow II, Inc., 144A 5.375% 15/11/2031	USD	550,000	397,339	0.03
Gray Television, Inc., 144A 7% 15/05/2027	USD	1,250,000	1,110,494	0.08
GTCR AP Finance, Inc., 144A 8% 15/05/2027	USD	90,000	86,351	0.01
Hanesbrands, Inc., 144A 4.625% 15/05/2024	USD	675,000	654,856	0.05
Hanesbrands, Inc., 144A 4.875% 15/05/2026	USD	4,595,000	4,114,000	0.28
Harsco Corp., 144A 5.75% 31/07/2027	USD	1,450,000	1,147,163	0.08
Harvest Midstream I LP, 144A 7.5% 01/09/2028	USD	650,000	621,965	0.04
HealthEquity, Inc., 144A 4.5% 01/10/2029	USD	1,240,000	1,085,186	0.08
Hightower Holding LLC, 144A 6.75% 15/04/2029	USD	3,120,000	2,622,574	0.18
Hilton Domestic Operating Co., Inc., 144A 4% 01/05/2031	USD	3,075,000	2,578,972	0.18
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 4.875% 15/01/2030	USD	1,050,000	953,285	0.07
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC, 144A 5% 01/06/2029	USD	1,790,000	1,541,682	0.11
Howard Hughes Corp. (The), 144A 5.375% 01/08/2028	USD	1,650,000	1,489,125	0.10
Howard Hughes Corp. (The), 144A 4.125% 01/02/2029	USD	2,535,000	2,126,726	0.15
Howard Hughes Corp. (The), 144A 4.375% 01/02/2031	USD	1,855,000	1,503,503	0.10
HUB International Ltd., 144A 7% 01/05/2026	USD	2,200,000	2,158,244	0.15
HUB International Ltd., 144A 5.625% 01/12/2029	USD	1,635,000	1,430,106	0.10
Icahn Enterprises LP 4.75% 15/09/2024	USD	945,000	908,189	0.06
Icahn Enterprises LP 5.25% 15/05/2027	USD	785,000	720,473	0.05
iHeartCommunications, Inc., 144A 5.25% 15/08/2027	USD	2,075,000	1,760,976	0.12
Ingles Markets, Inc., 144A 4% 15/06/2031	USD	1,390,000	1,170,818	0.08
Iron Mountain Information Management Services, Inc., REIT, 144A 5% 15/07/2032	USD	2,845,000	2,367,454	0.16
Iron Mountain, Inc., REIT, 144A 5.25% 15/07/2030	USD	2,190,000	1,908,048	0.13
Iron Mountain, Inc., REIT, 144A 4.5% 15/02/2031	USD	1,410,000	1,162,115	0.08
JELD-WEN, Inc., 144A 4.875% 15/12/2027	USD	940,000	708,995	0.05
Kaiser Aluminum Corp., 144A 4.625% 01/03/2028	USD	1,092,000	954,600	0.07
KB Home 7.25% 15/07/2030	USD	565,000	549,711	0.04
Kennedy-Wilson, Inc. 4.75% 01/03/2029	USD	1,905,000	1,512,278	0.10
Kennedy-Wilson, Inc. 4.75% 01/02/2030	USD	3,640,000	2,780,232	0.19
Kennedy-Wilson, Inc. 5% 01/03/2031	USD	3,410,000	2,571,388	0.18
Köntoor Brands, Inc., 144A 4.125% 15/11/2029	USD	645,000	528,000	0.04
Kronos Acquisition Holdings, Inc., 144A 5% 31/12/2026	USD	3,345,000	2,897,606	0.20
Kronos Acquisition Holdings, Inc., 144A 7% 31/12/2027	USD	450,000	370,688	0.03
LABL, Inc., 144A 10.5% 15/07/2027	USD	355,000	330,888	0.02
Ladder Capital Finance Holdings LLLP, 144A 4.25% 01/02/2027	USD	2,416,000	2,033,739	0.14
Lamar Media Corp. 3.625% 15/01/2031	USD	2,420,000	2,003,827	0.14
Lamb Weston Holdings, Inc., 144A 4.125% 31/01/2030	USD	3,030,000	2,680,186	0.19
LCM Investments Holdings II LLC, 144A 4.875% 01/05/2029	USD	1,229,000	985,767	0.07

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Levi Strauss & Co., 144A 3.5% 01/03/2031	USD	1,555,000	1,236,209	0.09
Ligado Networks LLC, FRN, 144A 15.5% 01/11/2023	USD	3,335,483	1,087,701	0.08
Lithia Motors, Inc., 144A 3.875% 01/06/2029	USD	1,490,000	1,227,097	0.08
Lithia Motors, Inc., 144A 4.375% 15/01/2031	USD	2,000,000	1,630,761	0.11
Live Nation Entertainment, Inc., 144A 4.75% 15/10/2027	USD	540,000	481,612	0.03
Live Nation Entertainment, Inc., 144A 3.75% 15/01/2028	USD	975,000	833,213	0.06
LPL Holdings, Inc., 144A 4.625% 15/11/2027	USD	1,855,000	1,735,911	0.12
LPL Holdings, Inc., 144A 4% 15/03/2029	USD	1,350,000	1,176,457	0.08
LPL Holdings, Inc., 144A 4.375% 15/05/2031	USD	2,730,000	2,324,853	0.16
LSB Industries, Inc., 144A 6.25% 15/10/2028	USD	1,300,000	1,191,093	0.08
Marriott Ownership Resorts, Inc., 144A 4.5% 15/06/2029	USD	885,000	735,370	0.05
MasTec, Inc., 144A 4.5% 15/08/2028	USD	675,000	605,809	0.04
Medline Borrower LP, 144A 5.25% 01/10/2029	USD	2,120,000	1,687,637	0.12
MercadoLibre, Inc. 3.125% 14/01/2031	USD	2,485,000	1,924,384	0.13
Mileage Plus Holdings LLC, 144A 6.5% 20/06/2027	USD	1,971,127	1,964,035	0.14
Millennium Escrow Corp., 144A 6.625% 01/08/2026	USD	640,000	410,433	0.03
Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A 8% 01/02/2026	USD	650,000	609,063	0.04
Molina Healthcare, Inc., 144A 4.375% 15/06/2028	USD	1,040,000	950,934	0.07
Molina Healthcare, Inc., 144A 3.875% 15/11/2030	USD	2,105,000	1,786,987	0.12
Molina Healthcare, Inc., 144A 3.875% 15/05/2032	USD	1,750,000	1,455,798	0.10
MoneyGram International, Inc., 144A 5.375% 01/08/2026	USD	825,000	837,200	0.06
MSCI, Inc., 144A 3.625% 01/09/2030	USD	1,510,000	1,257,868	0.09
MSCI, Inc., 144A 3.625% 01/11/2031	USD	2,810,000	2,327,874	0.16
Mueller Water Products, Inc., 144A 4% 15/06/2029	USD	1,075,000	946,027	0.07
Nabors Industries, Inc., 144A 7.375% 15/05/2027	USD	1,115,000	1,081,382	0.07
Navient Corp. 6.125% 25/03/2024	USD	935,000	917,468	0.06
Navient Corp. 5.875% 25/10/2024	USD	580,000	562,194	0.04
Navient Corp. 6.75% 15/06/2026	USD	800,000	759,629	0.05
Navient Corp. 5% 15/03/2027	USD	980,000	859,620	0.06
Navient Corp. 4.875% 15/03/2028	USD	820,000	675,547	0.05
Navient Corp. 5.5% 15/03/2029	USD	3,970,000	3,245,357	0.22
Navient Corp. 5.5% 25/01/2023	USD	2,599,000	2,598,792	0.18
NCL Corp. Ltd., 144A 5.875% 15/02/2027	USD	1,080,000	936,851	0.06
NCL Corp. Ltd., 144A 7.75% 15/02/2029	USD	630,000	474,919	0.03
NCR Corp., 144A 5.125% 15/04/2029	USD	750,000	628,581	0.04
New Fortress Energy, Inc., 144A 6.75% 15/09/2025	USD	216,000	204,794	0.01
New Fortress Energy, Inc., 144A 6.5% 30/09/2026	USD	2,959,000	2,753,645	0.19
News Corp., 144A 3.875% 15/05/2029	USD	975,000	847,114	0.06
Nexstar Media, Inc., 144A 5.625% 15/07/2027	USD	770,000	707,928	0.05
Nexstar Media, Inc., 144A 4.75% 01/11/2028	USD	2,855,000	2,473,886	0.17
NFP Corp., 144A 6.875% 15/08/2028	USD	1,830,000	1,512,457	0.10
NGL Energy Operating LLC, 144A 7.5% 01/02/2026	USD	8,211,000	7,325,208	0.51
NMG Holding Co., Inc., 144A 7.125% 01/04/2026	USD	2,565,000	2,408,759	0.17
Novelis Corp., 144A 4.75% 30/01/2030	USD	405,000	359,972	0.02
Novelis Corp., 144A 3.875% 15/08/2031	USD	2,205,000	1,803,122	0.12
OneMain Finance Corp. 6.125% 15/03/2024	USD	1,300,000	1,260,350	0.09
Option Care Health, Inc., 144A 4.375% 31/10/2029	USD	1,320,000	1,156,300	0.08

