

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、キャピタル・グローバル・アロケーション・ファンドF(限定為替ヘッジ)は、2021年11月22日に第6期の決算を行ないました。ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	原則として無期限	
運用方針	キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)(以下「マザーファンド」ということがあります。)受益証券への投資を通じて、内外の投資信託証券(以下「投資対象ファンド」ということがあります。)に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行ないます。	
主要投資対象	キャピタル・グローバル・アロケーション・ファンドF(限定為替ヘッジ)	マザーファンド受益証券
	マザーファンド	以下の投資信託証券に投資を行ない、実質的に世界各国の株式、債券等に投資をします。 ●ルクセンブルク籍円建外国投資信託証券「キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)」 ●追加型証券投資信託「日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)」
主な投資制限	キャピタル・グローバル・アロケーション・ファンドF(限定為替ヘッジ)	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。投資信託証券への実質投資割合(マザーファンド受益証券への投資を介した投資の割合をいいます。)には、制限を設けません。株式への直接投資は、行ないません。外貨建資産への直接投資は、行ないません。デリバティブの直接利用は、行ないません。
	マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。株式への直接投資は行ないません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブ取引は原則行ないません。
分配方針	毎年11月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行ない、分配金額は分配対象額の範囲で、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、委託会社の判断により収益分配を行わないことがあります。留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。	

キャピタル・グローバル・アロケーション・ファンドF(限定為替ヘッジ)

追加型投信／内外／資産複合 課税取扱／株式投資信託

運用報告書(全体版) 第6期

決算日2021年11月22日

キャピタル・インターナショナル株式会社
東京都千代田区丸の内二丁目1番1号 明治安田生命ビル

当運用報告書に関するお問い合わせ先

フリーコール 0120-411-447
営業部(営業日9:00~17:00)

お客様の口座内容などに関するお問い合わせは、お申込みされた販売会社までお願い申し上げます。

ホームページ capitalgroup.co.jp

最近5期の運用実績	1
当期中の基準価額等の推移	1
ファンドの運用経過等	2
1万口当たり費用明細	4
(参考情報)総経費率	5
親投資信託受益証券の設定、解約状況	6
利害関係人との取引状況等	6
組入資産の明細(親投資信託残高)	6
投資信託財産の構成	7
資産、負債、元本及び基準価額の状況	7
損益の状況	7
分配金のお知らせ	8
お知らせ	8

マザーファンド情報

キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)	9
--------------------------------------	---

補足情報

キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)	14
日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)／日本短期債券マザーファンド	35

参考情報	39
------	----

●最近5期の運用実績

決算期	基準価額			投資信託 受益証券 組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率		
	円	円	%	%	百万円
2期(2017年11月20日)	11,541	0	13.4	99.7	4,746
3期(2018年11月20日)	11,290	0	△ 2.2	99.9	9,032
4期(2019年11月20日)	12,506	0	10.8	99.9	8,330
5期(2020年11月20日)	13,391	0	7.1	99.6	11,044
6期(2021年11月22日)	15,405	0	15.0	99.4	36,427

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。騰落率は期首比です。

(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「投資信託受益証券組入比率」は親投資信託への投資割合に応じて算出した実質比率を記載しています。

(注4) 金額の単位未満は切捨てています。

(注5) 当ファンドは、マザーファンドを通じて、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数を表示できません。

●当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額		投資信託 受益証券 組入比率
	円	騰落率	
(期首)	円	%	%
2020年11月20日	13,391	—	99.6
11月末	13,532	1.1	99.9
12月末	13,732	2.5	97.5
2021年1月末	13,916	3.9	99.6
2月末	13,950	4.2	99.5
3月末	14,215	6.2	99.4
4月末	14,561	8.7	99.7
5月末	14,700	9.8	99.4
6月末	14,866	11.0	98.1
7月末	15,010	12.1	98.5
8月末	15,168	13.3	98.8
9月末	14,886	11.2	97.0
10月末	15,232	13.7	99.1
(期末)			
2021年11月22日	15,405	15.0	99.4

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

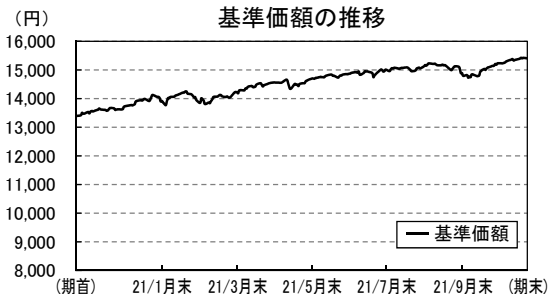
(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「投資信託受益証券組入比率」は親投資信託への投資割合に応じて算出した実質比率を記載しています。

(注4) 当ファンドは、マザーファンドを通じて、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数を表示できません。

●ファンドの運用経過等 (2020年11月21日～2021年11月22日)

◎当期中の基準価額の変動に関する主な要因について

基準価額は期首の13,391円から期末には15,405円と2,014円の上昇となりました。



(注)当ファンドは、ベンチマークを設定しておりません。

基準価額の主な変動要因は、当ファンドのマザーファンドであるキャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)の基準価額の変動によるものですが、実質的には、同マザーファンドを通じて投資するキャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)の主な投資対象である世界各国の株式、債券等の価格変動の影響となります。なお、当期中における世界各国の株式、債券等の価格は、次の投資環境の影響等を受けて変動しました。

当期中の投資環境

<世界株式>

当期の世界株式市場は、現地通貨ベース、円ベースとも上昇しました。

主な市場変動要因

(プラス要因)