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Owens & Minor, Inc., 144A 4.5% 31/03/2029	USD	2,280,000	1,820,808	0.13
Owl Rock Capital Corp. II, 144A 4.625% 26/11/2024	USD	1,100,000	1,046,905	0.07
Owl Rock Capital Corp. III 3.125% 13/04/2027	USD	1,050,000	865,898	0.06
OWL Rock Core Income Corp. 4.7% 08/02/2027	USD	1,150,000	1,038,534	0.07
Par Pharmaceutical, Inc., 144A 7.5% 01/04/2027 <sup>1</sup>	USD	4,430,000	3,376,101	0.23
Park Intermediate Holdings LLC, REIT, 144A 4.875% 15/05/2029	USD	1,320,000	1,119,096	0.08
Party City Holdings, Inc., 144A 8.75% 15/02/2026	USD	3,440,000	997,600	0.07
Performance Food Group, Inc., 144A 5.5% 15/10/2027	USD	440,000	415,928	0.03
Performance Food Group, Inc., 144A 4.25% 01/08/2029	USD	1,235,000	1,071,733	0.07
PGT Innovations, Inc., 144A 4.375% 01/10/2029	USD	1,135,000	951,717	0.07
Post Holdings, Inc., 144A 5.625% 15/01/2028	USD	1,530,000	1,442,492	0.10
Post Holdings, Inc., 144A 4.625% 15/04/2030	USD	3,585,000	3,100,398	0.21
Premier Entertainment Sub LLC, 144A 5.625% 01/09/2029	USD	745,000	550,331	0.04
Premier Entertainment Sub LLC, 144A 5.875% 01/09/2031	USD	745,000	527,981	0.04
Prestige Brands, Inc., 144A 3.75% 01/04/2031	USD	825,000	681,405	0.05
Radiology Partners, Inc., 144A 9.25% 01/02/2028	USD	2,440,000	1,373,559	0.10
Real Hero Merger Sub 2, Inc., 144A 6.25% 01/02/2029	USD	295,000	202,606	0.01
Realogy Group LLC, 144A 5.75% 15/01/2029	USD	2,025,000	1,534,322	0.11
RHP Hotel Properties LP, REIT, 144A 4.5% 15/02/2029	USD	1,185,000	1,023,684	0.07
RLJ Lodging Trust LP, REIT, 144A 4% 15/09/2029	USD	1,910,000	1,551,131	0.11
Rocket Mortgage LLC, 144A 2.875% 15/10/2026	USD	890,000	764,388	0.05
Rocket Mortgage LLC, 144A 3.625% 01/03/2029	USD	1,025,000	813,951	0.06
Rockies Express Pipeline LLC, 144A 4.95% 15/07/2029	USD	1,275,000	1,147,997	0.08
Roller Bearing Co. of America, Inc., 144A 4.375% 15/10/2029	USD	2,195,000	1,900,760	0.13
Royal Caribbean Cruises Ltd., 144A 11.5% 01/06/2025	USD	733,000	787,755	0.05
Royal Caribbean Cruises Ltd., 144A 4.25% 01/07/2026	USD	1,180,000	955,325	0.07
RP Escrow Issuer LLC, 144A 5.25% 15/12/2025	USD	550,000	420,695	0.03
Sabre GLBL, Inc., 144A 9.25% 15/04/2025	USD	1,625,000	1,621,550	0.11
Sabre GLBL, Inc., 144A 7.375% 01/09/2025	USD	83,000	79,904	0.01
Sally Holdings LLC 5.625% 01/12/2025	USD	4,015,000	3,873,953	0.27
Scientific Games Holdings LP, 144A 6.625% 01/03/2030	USD	900,000	761,400	0.05
Scientific Games International, Inc., 144A 8.625% 01/07/2025	USD	490,000	500,742	0.03
Scientific Games International, Inc., 144A 7% 15/05/2028	USD	1,515,000	1,447,893	0.10
Scientific Games International, Inc., 144A 7.25% 15/11/2029	USD	3,765,000	3,621,177	0.25
SCIH Salt Holdings, Inc., 144A 4.875% 01/05/2028	USD	2,800,000	2,407,845	0.17
SCIH Salt Holdings, Inc., 144A 6.625% 01/05/2029	USD	1,560,000	1,258,576	0.09
Scotts Miracle-Gro Co. (The) 4.5% 15/10/2029	USD	1,330,000	1,079,694	0.07

<sup>1</sup> Security is currently in default.



## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Scotts Miracle-Gro Co. (The) 4.375% 01/02/2032	USD	2,380,000	1,797,304	0.12
Scripps Escrow II, Inc., 144A 3.875% 15/01/2029	USD	821,000	660,059	0.05
Service Properties Trust, REIT 4.35% 01/10/2024	USD	238,000	216,735	0.02
Simmons Foods, Inc., 144A 4.625% 01/03/2029	USD	2,155,000	1,756,891	0.12
Sinclair Television Group, Inc., 144A 4.125% 01/12/2030	USD	1,175,000	882,462	0.06
Sirius XM Radio, Inc., 144A 4% 15/07/2028	USD	4,455,000	3,885,740	0.27
Sirius XM Radio, Inc., 144A 4.125% 01/07/2030	USD	1,000,000	827,465	0.06
Sirius XM Radio, Inc., 144A 3.875% 01/09/2031	USD	2,080,000	1,626,756	0.11
Six Flags Theme Parks, Inc., 144A 7% 01/07/2025	USD	1,550,000	1,563,085	0.11
Sonic Automotive, Inc., 144A 4.625% 15/11/2029	USD	2,340,000	1,876,698	0.13
Sonic Automotive, Inc., 144A 4.875% 15/11/2031	USD	1,195,000	941,080	0.07
Sprint Capital Corp. 6.875% 15/11/2028	USD	1,875,000	1,950,366	0.14
Sprint Capital Corp. 8.75% 15/03/2032	USD	1,020,000	1,216,202	0.08
Stagwell Global LLC, 144A 5.625% 15/08/2029	USD	1,410,000	1,165,302	0.08
Starwood Property Trust, Inc., REIT, 144A 5.5% 01/11/2023	USD	2,015,000	2,000,512	0.14
Starwood Property Trust, Inc., REIT, 144A 4.375% 15/01/2027	USD	1,095,000	959,763	0.07
Stericycle, Inc., 144A 3.875% 15/01/2029	USD	1,110,000	969,935	0.07
Sunoco LP 4.5% 15/05/2029	USD	460,000	403,027	0.03
Sunoco LP 4.5% 30/04/2030	USD	1,300,000	1,130,220	0.08
Surgery Center Holdings, Inc., 144A 10% 15/04/2027	USD	910,000	927,363	0.06
Synaptics, Inc., 144A 4% 15/06/2029	USD	725,000	611,895	0.04
Talen Energy Supply LLC, 144A 7.25% 15/05/2027 <sup>†</sup>	USD	2,370,000	2,463,888	0.17
Talen Energy Supply LLC, 144A 7.625% 01/06/2028 <sup>†</sup>	USD	525,000	548,307	0.04
Tempur Sealy International, Inc., 144A 4% 15/04/2029	USD	705,000	593,332	0.04
Tenet Healthcare Corp., 144A 4.875% 01/01/2026	USD	4,575,000	4,335,603	0.30
Tenet Healthcare Corp., 144A 4.25% 01/06/2029	USD	2,560,000	2,222,451	0.15
Tenet Healthcare Corp., 144A 4.375% 15/01/2030	USD	2,910,000	2,523,901	0.17
TransDigm, Inc., 144A 6.25% 15/03/2026	USD	4,275,000	4,225,367	0.29
Travel + Leisure Co., 144A 4.5% 01/12/2029	USD	880,000	718,344	0.05
Travel + Leisure Co., 144A 4.625% 01/03/2030	USD	975,000	810,294	0.06
Triumph Group, Inc., 144A 8.875% 01/06/2024	USD	1,069,000	1,089,364	0.08
Triumph Group, Inc., 144A 6.25% 15/09/2024	USD	2,095,000	1,989,265	0.14
Uber Technologies, Inc., 144A 8% 01/11/2026	USD	1,910,000	1,920,451	0.13
Unisys Corp., 144A 6.875% 01/11/2027	USD	725,000	557,742	0.04
United Airlines, Inc., 144A 4.625% 15/04/2029	USD	950,000	828,828	0.06
Univision Communications, Inc., 144A 5.125% 15/02/2025	USD	330,000	314,959	0.02
Univision Communications, Inc., 144A 6.625% 01/06/2027	USD	3,125,000	<b>3,021,672</b>	0.21
Univision Communications, Inc., 144A 4.5% 01/05/2029	USD	3,230,000	<b>2,707,176</b>	0.19
Univision Communications, Inc., 144A 7.375% 30/06/2030	USD	700,000	669,837	0.05
US Foods, Inc., 144A 4.625% 01/06/2030	USD	1,230,000	1,084,724	0.08
Vail Resorts, Inc., 144A 6.25% 15/05/2025	USD	1,630,000	1,632,805	0.11
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A 3.875% 15/08/2029	USD	1,420,000	1,244,992	0.09

† Security is currently in default.

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A 4.125% 15/08/2031	USD	1,580,000	1,348,925	0.09
Veritas US, Inc., 144A 7.5% 01/09/2025	USD	345,000	238,350	0.02
Viavi Solutions, Inc., 144A 3.75% 01/10/2029	USD	350,000	294,735	0.02
VICI Properties LP, REIT, 144A 4.625% 01/12/2029	USD	367,000	334,587	0.02
VICI Properties LP, REIT, 144A 4.125% 15/08/2030	USD	423,000	370,905	0.03
VICI Properties LP, REIT, Reg. S 5.625% 01/05/2024	USD	285,000	282,758	0.02
VICI Properties LP, REIT, Reg. S 4.625% 15/06/2025	USD	360,000	345,618	0.02
VICI Properties LP, REIT, Reg. S 5.75% 01/02/2027	USD	1,240,000	1,210,316	0.08
VICI Properties LP, REIT, Reg. S 3.875% 15/02/2029	USD	705,000	618,905	0.04
Virgin Media Secured Finance plc, 144A 4.5% 15/08/2030	USD	2,175,000	1,820,910	0.13
Warnermedia Holdings, Inc., 144A 4.279% 15/03/2032	USD	522,000	431,312	0.03
Warrior Met Coal, Inc., 144A 7.875% 01/12/2028	USD	3,480,000	3,435,082	0.24
WASH Multifamily Acquisition, Inc., 144A 5.75% 15/04/2026	USD	3,206,000	3,025,358	0.21
Weatherford International Ltd., 144A 11% 01/12/2024	USD	201,000	205,779	0.01
Weatherford International Ltd., 144A 6.5% 15/09/2028	USD	995,000	976,831	0.07
Weatherford International Ltd., 144A 8.625% 30/04/2030	USD	3,230,000	3,107,561	0.22
WESCO Distribution, Inc., 144A 7.125% 15/06/2025	USD	550,000	558,092	0.04
WESCO Distribution, Inc., 144A 7.25% 15/06/2028	USD	525,000	532,990	0.04
Western Midstream Operating LP 4.5% 01/03/2028	USD	2,450,000	2,261,203	0.16
WeWork Cos. LLC, 144A 5% 10/07/2025	USD	725,000	240,852	0.02
Wheel Pros, Inc., 144A 6.5% 15/05/2029	USD	800,000	284,000	0.02
WMG Acquisition Corp., 144A 3.75% 01/12/2029	USD	358,000	308,345	0.02
WMG Acquisition Corp., 144A 3.875% 15/07/2030	USD	1,412,000	1,218,732	0.08
WMG Acquisition Corp., 144A 3% 15/02/2031	USD	550,000	440,382	0.03
WR Grace Holdings LLC, 144A 5.625% 15/08/2029	USD	965,000	781,428	0.05
Wyndham Hotels & Resorts, Inc., 144A 4.375% 15/08/2028	USD	3,605,000	3,240,174	0.22
Wynn Las Vegas LLC, 144A 4.25% 30/05/2023	USD	1,675,000	1,653,416	0.11
Wynn Resorts Finance LLC, 144A 7.75% 15/04/2025	USD	1,540,000	1,533,896	0.11
			424,907,233	29.42
<b>Total Bonds</b>			<b>578,076,859</b>	<b>40.03</b>
<b>Total Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market</b>			<b>578,076,859</b>	<b>40.03</b>
<b>Recently issued securities</b>				
<b>Bonds</b>				
<i>Australia</i>				
Mineral Resources Ltd., 144A 8.5% 01/05/2030	USD	1,995,000	2,024,915	0.14
			2,024,915	0.14
<i>Brazil</i>				
CSN Resources SA, 144A 5.875% 08/04/2032	USD	1,800,000	1,508,711	0.11
			1,508,711	0.11
<i>United States of America</i>				
Avient Corp., 144A 7.125% 01/08/2030	USD	555,000	543,279	0.04
Community Health Systems, Inc., 144A 5.25% 15/05/2030	USD	1,565,000	1,182,862	0.08
Darling Ingredients, Inc., 144A 6% 15/06/2030	USD	1,305,000	1,277,399	0.09