- ・ 先進国における新型コロナウイルスワクチンの接種進展
- ・ 米国の追加経済対策への期待
- ・ 企業業績の回復

(マイナス要因)

- ・ 新型コロナウイルス変異株の感染拡大をめぐる懸念
- ・ 米国のインフレ懸念
- ・ 米国の金融政策正常化に対する警戒感

<投資適格債>

当期の投資適格債市場では、米国債、英国債、ドイツ国債の利回りは、いずれも上昇しました。

主な市場変動要因

(利回りの低下要因)

- ・ 米欧中央銀行による金融緩和の継続
- ・ 新型コロナウイルス変異株の感染拡大をめぐる懸念
- ・ 軟調な米国の経済指標

(利回りの上昇要因)

- ・ 米国の新政権発足に伴う財政拡大観測の高まり
- ・ 米国のインフレ懸念
- ・ 米国の金融政策正常化に対する警戒感

◎当期中の基準価額とベンチマークの推移とを比較したときの、差異の状況および要因について

当ファンドは、マザーファンドを通じて、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数を表示できません。

◎運用経過

<キャピタル・グローバル・アロケーション・ファンドF(限定為替ヘッジ)>

- ・ キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)を通じてキャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)を高位に組み入れ、実質的に世界各国の株式、債券等へ投資を行ない、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行ないました。
- ・ 当期末における当ファンドの純資産総額に対するマザーファンドの割合は99.5%となりました。

以下は、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドの説明です。

<キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)>

- ・ キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)を高位に組み入れ、実質的に世界各国の株式、債券等へ投資を行ない、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行ないました。
- ・ 運用の基本方針に従い、期中を通じてキャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)を高位に組み入れました。
- ・ 当期末におけるマザーファンドの純資産総額に対するキャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)の割合は99.8%、日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)の割合は0.0%となりました。

以下は、マザーファンドが投資する投資対象ファンドの説明です。

<キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)>

・世界各国の株式、債券等に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行ないました。運用にあたっては、徹底したファンダメンタルズ調査に基づき、世界各国の株式および債券の中から厳選した銘柄に投資し、ときには機動的に配分を変更しながら、銘柄の入れ替えを行ないました。なお、実質的な主要通貨建資産に主要通貨売り円買いの為替取引を行ない、対円での為替変動リスクの低減を図りました。

キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)の資産状況につきましては、巻末の参考情報をご覧ください。

<日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)>

・日本短期債券マザーファンドを通じて、わが国の公社債・金融商品を組み入れ、信託財産の安定的な成長を目指して運用を行ないました。

◎今後の運用方針

<キャピタル・グローバル・アロケーション・ファンドF(限定為替ヘッジ)>

キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)の組入比率を高位に維持することにより、同マザーファンドを通じて実質的に世界各国の株式、債券等へ投資することを継続する方針です。

以下は、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドの説明です。

<キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)>

キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)の組入比率を高位に維持することにより、同ファンドを通じて実質的に世界各国の株式、債券等へ投資することを継続するとともに、余裕資金の効率的な運用のため、日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)についても組み入れを維持する方針です。

以下は、マザーファンドが投資する投資対象ファンドの説明です。

<キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)>

今後も、ファンダメンタルズ調査に基づいて、世界各国の株式、債券の中から銘柄を厳選し、投資環境に応じて機動的に配分を変更していく方針です。引き続き世界各国の経済および市場動向を注視しながら、長期的な視点に立った運用を継続し、運用実績の向上を目指します。なお、実質的な主要通貨建資産に主要通貨売り円買いの為替取引を行ない、対円での為替変動リスクの低減を図ります。

<日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)>

日本短期債券マザーファンドの組入比率を高位に維持することにより、同マザーファンドを通じてわが国の公社債・金融商品に投資し、信託財産の安定的な成長を目指して安定運用を行ないます。また、NOMURA-BPI短期インデックスをベンチマークとし、これを上回る投資成果を目指します。

◎分配金について

投資信託財産の成長を追求する観点から、分配金は見送りとさせていただきます。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

分配原資の内訳

(単位：円・%、1万口当たり・税引前)

項目	第6期
	2020年11月21日 ～ 2021年11月22日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	(—%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	5,404

(注1) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

(注2) 対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、当ファンドの収益率とは異なります。

●1万口当たり費用明細

項目	第6期		項目の概要
	(2020年11月21日～2021年11月22日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	101円	0.697%	(a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率 期中の平均基準価額は14,480円です。
(投信会社)	(96)	(0.664)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(2)	(0.011)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用	1	0.010	(b) その他費用＝[期中のその他費用]÷[期中の平均受益権口数]
(法定開示にかかる費用)	(1)	(0.010)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用、法定書類の作成・印刷等費用
合計	102	0.707	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