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
EQM Midstream Partners LP, 144A 7.5% 01/06/2030	USD	169,000	163,068	0.01
Frontier Communications Holdings LLC, 144A 8.75% 15/05/2030	USD	700,000	713,086	0.05
Hess Midstream Operations LP, 144A 5.5% 15/10/2030	USD	365,000	334,415	0.02
Holly Energy Partners LP, 144A 6.375% 15/04/2027	USD	360,000	354,165	0.02
Lindblad Expeditions LLC, 144A 6.75% 15/02/2027	USD	500,000	454,210	0.03
News Corp., 144A 5.125% 15/02/2032	USD	1,690,000	1,540,342	0.11
Oxford Finance LLC, 144A 6.375% 01/02/2027	USD	1,610,000	1,500,697	0.10
Realogy Group LLC, 144A 5.25% 15/04/2030	USD	1,980,000	1,447,004	0.10
Royal Caribbean Cruises Ltd., 144A 5.375% 15/07/2027	USD	1,705,000	1,382,671	0.10
Royal Caribbean Cruises Ltd., 144A 8.25% 15/01/2029	USD	1,250,000	1,257,813	0.09
Ryan Specialty Group LLC, 144A 4.375% 01/02/2030	USD	1,850,000	1,604,220	0.11
Sabre Global, Inc., 144A 11.25% 15/12/2027	USD	653,000	672,819	0.05
			14,428,050	1.00
<b>Total Bonds</b>			<b>17,961,676</b>	<b>1.25</b>
<b>Total Recently issued securities</b>			<b>17,961,676</b>	<b>1.25</b>
<b>Other transferable securities and money market instruments</b>				
<b>Bonds</b>				
<i>Russian Federation</i>				
Russian Federation Bond - OFZ 8.15% 03/02/2027 <sup>*</sup>	RUB	22,460,000	103,544	0.01
			103,544	0.01
<i>Ukraine</i>				
Ukraine Government Bond 15.97% 19/04/2023 <sup>*</sup>	UAH	105,915,000	2,151,753	0.15
Ukraine Government Bond 16% 27/09/2023 <sup>†</sup>	UAH	38,390,000	623,940	0.04
			2,775,693	0.19
<i>United Kingdom</i>				
Altera Infrastructure LP, 144A 8.5% 15/07/2023 <sup>‡</sup>	USD	2,275,000	424,970	0.03
			424,970	0.03
<i>United States of America</i>				
Diamond Offshore Drilling, Inc. 0% 22/03/2027 <sup>*</sup>	USD	42,225	40,114	-
LSC Communications, Inc., 144A 8.75% 15/10/2023 <sup>‡</sup>	USD	2,035,906	6,150	-
Treehouse Park Improvement Association No. 1, 144A 9.75% 01/12/2033 <sup>*</sup>	USD	788,508	697,514	0.05
			743,778	0.05
<b>Total Bonds</b>			<b>4,047,985</b>	<b>0.28</b>
<b>Equities</b>				
<i>Brazil</i>				
Constellation Oil Services Holding SA 'B-1' <sup>*</sup>	USD	500,114	55,012	-
			55,012	-
<i>United States of America</i>				
ACR III LSC HOLDINGS LLC <sup>*</sup>	USD	226	94,578	0.01
Rotech Healthcare, Inc. <sup>†</sup>	USD	153,793	16,455,851	1.14
			16,550,429	1.15
<b>Total Equities</b>			<b>16,605,441</b>	<b>1.15</b>
<b>Total Other transferable securities and money market instruments</b>			<b>20,653,426</b>	<b>1.43</b>
<b>Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings</b>				

\* Security is valued at its fair value under the direction of the Board of Directors of the Company.

† Security is currently in default.

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<b>Collective Investment Schemes - UCITS</b>				
<i>Luxembourg</i>				
JPMorgan USD Treasury CNAV Fund - JPM USD Treasury CNAV Institutional (dist.)	USD	62,568,210	62,568,210	4.33
			62,568,210	4.33
<b>Total Collective Investment Schemes - UCITS</b>			<b>62,568,210</b>	<b>4.33</b>
<b>Total Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings</b>			<b>62,568,210</b>	<b>4.33</b>
<b>Total Investments</b>			<b>1,362,009,356</b>	<b>94.31</b>
<b>Cash</b>			<b>54,749,786</b>	<b>3.79</b>
<b>Other assets/(liabilities)</b>			<b>27,448,211</b>	<b>1.90</b>
<b>Total net assets</b>			<b>1,444,207,353</b>	<b>100.00</b>

## Financial Futures Contracts

Security Description	Number of Contracts	Currency	Global Exposure USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
Euro-Bund, 08/03/2023	(21)	EUR	(2,988,194)	193,081	0.02
US 5 Year Note, 31/03/2023	(172)	USD	(18,563,906)	33,976	-
<b>Total Unrealised Gain on Financial Futures Contracts</b>				<b>227,057</b>	<b>0.02</b>
US Ultra Bond, 22/03/2023	121	USD	16,251,813	(109,692)	(0.01)
<b>Total Unrealised Loss on Financial Futures Contracts</b>				<b>(109,692)</b>	<b>(0.01)</b>
<b>Net Unrealised Gain on Financial Futures Contracts</b>				<b>117,365</b>	<b>0.01</b>

## Interest Rate Swap Contracts

Nominal Amount	Currency	Counterparty	Security Description	Maturity Date	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
28,800,000	PLN	Goldman Sachs	Pay floating WIBOR 6 month Receive fixed 7.75%	14/11/2024	69,472	69,472	0.01
390,800,000	HUF	Goldman Sachs	Pay floating BUBOR 6 month Receive fixed 11.5%	11/11/2027	9,124	9,124	-
<b>Total Unrealised Gain on Interest Rate Swap Contracts</b>					<b>78,596</b>	<b>78,596</b>	<b>0.01</b>
117,180,000	MXN	Goldman Sachs	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 7.18%	09/09/2031	(558,127)	(558,127)	(0.04)
137,900,000	MXN	Goldman Sachs	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 6.63%	23/06/2026	(500,452)	(500,452)	(0.04)
50,575,000	MXN	Goldman Sachs	Pay floating TIIE 4 week Receive fixed 6.68%	14/09/2026	(185,151)	(185,151)	(0.01)
2,843,833	BRL	Barclays	Pay floating CDI 1 day Receive fixed 11.15%	02/01/2026	(20,312)	(20,312)	-
2,815,000	BRL	BNP Paribas	Pay floating CDI 1 day Receive fixed 11.46%	02/01/2026	(15,582)	(15,582)	-

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

## Interest Rate Swap Contracts

Nominal Amount	Currency	Counterparty	Security Description	Maturity Date	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
2,795,339	BRL	Barclays	Pay floating CDI 1 day Receive fixed 11.46%	02/01/2026	(15,489)	(15,489)	-
<b>Total Unrealised Loss on Interest Rate Swap Contracts</b>					<b>(1,295,113)</b>	<b>(1,295,113)</b>	<b>(0.09)</b>
<b>Net Unrealised Loss on Interest Rate Swap Contracts</b>					<b>(1,216,517)</b>	<b>(1,216,517)</b>	<b>(0.08)</b>