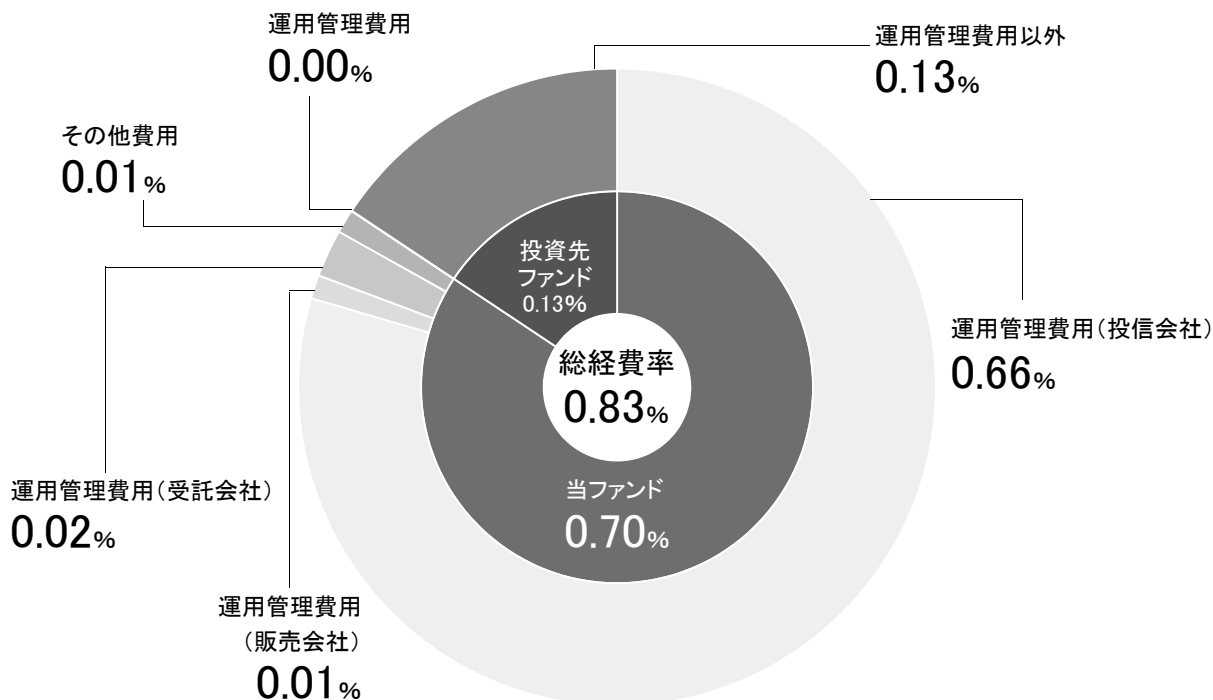
(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません(マザーファンドを除く)。

(参考情報)

・総経費率



総経費率(①+②+③)	0.83%
①当ファンドの費用の比率	0.70%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.00%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.13%

(注1) ①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 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。

(注5) ①の費用は、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。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なります。

(注7) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの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異なります。

(注8) 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ーフィー等のファンド管理費用が含まれています。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)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)は0.83%です。**

●親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2020年11月21日から2021年11月22日まで)

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド (限定為替ヘッジ)	千口 15,062,236	千円 23,762,000	千口 740,755	千円 1,142,000

(注) 単位未満は切捨てています。

●利害関係人との取引状況等 (2020年11月21日から2021年11月22日まで)

(1) 当期中の利害関係人との取引状況

<キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)>

区分	当期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 23,706	百万円 —	% —	百万円 1,139	百万円 —	% —

平均保有割合 100.0%

平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該子ファンドの親投資信託所有口数の割合をいいます。

(注) 金額の単位未満は切捨てています。

(2) 当期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当期
売買委託手数料総額(A)	—千円
うち利害関係人への支払額(B)	—千円
(B) / (A)	—%

(注1) 投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人との取引はありません。

(注2) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

●組入資産の明細

親投資信託残高

(2021年11月22日現在)

項目	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド (限定為替ヘッジ)	千口 7,784,447	千口 22,105,928	千円 36,251,512

(注) 単位未満は切捨てています。

●投資信託財産の構成

(2021年11月22日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド (限定為替ヘッジ)	36,251,512	99.2
コール・ローン等、その他	278,737	0.8
投資信託財産総額	36,530,249	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てています。

●資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月22日現在)

項目	当期末
(A) 資産	36,530,249,633円
コール・ローン等	278,737,598
キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)(評価額)	36,251,512,035
(B) 負債	102,529,293
未払解約金	13,037,540
未払信託報酬	88,582,104
未払利息	763
その他未払費用	908,886
(C) 純資産総額(A-B)	36,427,720,340
元本	23,647,097,831
次期繰越損益金	12,780,622,509
(D) 受益権総口数	23,647,097,831口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,405円

(注1) 当ファンドの期首元本額は8,247,933,135円、期中追加設定元本額は17,330,058,561円、期中一部解約元本額は1,930,893,865円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.5405円です。

●損益の状況

(自2020年11月21日 至2021年11月22日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 184,870円
支払利息	△ 184,870
(B) 有価証券売買損益	2,477,500,941
売買益	2,633,665,803
売買損	△ 156,164,862
(C) 信託報酬等	△ 138,512,563
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,338,803,508
(E) 前期繰越損益金	964,946,248
(F) 追加信託差損益金 (配当等相当額)	9,476,872,753 (4,306,559,605)
(売買損益相当額)	(5,170,313,148)
(G) 計(D+E+F)	12,780,622,509
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	12,780,622,509
追加信託差損益金 (配当等相当額)	9,476,872,753 (4,306,535,039)
(売買損益相当額)	(5,170,337,714)
分配準備積立金	3,304,104,749
繰越損益金	△ 354,993

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等売買損益額(2,339,096,161円)、信託約款に規定する収益調整金(9,476,517,760円)および分配準備積立金(965,008,588円)より分配対象収益は12,780,622,509円(10,000口当たり5,404円)ですが、当期に分配した金額はありません。

●分配金のお知らせ

決算期	年月日	1万口当たりの分配金(税引前)
第2期	2017年11月20日	0円
第3期	2018年11月20日	0円
第4期	2019年11月20日	0円
第5期	2020年11月20日	0円
第6期	2021年11月22日	0円