## Forward Currency Exchange Contracts

Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
USD	3,743,777	MYR	16,470,000	10/01/2023	J.P. Morgan	3,741	-
CZK	259,330,000	USD	11,253,200	11/01/2023	Bank of America	216,502	0.01
THB	331,300,000	USD	9,553,057	11/01/2023	Citibank	19,613	-
CNH	21,600,000	USD	3,109,815	12/01/2023	Citibank	13,731	-
CNH	27,000,000	USD	3,890,904	13/01/2023	Morgan Stanley	13,843	-
ZAR	89,600,000	USD	5,152,433	13/01/2023	Morgan Stanley	116,267	0.01
PLN	29,830,000	USD	6,672,184	17/01/2023	BNP Paribas	128,554	0.01
MXN	107,568,000	USD	5,422,321	20/01/2023	BNP Paribas	79,395	0.01
PLN	6,900,000	USD	1,560,930	23/01/2023	J.P. Morgan	11,250	-
USD	964,967	COP	4,641,300,000	23/01/2023	Morgan Stanley	11,347	-
PLN	29,545,000	USD	6,059,755	25/01/2023	BNY Mellon	670,847	0.05
MYR	7,010,000	USD	1,588,057	23/03/2023	J.P. Morgan	8,709	-
<b>Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>1,293,799</b>	<b>0.09</b>
<b>CNH Hedged Share Class</b>							
CNH	567,235	USD	81,686	20/01/2023	J.P. Morgan	394	-
<b>EUR Hedged Share Class</b>							
EUR	68,562,714	USD	73,142,017	20/01/2023	J.P. Morgan	341,190	0.02
USD	2	EUR	2	20/01/2023	J.P. Morgan	-	-
<b>GBP Hedged Share Class</b>							
GBP	66,251	USD	79,945	20/01/2023	J.P. Morgan	187	-
USD	69,256	GBP	56,261	20/01/2023	J.P. Morgan	1,207	-
<b>JPY Hedged Share Class</b>							
JPY	30,363,970,380	USD	225,660,615	20/01/2023	J.P. Morgan	6,247,307	0.43
<b>SGD Hedged Share Class</b>							
SGD	28,628,019	USD	21,286,292	20/01/2023	J.P. Morgan	95,334	0.01
<b>Unrealised Gain on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>6,685,619</b>	<b>0.46</b>
<b>Total Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>7,979,418</b>	<b>0.55</b>
INR	18,700,000	USD	226,584	10/01/2023	Standard Chartered	(637)	-
MYR	16,470,000	USD	3,750,256	10/01/2023	Standard Chartered	(10,219)	-
USD	7,141,758	EUR	6,780,650	10/01/2023	Bank of America	(120,197)	(0.01)
USD	787,404	EUR	740,000	10/01/2023	Barclays	(5,122)	-
USD	4,263,922	ZAR	73,625,000	11/01/2023	UBS	(66,265)	-
USD	6,519,735	CNH	45,260,000	12/01/2023	Morgan Stanley	(25,251)	-
USD	7,057,914	EUR	6,700,000	12/01/2023	Goldman Sachs	(118,716)	(0.01)
USD	3,128,921	ZAR	53,870,000	12/01/2023	Bank of America	(39,081)	-

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

Forward Currency Exchange Contracts							
Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
USD	5,618,431	CNH	39,000,000	13/01/2023	J.P. Morgan	(21,759)	-
USD	5,085,550	CZK	117,800,000	13/01/2023	Goldman Sachs	(123,841)	(0.01)
USD	5,261,151	EUR	4,979,000	13/01/2023	J.P. Morgan	(72,440)	-
USD	5,413,484	MXN	107,595,000	13/01/2023	Goldman Sachs	(97,712)	(0.01)
USD	3,247,169	PLN	14,620,000	13/01/2023	Barclays	(87,221)	(0.01)
USD	9,602,639	CNH	66,850,000	20/01/2023	HSBC	(70,671)	-
USD	1,480,148	EUR	1,405,000	20/01/2023	J.P. Morgan	(25,684)	-
USD	3,602,055	EUR	3,400,000	23/01/2023	Bank of America	(42,751)	-
HUF	613,800,000	USD	1,856,933	25/01/2023	BNP Paribas	(222,841)	(0.02)
PLN	2,900,000	USD	692,752	25/01/2023	Goldman Sachs	(32,108)	-
USD	809,176	HUF	309,000,000	25/01/2023	Goldman Sachs	(13,461)	-
USD	795,179	HUF	304,800,000	25/01/2023	Morgan Stanley	(16,276)	-
USD	3,523,371	PLN	17,690,000	25/01/2023	BNY Mellon	(506,561)	(0.04)
USD	315,080	PLN	1,495,000	25/01/2023	Morgan Stanley	(25,494)	-
THB	54,660,000	USD	1,594,934	23/03/2023	Bank of America	(4,374)	-
<b>Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>(1,748,682)</b>	<b>(0.11)</b>
<b>AUD Hedged Share Class</b>							
AUD	18,450,525	USD	12,712,426	20/01/2023	J.P. Morgan	(141,131)	(0.01)
USD	151,981	AUD	225,889	20/01/2023	J.P. Morgan	(1,928)	-
<b>CHF Hedged Share Class</b>							
CHF	1,957,328	USD	2,122,125	20/01/2023	J.P. Morgan	(1,141)	-
USD	47,558	CHF	44,270	20/01/2023	J.P. Morgan	(413)	-
<b>CNH Hedged Share Class</b>							
USD	850	CNH	5,919	20/01/2023	J.P. Morgan	(6)	-
<b>EUR Hedged Share Class</b>							
USD	946,343	EUR	889,285	20/01/2023	J.P. Morgan	(6,762)	-
<b>GBP Hedged Share Class</b>							
GBP	45,271,168	USD	56,187,683	20/01/2023	J.P. Morgan	(1,430,803)	(0.11)
USD	76,784	GBP	63,713	20/01/2023	J.P. Morgan	(280)	-
<b>JPY Hedged Share Class</b>							
USD	227,195	JPY	30,000,000	20/01/2023	J.P. Morgan	(1,933)	-
<b>SGD Hedged Share Class</b>							
USD	304,001	SGD	410,337	20/01/2023	J.P. Morgan	(2,471)	-
<b>Unrealised Loss on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>(1,586,868)</b>	<b>(0.12)</b>
<b>Total Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>(3,335,550)</b>	<b>(0.23)</b>
<b>Net Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts</b>						<b>4,643,868</b>	<b>0.32</b>

## Capital Group Global High Income Opportunities (LUX) (continued)

As at 31 December 2022

## Credit Default Swap Contracts

Nominal Amount	Currency	Counterparty	Reference Entity	Buy/Sell	Interest (Paid)/Received Rate	Maturity Date	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
18,780,000	USD	Goldman Sachs	CDX.NA.HY.37-V2	Sell	5.00%	20/12/2026	533,271	533,271	0.04
<b>Total Unrealised Gain on Credit Default Swap Contracts</b>							<b>533,271</b>	<b>533,271</b>	<b>0.04</b>
8,500,000	USD	Goldman Sachs	CDX.NA.EM.38-V1	Sell	1.00%	20/12/2027	(497,237)	(497,237)	(0.03)
13,400,000	USD	Goldman Sachs	CDX.NA.HY.39-V1	Buy	(5.00)%	20/12/2027	(87,139)	(87,139)	(0.01)
<b>Total Unrealised Loss on Credit Default Swap Contracts</b>							<b>(584,376)</b>	<b>(584,376)</b>	<b>(0.04)</b>
<b>Net Unrealised Loss on Credit Default Swap Contracts</b>							<b>(51,105)</b>	<b>(51,105)</b>	<b>-</b>

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

## キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（LUX）

## 損益および純資産変動計算書

2022年12月31日現在

(USD)

収益	
債券および転換社債に係る利息（源泉徴収税額控除後）	91,796,889
受取配当金（源泉徴収税額控除後）	147,820
その他収益	-
証券貸付収益	-
銀行預金利息	1,190,695
スワップ取引	730,486
収益小計	93,865,890
費用	
運用報酬	10,582,858
管理手数料	554,346
年次税	427,958
専門家サービス	362,444
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	258,603
スワップ取引	663,001
税金費用	-
その他費用	77,980
印刷費用	57,392
当座貸越利息*	-
費用小計	12,984,582
費用の払戻し	137,511
投資純利益 / (損失) (a)	81,018,819
実現純利益 / (損失)	
投資有価証券の売却取引	-71,864,103
金融先物取引	3,788,014
為替取引	-37,629,182
スワップ取引	1,128,924