●お知らせ

信託報酬の引き下げについて

ご投資家の利益に資するために信託報酬を引き下げましたので、投資信託約款に所要の変更を行ないました(2021年7月1日付け)。

変更点

●信託報酬

信託報酬における委託会社の配分を0.65%から0.60%に引き下げました。

	変更前	変更後
信託報酬	年率0.748%(税抜0.68%)	年率0.693%(税抜0.63%)
委託会社(税抜)	年率0.65%	年率0.60%
販売会社(税抜)	年率0.01%	年率0.01%
受託会社(税抜)	年率0.02%	年率0.02%
実質的な信託報酬	年率0.755%程度(税込)	年率0.70%程度(税込)

※税込年率は、消費税率10%で表示しています。

キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)

キャピタル・グローバル・アロケーション・マザーファンド(限定為替ヘッジ)

第6期

決算日 2021年11月22日

(計算期間: 2020年11月21日から2021年11月22日まで)

●当ファンドの仕組みは次のとおりです。

運用方針	主として世界各国の株式、債券等へ投資する投資信託証券とわが国の公社債および短期金融商品に投資をする投資信託証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	以下の投資信託証券に投資を行ない、実質的に世界各国の株式、債券等に投資をします。 <ul style="list-style-type: none">・ルクセンブルク籍外国投資信託証券「キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)」・証券投資信託「日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)」
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。株式への直接投資は行ないません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブ取引は原則行ないません。

●最近5期の運用実績

決算期	基準価額		投資信託証券 組入比率	純資産 総額
		期中 騰落率		
	円	%	%	百万円
2期(2017年11月20日)	11,933	14.6	100.0	4,732
3期(2018年11月20日)	11,742	△ 1.6	100.0	9,020
4期(2019年11月20日)	13,105	11.6	100.0	8,321
5期(2020年11月20日)	14,133	7.8	100.0	11,001
6期(2021年11月22日)	16,399	16.0	99.8	36,250

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注3) 金額の単位未満は切捨てています。

(注4) マザーファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数を表示できません。

●当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額		投資信託証券 組入比率
		騰落率	
(期首)	円	%	%
2020年11月20日	14,133	—	100.0
11月末	14,286	1.1	100.0
12月末	14,508	2.7	100.0
2021年1月末	14,713	4.1	100.0
2月末	14,758	4.4	100.0
3月末	15,053	6.5	99.9
4月末	15,433	9.2	99.9
5月末	15,592	10.3	99.9
6月末	15,779	11.6	99.9
7月末	15,945	12.8	99.9
8月末	16,127	14.1	99.9
9月末	15,832	12.0	99.9
10月末	16,206	14.7	99.9
(期末)			
2021年11月22日	16,399	16.0	99.8

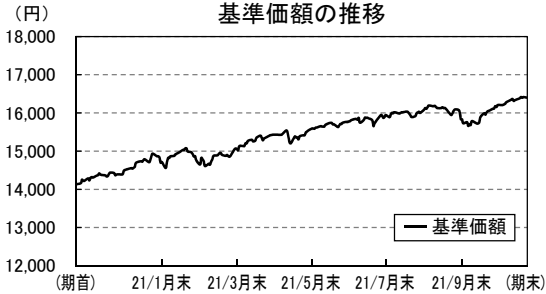
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注3) マザーファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数を表示できません。

●ファンドの運用経過等 (2020年11月21日～2021年11月22日)

基準価額は期首の14,133円から期末には16,399円と2,266円の上昇となりました。



(注) マザーファンドは、ベンチマークを設定していません。

当期中の基準価額の変動に関する主な要因、当期中の基準価額とベンチマークの推移とを比較したときの、差異の状況および要因、運用経過および今後の運用方針等については、2～3ページをご参照ください。

●1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

該当事項はありません。

●期中の売買及び取引状況 (2020年11月21日から2021年11月22日まで)

		買付		売付	
		単位数又は口数	金額	単位数又は口数	金額
外国	キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)	口 8,536,322.527	千円 23,706,000	口 419,568.021	千円 1,139,000

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 単位未満は切捨てています。

●組入資産の明細 (2021年11月22日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

	銘柄名	期首(前期末)	当期末(2021年11月22日)		
		口数	口数	評価額	組入比率
		口	口	千円	%
国内投資信託受益証券	日本短期債券ファンド (適格機関投資家限定)	4,579,770	4,579,770	4,825	0.0
外国投資証券	キャピタル・グループ・ グローバル・アロケーション・ ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)	4,419,179.711	12,535,934.217	36,191,242	99.8
	合計	8,998,949.711	17,115,704.217	36,196,067	
	銘柄数<比率>	2	2	<99.8%>	

(注1) 比率は、純資産総額に対する投資信託証券の比率です。

(注2) 金額の単位未満は切捨てています。

●投資信託財産の構成

(2021年11月22日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	4,825	0.0
投資証券	36,191,242	98.5
コール・ローン等、その他	554,814	1.5
投資信託財産総額	36,750,881	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てています。

●資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月22日現在)

項目	当期末
(A) 資産	36,750,881,129円
コール・ローン等	554,813,342
投資信託受益証券(評価額)	4,825,703
投資証券(評価額)	36,191,242,084
(B) 負債	500,001,520
未払金	500,000,000
未払利息	1,520
(C) 純資産総額(A-B)	36,250,879,609
元本	22,105,928,432
次期繰越損益金	14,144,951,177
(D) 受益権総口数	22,105,928,432口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,399円

(注1) 当マザーファンドの当初設定元本額は7,784,447,971円、期中追加設定元本額は15,062,236,441円、期中一部解約元本額は740,755,980円です。当マザーファンドの期末元本額は、22,105,928,432円です。