当期実現純利益 / (損失) (b)	-104,576,347
未実現評価利益 / (損失)の増減	
投資有価証券	-218,958,143
金融先物取引	95,397
スワップ取引	-2,168,874
為替取引	3,897,523
当期末実現評価利益 / (損失)の増減 (c)	-217,134,097
当期損益 (a+b+c)	-240,691,625
配当金の分配	-22,680,583
当期投資証券の差引増減額	-35,817,221
期首純資産総額	1,743,396,782
期末純資産総額	1,444,207,353

\*主に中央銀行が実施するマイナス金利政策によるものです。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

### 日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（米ドル売り円買い）」、「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（為替ヘッジなし）」、「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型 / 米ドル売り円買い）」および「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型）」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アセットマネジメント株式会社からの資料に基づき委託会社が作成したものでありますが、これらは監査意見の対象外であります。

なお、同ファンド（「日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」）は、三菱UFJアセットマネジメント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2023年7月25日から2024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）

（2024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449回 利付国債 (2)	0.005	2025/6/1	国債	1,100,000	100.0061	1,100,066,000
日本	第452回 利付国債 (2)	0.005	2025/9/1	国債	200,000	99.976	199,952,000
日本	第452回 利付国債 (2)	0.005	2025/9/1	国債	500,000	99.976	499,880,000
日本	第452回 利付国債 (2)	0.005	2025/9/1	国債	1,000,000	99.976	999,760,000
日本	第452回 利付国債 (2)	0.005	2025/9/1	国債	1,000,000	99.976	999,760,000
日本	第453回 利付国債 (2)	0.005	2025/10/1	国債	500,000	99.957	499,785,000
日本	第453回 利付国債 (2)	0.005	2025/10/1	国債	1,500,000	99.9571	1,499,355,000
日本	第454回 利付国債 (2)	0.100	2025/11/1	国債	400,000	100.123	400,492,000
日本	第455回 利付国債 (2)	0.005	2025/12/1	国債	900,000	99.926	899,334,000
日本	第455回 利付国債 (2)	0.005	2025/12/1	国債	500,000	99.926	499,630,000
日本	第456回 利付国債 (2)	0.100	2026/1/1	国債	1,500,000	100.0671	1,501,005,000
日本	第150回 利付国債 (5)	0.0052	2026/12/20	国債	1,000,000	99.811	998,110,000
日本	第151回 利付国債 (5)	0.005	2027/3/20	国債	500,000	99.733	498,665,000
日本	第153回 利付国債 (5)	0.005	2027/6/20	国債	500,000	99.627	498,135,000
日本	第81回神奈川県公募公債 (5年)	0.020	2025/3/19	地方債	100,000	99.919	99,919,000
日本	第287回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	0.091	2026/9/11	特殊債	200,000	99.687	199,374,000



日本	第68回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.355	2025/1/28	特殊債	100,000	100.245	100,245,000
日本	第72回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.529	2025/5/28	特殊債	200,000	100.514	201,028,000
日本	第99回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.225	2027/8/27	特殊債	200,000	99.719	199,438,000
日本	第35回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2021)	0.2792	2026/10/21	社債	100,000	98.314	98,314,000
日本	第6回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー(非上位円貨社債)(2019)	1.258	2024/1/25	社債	100,000	99.997	99,997,000
日本	第15回クレディ・アグリコル・エス・エー期限前償還条項付非上位円貨社債(2024)	0.000	2028/1/26	社債	200,000	100.001	200,002,000
日本	第12回ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー期限前償還条項付円貨社債(2023)	1.377	2027/12/1	社債	200,000	99.9	199,800,000
日本	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債(2019)	0.463	2024/12/5	社債	200,000	99.742	199,484,000
日本	第24回ルノー円貨社債(2021)	1.540	2024/7/5	社債	200,000	100.327	200,654,000
日本	第508回関西電力(一般担保付)	0.455	2027/4/23	社債	105,000	99.977	104,975,850
日本	第509回関西電力(一般担保付)	0.470	2027/5/25	社債	100,000	100.003	100,003,000
日本	第477回東北電力(一般担保付)	0.741	2025/2/25	社債	100,000	100.55	100,550,000
日本	第483回東北電力(一般担保付)	0.300	2026/5/25	社債	200,000	99.849	199,698,000
日本	第503回九州電力(一般担保付)	0.360	2027/4/23	社債	200,000	99.737	199,474,000
日本	第18回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)	0.340	2025/4/30	社債	100,000	100.163	100,163,000
日本	第22回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)	0.130	2025/9/12	社債	200,000	99.821	199,642,000
日本	第29回大和ハウス工業(特定社債間限定同順位特約付)	0.2102	2025/10/27	社債	100,000	99.979	99,979,000
日本	第12回アサヒグループホールディングス(特定社債間限定同順位特約付)	0.330	2027/6/11	社債	200,000	99.656	199,312,000
日本	第12回アサヒグループホールディングス(特定社債間限定同順位特約付)	0.330	2027/6/11	社債	200,000	99.656	199,312,000
日本	第14回森ビル(社債間限定同順位特約付)	0.861	2024/8/14	社債	100,000	100.345	100,345,000
日本	第12回セブン&アイ・ホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.781	2025/6/20	社債	100,000	100.754	100,754,000
日本	第14回セブン&アイ・ホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.1902	2025/12/19	社債	100,000	99.774	99,774,000
日本	第15回セブン&アイ・ホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.2802	2027/12/20	社債	200,000	99.184	198,368,000
日本	第63回神戸製鋼所(社債間限定同順位特約付)	0.924	2025/5/21	社債	100,000	100.654	100,654,000
日本	第67回神戸製鋼所(社債間限定同順位特約付)	0.200	2026/6/10	社債	100,000	99.245	99,245,000
日本	第19回日立製作所(社債間限定同順位特約付)	0.160	2027/3/12	社債	200,000	99.183	198,366,000
日本	第18回デンソー(社債間限定同順位特約付)	0.315	2028/3/17	社債	200,000	99.27	198,540,000
日本	第43回IHI(社債間限定同順位特約付)	0.2002	2024/10/17	社債	100,000	99.875	99,875,000

日本	第49回IHI(社債間限定同順位特約付)(トランジションボンド)	0.390	2027/6/4	社債券	100,000	99.166	99,166,000
日本	第8回JA三井リース(社債間限定同順位特約付)	0.310	2024/9/13	社債券	100,000	100.062	100,062,000
日本	第25回JA三井リース(社債間限定同順位特約付)	0.390	2026/9/1	社債券	100,000	99.808	99,808,000
日本	第27回JA三井リース(社債間限定同順位特約付)	0.430	2027/1/25	社債券	100,000	99.822	99,822,000
日本	第78回伊藤忠商事(社債間限定同順位特約付)	0.785	2024/5/30	社債券	100,000	100.245	100,245,000
日本	第19回三井住友信託銀行(社債間限定同順位特約付)	0.140	2026/4/28	社債券	200,000	99.385	198,770,000
日本	第2回NTTファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.260	2026/12/18	社債券	200,000	99.588	199,176,000
日本	第16回NTTファイナンス(日本電信電話株式会社保証付)	0.180	2025/12/19	社債券	200,000	99.661	199,322,000
日本	第80回ホンダファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.260	2026/6/19	社債券	100,000	99.758	99,758,000
日本	第81回ホンダファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.389	2028/6/20	社債券	200,000	99.238	198,476,000
日本	第18回SBIホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.690	2024/5/30	社債券	100,000	100.011	100,011,000
日本	第25回SBIホールディングス(社債間限定同順位特約付)	0.600	2024/7/26	社債券	100,000	99.925	99,925,000
日本	第29回SBIホールディングス(社債間限定同順位特約付)	1.000	2025/7/22	社債券	100,000	99.995	99,995,000
日本	第96回トヨタファイナンス(社債間限定同順位特約付)	0.060	2026/4/15	社債券	100,000	99.436	99,436,000
日本	第100回トヨタファイナンス(社債間限定同等特約付)	0.370	2026/10/13	社債券	100,000	100.131	100,131,000
日本	第42回リコーリース(社債間限定同順位特約付)	0.390	2027/6/1	社債券	100,000	99.463	99,463,000
日本	第17回イオンフィナンシャルサービス(社債間限定同順位特約付)	0.340	2026/7/31	社債券	200,000	99.371	198,742,000
日本	第20回イオンフィナンシャルサービス(社債間限定同順位特約付)	0.590	2026/2/24	社債券	100,000	100.026	100,026,000
日本	第69回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	1.210	2024/9/26	社債券	100,000	100.62	100,620,000
日本	第79回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.290	2025/2/28	社債券	100,000	99.939	99,939,000
日本	第80回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.280	2026/2/26	社債券	100,000	99.55	99,550,000
日本	第84回アコム(特定社債間限定同順位特約付)	0.550	2026/12/18	社債券	100,000	99.903	99,903,000
日本	第57回日立キャピタル(社債間限定同順位特約付)	0.616	2024/12/20	社債券	100,000	100.339	100,339,000
日本	第219回オリックス(社債間限定同順位特約付)	0.430	2026/11/27	社債券	100,000	99.977	99,977,000
日本	第1回三井住友ファイナンス&リース(社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)	0.170	2025/3/12	社債券	100,000	99.869	99,869,000
日本	第35回三井住友ファイナンス&リース(社債間限定同順位特約付)	0.709	2028/2/2	社債券	100,000	100.276	100,276,000
日本	第32回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付)	0.695	2024/10/25	社債券	100,000	100.36	100,360,000
日本	第75回三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付)	0.220	2025/1/23	社債券	100,000	99.947	99,947,000

日本	第18回大和証券グループ本社(社債間限定同順位特約付)	0.871	2024/8/28	社債券	100,000	100.335	100,335,000
日本	第40回大和証券グループ本社(社債間限定同順位特約付)	0.5752	2026/11/27	社債券	100,000	100.047	100,047,000
日本	第3回野村ホールディングス(担保提供制限等財務上特約無)	0.280	2026/9/4	社債券	100,000	98.948	98,948,000
日本	第27回野村ホールディングス	2.107	2025/9/24	社債券	100,000	102.451	102,451,000
日本	第37回イオンモール(社債間限定同順位特約付)(グリーンbond)	1.1072	2028/12/14	社債券	100,000	100.406	100,406,000
日本	第184回東日本旅客鉄道(社債間限定同順位特約付)	0.2102	2025/10/14	社債券	100,000	99.922	99,922,000
日本	第184回東日本旅客鉄道(社債間限定同順位特約付)	0.2102	2025/10/14	社債券	100,000	99.922	99,922,000
日本	第6回ファーストリテイリング(特定社債間限定同順位特約付)	0.220	2025/6/6	社債券	100,000	99.93	99,930,000
合 計					19,705,000		19,686,288,850

## 2【ファンドの現況】

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

<更新・訂正後>

### 【純資産額計算書】

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース(成長型/米ドル売り円買い)

2024年4月30日現在

資産総額	66,067,814円
負債総額	117,377円
純資産総額( - )	65,950,437円
発行済口数	66,230,121口
1口当たり純資産額( / )	0.9958円

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース(成長型/為替ヘッジなし)

2024年4月30日現在

資産総額	1,607,606,613円
負債総額	2,683,348円
純資産総額( - )	1,604,923,265円
発行済口数	1,309,885,282口
1口当たり純資産額( / )	1.2252円

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース(分配型年6回決算/米ドル売り円買い)

2024年4月30日現在

資産総額	11,702,834円
負債総額	20,766円
純資産総額( - )	11,682,068円
発行済口数	11,812,578口

1口当たり純資産額（ / ）	0.9890円
----------------	---------

## キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算 / 為替ヘッジなし）

2024年4月30日現在

資産総額	150,844,756円
負債総額	237,241円
純資産総額（ - ）	150,607,515円
発行済口数	124,605,366口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2087円

## （参考）キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（米ドル売り円買い）

2024年4月30日現在

資産総額	22,760,654,830円
負債総額	50,000,000円
純資産総額（ - ）	22,710,654,830円
発行済口数	17,357,134,330口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3084円

## （参考）キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（為替ヘッジなし）

2024年4月30日現在

資産総額	17,676,867,158円
負債総額	22,700,000円
純資産総額（ - ）	17,654,167,158円
発行済口数	14,098,481,371口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2522円

## （参考）キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型 / 米ドル売り円買い）

2024年4月30日現在

資産総額	11,693,623円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	11,693,623円
発行済口数	11,354,372口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0299円

## （参考）キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（分配型）

2024年4月30日現在

資産総額	141,045,612円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	141,045,612円
発行済口数	112,146,054口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2577円

## （参考）日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）

2024年1月24日現在

資産総額	116,057,304円
------	--------------

負債総額	85,297円
純資産総額（ - ）	115,972,007円
発行済口数	110,668,573口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0479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（2023年10月31日現在）

（中略）

(2) 会社の機構（2023年10月31日現在）

（以下略）

<訂正後>

(1) 資本金の額（2024年4月30日現在）

（中略）

(2) 会社の機構（2024年4月30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2023年10月31日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	<u>51</u>	<u>1,396,329</u>
合計	<u>51</u>	<u>1,396,329</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2024年4月30日現在、次のとおりです（ただし、親投資信託は除きます。）。

種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	<u>52</u>	<u>1,921,238</u>
合計	<u>52</u>	<u>1,921,238</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2022年7月1日 至2023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。中間財務諸表に記載している金額は、従来、千円未満の端数を切捨てて表示しておりましたが、当中間会計期間より百万円未満の端数を切捨てて表示することに変更いたしました。

### 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、第39期事業年度（自2022年7月1日 至2023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、第40期中間会計期間（自2023年7月1日 至2023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

（2023年12月31日現在）

科目	注記 番号	内訳 (百万円)	金額 (百万円)
(資産の部)			
・流動資産			
1.現金・預金			2,732
2.前払費用			73
3.未収入金			1,448
4.未収委託者報酬			5,291
5.未収運用受託報酬			658

6.立替金			16
7.未収消費税等	*2		48
流動資産計			10,268
.固定資産			
1.有形固定資産			2,470
建物	*1	1,753	
器具備品	*1	716	
2.投資その他の資産			720
(1)投資有価証券		1	
(2)保険積立金		14	
(3)長期差入保証金		411	
(4)繰延税金資産		294	
固定資産計			3,191
資産合計			13,459
(負債の部)			
.流動負債			
1.預り金			23
2.未払金			4,658
(1)未払手数料		3,227	
(2)その他未払金		1,430	
3.未払費用			224
4.未払法人税等			152
5.賞与引当金			496
6.役員賞与引当金			96
流動負債計			5,652
.固定負債			
1.長期末払費用			45
2.退職給付引当金			1,979
3.役員退職慰労引当金			21
4.資産除去債務			411
固定負債計			2,458
負債合計			8,110
(純資産の部)			
.株主資本			
1.資本金			450
2.資本剰余金			582
資本準備金		582	
3.利益剰余金			4,316
その他利益剰余金		4,316	
繰越利益剰余金		4,316	
株主資本計			5,349
純資産合計			5,349
負債・純資産合計			13,459

## ( 2 ) 中間損益計算書

当中間会計期間

(自 2023年 7月 1日 至 2023年 12月31日)