(注2) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、キャピタル・グローバル・アロケーション・ファンドF(限定為替ヘッジ) 22,105,928,432円です。

(注3) 1口当たり純資産額は1.6399円です。

●損益の状況

(自2020年11月21日 至2021年11月22日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 188,178円
支払利息	△ 188,178
(B) 有価証券売買損益	2,629,325,712
売買益	2,629,351,739
売買損	△ 26,027
(C) 当期損益金(A+B)	2,629,137,534
(D) 前期繰越損益金	3,217,294,104
(E) 追加信託差損益金	8,699,763,559
(F) 解約差損益金	△ 401,244,020
(G) 計(C+D+E+F)	14,144,951,177
次期繰越損益金(G)	14,144,951,177

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

●お知らせ

該当事項はありません。

<補足情報>

キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY)

●当ファンドの仕組みは次のとおりです。

形態	外国投資信託証券／ルクセンブルク籍／会社型
投資対象	世界各国の株式および債券等を主要投資対象とします。
投資態度	主として世界各国の証券取引所(これに準ずるものを含みます。)に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている株式および債券等に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長を目指します。 原則として実質的な主要通貨建資産に主要通貨売り円買いの為替取引を行ない、対円での為替変動リスクの低減を図ります。 市況動向、資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	●株式の組入比率は、原則として純資産総額の45%以上とします。 ●投資適格格付け*債券の組入比率は、原則として純資産総額の25%以上とします。 *複数の格付けが付与されている場合は、高い方の格付けを基準とします。 ●純資産総額の範囲内において有価証券への投資に制限を設けません。 ●同一発行体の発行する証券への投資は、原則として取得時においてファンドの純資産総額の10%を上限とします。
決算日	毎年12月31日
投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー

キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)

損益および純資産変動計算書

2020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）	5,318,293
受取配当金(源泉徴収税額控除後)	9,796,679
その他収益	1,141
銀行預金利息	113,430
スワップ取引	26,272
収益小計	15,255,815
費用	
運用報酬	8,349,778
管理手数料	479,282
年次税	329,061
専門家サービス	315,459
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	173,163
印刷費用	64,379
その他費用	47,097
スワップ取引	20,536
当座貸越利息 *	—
費用小計	9,778,755
費用の払戻し	197,924
投資純利益／(損失) (a)	5,674,984
実現純利益／(損失)	
投資有価証券の売却取引	3,936,377
金融先物取引	612,569
為替取引	24,800,862
スワップ取引	—459,772
当期実現純利益／(損失) (b)	28,890,036
未実現評価利益／(損失)の増減	
投資有価証券	93,905,428
金融先物取引	21,539
スワップ取引	220,402
為替取引	—218,786
当期未実現評価利益／(損失)の増減 (c)	93,928,583
当期損益 (a+b+c)	128,493,603
配当金の分配	—358,846
当期投資証券の差引増減額	325,268,896
期首純資産総額	708,146,361
期末純資産総額	1,161,550,014

*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。

投資明細表

Capital Group Global Allocation Fund (LUX)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing				
Bonds				
<i>Australia</i>				
Australia Government Bond, Reg. S 2.75% 21/11/2028	AUD	2,110,000	1,877,475	0.16
Australia Government Bond, Reg. S 1% 21/11/2031	AUD	1,230,000	943,696	0.08
Australia Government Bond, Reg. S 1.75% 21/06/2051	AUD	850,000	624,294	0.06
			3,445,465	0.30
<i>Belgium</i>				
KBC Group NV, Reg. S 0.125% 10/09/2026	EUR	500,000	612,729	0.05
			612,729	0.05
<i>Bermuda</i>				
Bermuda Government Bond, 144A 2.375% 20/08/2030	USD	200,000	210,250	0.02
			210,250	0.02
<i>Brazil</i>				
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/01/2022	BRL	180,000	337,101	0.03
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 01/07/2022	BRL	1,920,000	349,939	0.03
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2025	BRL	2,830,000	630,334	0.05
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10% 01/01/2027	BRL	2,600,000	592,288	0.05
Vale Overseas Ltd. 3.75% 08/07/2030	USD	276,000	307,329	0.03
			2,216,991	0.19
<i>Canada</i>				
Canada Government Bond 2.25% 01/06/2025	CAD	2,930,000	2,491,156	0.22
Canada Government Bond 1% 01/06/2027	CAD	1,870,000	1,518,727	0.13
Canada Government Bond 2.25% 01/06/2029	CAD	3,020,000	2,697,667	0.23
Canadian Natural Resources Ltd. 2.95% 15/07/2030	USD	434,000	464,741	0.04
Canadian Natural Resources Ltd. 4.95% 01/06/2047	USD	37,000	46,994	–
Cenovus Energy, Inc. 4.25% 15/04/2027	USD	70,000	76,476	0.01
Province of Quebec Canada 2.375% 31/01/2022	USD	46,000	47,052	–
TransCanada PipeLines Ltd. 4.1% 15/04/2030	USD	177,000	209,256	0.02
			7,552,069	0.65
<i>Chile</i>				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4.5% 01/03/2026	CLP	635,000,000	1,025,240	0.09
			1,025,240	0.09
<i>China</i>				
Agricultural Development Bank of China 3.75% 25/01/2029	CNY	1,330,000	204,972	0.02
Agricultural Development Bank of China 2.96% 17/04/2030	CNY	11,300,000	1,636,537	0.14
Baidu, Inc. 4.375% 14/05/2024	USD	300,000	330,438	0.03
China Construction Bank Corp., Reg. S 1% 04/08/2023	USD	700,000	701,816	0.06
China Development Bank 3.43% 14/01/2027	CNY	15,100,000	2,309,890	0.20
China Development Bank 4.24% 24/08/2027	CNY	10,900,000	1,746,980	0.15

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
China Development Bank 4.04% 06/07/2028	CNY	6,000,000	946,833	0.08
China Development Bank 3.48% 08/01/2029	CNY	27,200,000	4,124,029	0.36
China Government Bond 3.39% 16/03/2050	CNY	1,010,000	144,228	0.01
China Government Bond 3.12% 05/12/2026	CNY	17,600,000	2,691,548	0.23
China Government Bond 3.29% 23/05/2029	CNY	21,050,000	3,235,311	0.28
China Government Bond 3.86% 22/07/2049	CNY	13,000,000	2,018,923	0.17
China Government Bond, Reg. S 0.125% 12/11/2026	EUR	200,000	246,405	0.02
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd., 144A 3.5% 04/05/2027	USD	350,000	389,511	0.03
Tencent Holdings Ltd., Reg. S 1.81% 26/01/2026	USD	200,000	204,704	0.02
			20,932,125	1.80
<i>Colombia</i>				
Colombian TES 7.25% 26/10/2050	COP	1,889,000,000	596,152	0.05
Colombian TES 5.75% 03/11/2027	COP	4,971,000,000	1,542,855	0.13
			2,139,007	0.18
<i>Denmark</i>				
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab, Reg. S, 144A 0.5% 01/10/2040	DKK	4,170,524	688,037	0.06
Nykredit Realkredit A/S 1.5% 01/10/2037	DKK	1,759,181	301,166	0.03
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 0.5% 01/10/2040	DKK	31,604,752	5,218,695	0.45
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 1.5% 01/10/2040	DKK	2,158,422	367,921	0.03
Nykredit Realkredit A/S, Reg. S 0.5% 01/10/2050	DKK	3,017,257	488,935	0.04
			7,064,754	0.61
<i>France</i>				
BPCE SA, Reg. S 0.875% 31/01/2024	EUR	200,000	251,355	0.02
BPCE SA, Reg. S 0.25% 15/01/2026	EUR	300,000	372,088	0.03
Credit Agricole SA, Reg. S 0.875% 14/01/2032	EUR	300,000	385,038	0.03
France Government Bond OAT, Reg. S 0.75% 25/11/2028	EUR	210,000	282,295	0.03
France Government Bond OAT, Reg. S, 144A 2% 25/05/2048	EUR	365,000	650,116	0.06
Pernod Ricard SA, Reg. S 1.125% 07/04/2025	EUR	100,000	128,526	0.01
Peugeot SA, Reg. S 2.75% 15/05/2026	EUR	200,000	273,278	0.02
			2,342,696	0.20
<i>Germany</i>				
Allianz SE, Reg. S, FRN 4.75% Perpetual	EUR	100,000	136,855	0.01
Bayer AG, Reg. S 0.75% 06/01/2027	EUR	300,000	378,049	0.03
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0% 10/10/2025	EUR	2,170,000	2,746,192	0.24
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0% 15/08/2030	EUR	1,700,000	2,194,608	0.19
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.5% 15/08/2027	EUR	1,400,000	1,851,482	0.16
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0.25% 15/02/2029	EUR	4,490,000	5,900,625	0.51
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0% 15/02/2030	EUR	1,020,000	1,316,499	0.11
Bundesrepublik Deutschland, Reg. S 0% 15/08/2050	EUR	1,500,000	1,923,843	0.17
Daimler International Finance BV, Reg. S 0.875% 09/04/2024	EUR	275,000	345,244	0.03
Hannover Rueck SE, Reg. S, FRN 1.75% 08/10/2040	EUR	200,000	262,414	0.02

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Volkswagen Financial Services NV, Reg. S 1.625% 10/02/2024	GBP	100,000	140,413	0.01
			17,196,224	1.48
<i>Greece</i>				
Greece Government Bond, Reg. S, 144A 3.375% 15/02/2025	EUR	720,000	998,481	0.09
Greece Government Bond, Reg. S 3.75% 30/01/2028	EUR	1,575,000	2,369,449	0.20
			3,367,930	0.29
<i>India</i>				
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Reg. S 7.125% 10/10/2022	INR	20,000,000	279,847	0.02
National Highways Authority of India, Reg. S 7.3% 18/05/2022	INR	30,000,000	423,457	0.04
			703,304	0.06
<i>Indonesia</i>				
Indonesia Government Bond, 144A 3.85% 18/07/2027	USD	625,000	715,287	0.06
Indonesia Government Bond 3.85% 15/10/2030	USD	425,000	494,949	0.04
Indonesia Government Bond, Reg. S 3.85% 18/07/2027	USD	250,000	286,115	0.03
Indonesia Treasury 8.25% 15/05/2029	IDR	3,386,000,000	278,133	0.02
Indonesia Treasury 7% 15/09/2030	IDR	10,223,000,000	789,099	0.07
Indonesia Treasury 6.5% 15/02/2031	IDR	4,520,000,000	336,945	0.03
Indonesia Treasury 7.5% 15/08/2032	IDR	1,691,000,000	131,286	0.01
Indonesia Treasury 6.625% 15/05/2033	IDR	4,226,000,000	309,475	0.03
			3,341,289	0.29
<i>Israel</i>				
Israel Government Bond 2% 31/03/2027	ILS	2,275,000	777,326	0.07
Israel Government Bond 2.5% 15/01/2030	USD	210,000	227,757	0.02
Israel Government Bond 2.75% 03/07/2030	USD	270,000	298,186	0.03
Israel Government Bond 5.5% 31/01/2042	ILS	1,295,000	690,316	0.06
Israel Government Bond 3.75% 31/03/2047	ILS	1,480,000	643,659	0.05
Israel Government Bond, Reg. S 2.875% 29/01/2024	EUR	520,000	694,872	0.06
Israel Government Bond, Reg. S 1.5% 16/01/2029	EUR	110,000	148,958	0.01
			3,481,074	0.30
<i>Italy</i>				
Intesa Sanpaolo SpA, Reg. S 1.36% 25/03/2022	JPY	100,000,000	975,120	0.08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S, 144A 0.95% 15/09/2027	EUR	2,780,000	3,566,081	0.31
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Reg. S 0.1% 15/05/2023	EUR	1,826,000	2,345,304	0.20
			6,886,505	0.59
<i>Japan</i>				
American Honda Finance Corp. 1.2% 08/07/2025	USD	316,000	323,524	0.03
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/03/2024	JPY	391,000,000	3,815,488	0.33
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/06/2024	JPY	247,300,000	2,414,235	0.21
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/12/2024	JPY	93,800,000	916,551	0.08
Japan Government Five Year Bond 0.1% 20/09/2025	JPY	276,550,000	2,704,694	0.23
Japan Government Forty Year Bond 0.5% 20/03/2059	JPY	16,000,000	145,861	0.01