科 目	注記 番号	内訳 (百万円)	金額 (百万円)
.営業収益			



1.委託者報酬			7,819
2.運用受託報酬			779
3.その他営業収益	*2		6,911
営業収益計			15,510
.営業費用			
1.支払手数料	*2		11,858
2.広告宣伝費			41
3.調査費			308
4.営業雑経費			49
(1)通信費		10	
(2)印刷費		29	
(3)協会費		9	
営業費用計			12,257
.一般管理費			
1.給料			1,522
(1)役員報酬		21	
(2)給料・手当		703	
(3)賞与		443	
(4)賞与引当金繰入額		306	
(5)役員賞与引当金繰入額		48	
2.交際費			24
3.旅費交通費			51
4.租税公課			29
5.不動産賃借料			302
6.退職給付費用			122
7.役員退職慰労引当金繰入額			3
8.固定資産減価償却費	*1		87
9.器具備品賃借料			5
10.消耗品費			33
11.事務委託費			65
12.採用費			12
13.福利厚生費			169
14.共通発生経費負担額	*3		226
15.諸経費			6
一般管理費計			2,661
営業利益			592
.営業外収益			
1.受取利息及び配当金			4
2.為替差益			13
営業外収益計			17
.営業外費用			
1.有価証券売却損			0
営業外費用計			0
経常利益			609
VI.特別利益			
1.固定資産売却益			5
特別利益計			5
税引前中間純利益			615
法人税、住民税及び事業税			127
法人税等調整額			100

中間純利益			387
-------	--	--	-----

## ( 3 ) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自2023年7月1日 至2023年12月31日）

(単位：百万円)

	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	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	450	582	582	3,928	3,928	4,961	4,961
当中間期変動額							
中間純利益				387	387	387	387
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	-	-	-	387	387	387	387
当中間期末残高	450	582	582	4,316	4,316	5,349	5,349

[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

#### 市場価格のない株式等以外のもの

時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

### (1)有形固定資産

定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は、建物15年、器具備品3～15年であります。

### (2)無形固定資産

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

## 3. 外貨建資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 4. 引当金の計上基準

### (1)賞与引当金

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

### (2)役員賞与引当金

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

### (3)退職給付引当金

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

### (4)役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づき、当中間会計期間末における要支給額を計上しております。

## 5. 収益及び費用の計上基準

### (1)委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識しています。当該報酬は時の経過と共に履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。当該報酬は毎月、年6回、年2回もしくは年1回受け取ります。

### (2)運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、契約期間の純資産総額に対する一定割合として認識しています。当該報酬は時の経過と共に履行義務が充足されるという前提に基づき、投資顧問契約期間にわたり収益として認識しております。当該報酬は年4回、年2回もしくは年1回受け取ります。

なお、運用受託報酬には成功報酬が含まれる場合があります。成功報酬は、対象となる投資顧問契約の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益が発生した場合、超過運用益に対する一定割合として認識しています。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識し、年1回受け取ります。

### (3)その他営業収益

その他営業収益は、当社がキャピタル・グループ各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）に対する対価であり、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、認識しております。当該収益は時の経過と共に履行義務が充足されるという前提に基づき、月次で収益として認識し、毎月受け取ります。

[表示方法の変更]

（表示単位の変更）

当中間会計期間より、金額の表示単位を千円単位から百万円単位へ変更しております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間 (2023年12月31日現在)	
*1. 有形固定資産の減価償却累計額	140百万円
*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、未収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2023年7月1日 至2023年12月31日)	
*1. 減価償却実施額	
有形固定資産	87百万円
無形固定資産	0百万円
*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。	
当社が各グループ会社に提供をしている各種投資運用サービスは、重要な会計方針の5(3)に記載の通りです。	
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2023年7月1日 至2023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2023年7月1日 至2023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 468 百万円

1年超 312 百万円

---

合計 781 百万円

## [金融商品関係]

当中間会計期間

(2023年12月31日現在)

## 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 (百万円)	時価(百万円)	差額(百万円)
長期差入保証金	411	356	55

(注1)短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似する金融商品は注記を省略しております。

(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る場合、当該価額が異なることもあります。

## 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場における相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

該当事項はありません。

(2)時価をもって中間貸借対照表価額としない金融商品

区分	時価(百万円)		
	レベル1	レベル2	レベル3
長期差入保証金	-	356	-

(注1)時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

主に本社事務所の貸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。

## [有価証券関係]

当中間会計期間  
(2023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 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
その他有価証券 (証券投資信託)	1	1	-

## [デリバティブ取引関係]

当中間会計期間  
(自2023年7月1日 至2023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  
(2023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 768百万円

時の経過による調整額 1百万円

資産除去債務の履行による減少額 359百万円

当中間会計期間末残高 411百万円

[収益認識関係]

当中間会計期間  
(自2023年7月1日 至2023年12月31日)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

委託者報酬 7,819百万円

運用受託報酬 779百万円

その他営業収益 6,911百万円

合計 15,510百万円

2. 収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は「重要な会計方針 5. 収益及び費用の計上基準」に記載しております。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュフローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

[セグメント情報等]

当中間会計期間  
(自2023年7月1日 至2023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
8,582百万円	6,911百万円	16百万円	15,510百万円

(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	6,911百万円

**[1株当たり情報]****当中間会計期間**

(自2023年7月1日 至2023年12月31日)

1株当たり純資産額 94,843.44円

1株当たり中間純利益金額 6,870.91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 387百万円

普通株主に帰属しない金額 -百万円

普通株式に係る中間純利益 387百万円

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(2023年3月31日現在)

(中略)

**(2) 販売会社**



名称：株式会社S B I証券

資本金の額：48,323百万円（2022年12月31日現在）

（中略）

名称：楽天証券株式会社

資本金の額：19,495百万円（2022年12月31日現在）

事業の内容：金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

楽天証券株式会社は、2022年12月23日から当ファンドの募集の取扱い等を開始します。

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額：324,279百万円（2023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（2023年3月31日現在）

（以下略）

<訂正後>

（1）受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額：324,279百万円（2023年9月30日現在）

（中略）

（2）販売会社

名称：株式会社S B I証券

資本金の額：54,323百万円（2023年12月31日現在）

（中略）

名称：楽天証券株式会社

資本金の額：19,495百万円（2023年12月31日現在）

事業の内容：金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額：324,279百万円（2023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（2023年9月30日現在）

（以下略）

# 独立監査人の監査報告書

2024年5月27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  
東京事務所

指定有限責任社  
員 業務執 公認会計士 山田信之  
行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているキャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型/米ドル売り円買い）の2023年9月21日から2024年3月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドAコース（成長型/米ドル売り円買い）の2024年3月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、キャピタル・インターナショナル株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファン드는継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以上

---

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

2024年5月27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  
東京事務所指定有限責任社  
員 業務執 公認会計士 山田信之  
行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているキャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース（成長型／為替ヘッジなし）の2023年9月21日から2024年3月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドBコース（成長型／為替ヘッジなし）の2024年3月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、キャピタル・インターナショナル株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

---

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

2024年5月27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  
東京事務所指定有限責任社  
員 業務執 公認会計士 山田信之  
行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているキャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算/米ドル売り円買い）の2023年9月21日から2024年3月21日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドCコース（分配型年6回決算/米ドル売り円買い）の2024年3月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、キャピタル・インターナショナル株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファン드는継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

---

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

2024年5月27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  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 山田信之

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているキャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算／為替ヘッジなし）の2023年9月21日から2024年3月21日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドDコース（分配型年6回決算／為替ヘッジなし）の2024年3月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、キャピタル・インターナショナル株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任



経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024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  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之  
業務執行社員

## 中間監査意見

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2023年7月1日から2024年6月30日までの第40期事業年度の中間会計期間（2023年7月1日から2023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。

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2023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（2023年7月1日から2023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。

## 中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## 中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、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。

- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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．XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。