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/03/2027	JPY	269,350,000	2,641,128	0.23
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/09/2029	JPY	738,300,000	7,233,691	0.62
Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/09/2030	JPY	1,041,850,000	10,168,130	0.88
Japan Government Thirty Year Bond 0.5% 20/03/2049	JPY	86,550,000	815,110	0.07
Japan Government Thirty Year Bond 2% 20/03/2042	JPY	10,000,000	127,498	0.01
Japan Government Thirty Year Bond 1.7% 20/03/2044	JPY	32,400,000	398,171	0.03
Japan Government Twenty Year Bond 1.2% 20/03/2035	JPY	130,000,000	1,434,048	0.12
Japan Government Twenty Year Bond 2.2% 20/03/2030	JPY	5,000,000	58,281	0.01
Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/06/2037	JPY	95,700,000	972,704	0.08
Japan Government Twenty Year Bond 0.4% 20/06/2040	JPY	125,000,000	1,212,576	0.11
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd., Reg. S 2.25% 21/11/2026	EUR	250,000	343,752	0.03
Toyota Motor Credit Corp. 1.8% 13/02/2025	USD	290,000	304,214	0.03
Toyota Motor Credit Corp. 3.05% 11/01/2028	USD	147,000	165,268	0.01
Toyota Motor Credit Corp. 3.375% 01/04/2030	USD	123,000	143,999	0.01
			36,338,923	3.13
<i>Mexico</i>				
Mexican Bonos 7.5% 03/06/2027	MXN	64,000,000	3,662,693	0.32
Mexican Bonos 8.5% 31/05/2029	MXN	34,500,000	2,114,955	0.18
Mexican Bonos 8% 07/11/2047	MXN	14,000,000	830,995	0.07
Mexico City Airport Trust, Reg. S 5.5% 31/07/2047	USD	400,000	422,300	0.04
Mexico Government Bond 2.659% 24/05/2031	USD	276,000	283,190	0.02
Mexico Government Bond 3.9% 27/04/2025	USD	240,000	269,669	0.02
Petroleos Mexicanos 7.47% 12/11/2026	MXN	5,440,000	228,360	0.02
Petroleos Mexicanos, Reg. S 7.19% 12/09/2024	MXN	6,900,000	314,340	0.03
			8,126,502	0.70
<i>Morocco</i>				
Morocco Government Bond, 144A 1.375% 30/03/2026	EUR	360,000	443,286	0.04
Morocco Government Bond, 144A 1.5% 27/11/2031	EUR	210,000	250,717	0.02
Morocco Government Bond, Reg. S 4.25% 11/12/2022	USD	400,000	421,063	0.04
Morocco Government Bond, Reg. S 3.5% 19/06/2024	EUR	120,000	160,047	0.01
Morocco Government Bond, Reg. S 1.5% 27/11/2031	EUR	240,000	286,533	0.02
			1,561,646	0.13
<i>Netherlands</i>				
BAT Netherlands Finance BV, Reg. S 3.125% 07/04/2028	EUR	300,000	428,219	0.04
Conti-Gummi Finance BV, Reg. S 1.125% 25/09/2024	EUR	80,000	101,228	0.01
Cooperatieve Rabobank UA, Reg. S 1.25% 14/01/2025	GBP	300,000	424,123	0.04
Cooperatieve Rabobank UA, Reg. S 3.875% 25/07/2023	EUR	100,000	134,412	0.01
Enel Finance International NV, Reg. S 1% 16/09/2024	EUR	150,000	191,024	0.02

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Netherlands Government Bond 5.5% 15/01/2028	EUR	80,000	140,789	0.01
Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 2.25% 15/07/2022	EUR	50,000	63,883	–
Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 2% 15/07/2024	EUR	40,000	53,643	–
Netherlands Government Bond, Reg. S, 144A 0% 15/01/2027	EUR	2,300,000	2,920,504	0.25
			<u>4,457,825</u>	<u>0.38</u>
<i>Norway</i>				
Equinor ASA 3.7% 01/03/2024	USD	60,000	65,990	0.01
Equinor ASA 1.75% 22/01/2026	USD	84,000	88,262	0.01
Equinor ASA 2.375% 22/05/2030	USD	134,000	143,525	0.01
Norway Government Bond, Reg. S, 144A 1.75% 13/03/2025	NOK	10,680,000	1,306,624	0.11
			<u>1,604,401</u>	<u>0.14</u>
<i>Panama</i>				
Panama Government Bond 3.16% 23/01/2030	USD	700,000	776,563	0.06
Panama Government Bond 4.5% 01/04/2056	USD	335,000	432,987	0.04
			<u>1,209,550</u>	<u>0.10</u>
<i>Paraguay</i>				
Paraguay Government Bond, Reg. S 4.625% 25/01/2023	USD	200,000	215,500	0.02
Paraguay Government Bond, Reg. S 4.95% 28/04/2031	USD	800,000	971,000	0.08
			<u>1,186,500</u>	<u>0.10</u>
<i>Peru</i>				
Peru Government Bond 2.392% 23/01/2026	USD	220,000	235,072	0.02
Peru Government Bond 6.15% 12/08/2032	PEN	1,960,000	659,049	0.06
			<u>894,121</u>	<u>0.08</u>
<i>Philippines</i>				
Philippine Government Bond 1.648% 10/06/2031	USD	431,000	437,466	0.04
			<u>437,466</u>	<u>0.04</u>
<i>Portugal</i>				
Portugal Government Bond, Reg. S 5.125% 15/10/2024	USD	125,000	145,483	0.01
			<u>145,483</u>	<u>0.01</u>
<i>Qatar</i>				
Qatar Government Bond, 144A 4.5% 23/04/2028	USD	655,000	794,761	0.07
Qatar Government Bond, Reg. S 3.75% 16/04/2030	USD	200,000	235,765	0.02
Qatar Government Bond, Reg. S 4.4% 16/04/2050	USD	200,000	261,180	0.02
			<u>1,291,706</u>	<u>0.11</u>
<i>Romania</i>				
Romania Government Bond, 144A 2% 28/01/2032	EUR	170,000	218,392	0.02
Romania Government Bond, 144A 3.5% 03/04/2034	EUR	80,000	116,604	0.01
Romania Government Bond, 144A 3.375% 08/02/2038	EUR	175,000	246,620	0.02
Romania Government Bond, 144A 4.625% 03/04/2049	EUR	308,000	509,473	0.04

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Romania Government Bond, Reg. S 3.624% 26/05/2030	EUR	1,920,000	2,804,326	0.24
Romania Government Bond, Reg. S 2% 28/01/2032	EUR	1,150,000	1,477,355	0.13
Romania Government Bond, Reg. S 3.875% 29/10/2035	EUR	175,000	262,374	0.02
Romania Government Bond, Reg. S 4.125% 11/03/2039	EUR	125,000	191,628	0.02
Romania Government Bond, Reg. S 4.625% 03/04/2049	EUR	530,000	876,690	0.08
			6,703,462	0.58
<i>Russian Federation</i>				
Russian Federal Bond - OFZ 7% 16/08/2023	RUB	29,100,000	415,000	0.03
Russian Federal Bond - OFZ 6.9% 23/05/2029	RUB	117,390,000	1,706,964	0.15
Russian Federal Bond - OFZ 7.65% 10/04/2030	RUB	17,300,000	264,262	0.02
Russian Federal Bond - OFZ 8.5% 17/09/2031	RUB	5,390,000	87,541	0.01
Russian Federal Bond - OFZ 7.7% 23/03/2033	RUB	38,190,000	582,072	0.05
Russian Federal Bond - OFZ 7.25% 10/05/2034	RUB	7,920,000	116,584	0.01
Russian Foreign Bond - Eurobond, Reg. S 2.875% 04/12/2025	EUR	700,000	946,045	0.08
Russian Foreign Bond - Eurobond, Reg. S 4.25% 23/06/2027	USD	400,000	457,250	0.04
			4,575,718	0.39
<i>Saudi Arabia</i>				
KSA Sukuk Ltd., 144A 2.894% 20/04/2022	USD	200,000	206,249	0.02
KSA Sukuk Ltd., 144A 3.628% 20/04/2027	USD	225,000	253,092	0.02
Saudi Arabian Oil Co., 144A 1.625% 24/11/2025	USD	200,000	205,041	0.02
Saudi Government Bond, Reg. S 2.9% 22/10/2025	USD	400,000	431,690	0.04
Saudi Government Bond, Reg. S 3.625% 04/03/2028	USD	260,000	291,829	0.02
			1,387,901	0.12
<i>Serbia</i>				
Serbia Government Bond, 144A 3.125% 15/05/2027	EUR	1,010,000	1,389,580	0.12
Serbia Government Bond, 144A 1.5% 26/06/2029	EUR	110,000	139,308	0.01
Serbia Government Bond, Reg. S 3.125% 15/05/2027	EUR	1,150,000	1,582,196	0.14
			3,111,084	0.27
<i>Singapore</i>				
Singapore Government Bond 2.625% 01/05/2028	SGD	673,000	576,709	0.05
Singapore Government Bond 2.875% 01/07/2029	SGD	293,000	259,473	0.02
Singapore Government Bond 2.875% 01/09/2030	SGD	314,000	282,457	0.03
			1,118,639	0.10
<i>South Africa</i>				
South Africa Government Bond 6.5% 28/02/2041	ZAR	4,690,000	209,211	0.02
South Africa Government Bond 8.75% 28/02/2048	ZAR	11,765,000	659,628	0.06
			868,839	0.08
<i>South Korea</i>				
Korea Housing Finance Corp., Reg. S 2% 11/10/2021	USD	475,000	480,752	0.04
Korea Treasury 2% 10/09/2022	KRW	844,000,000	791,626	0.07
Korea Treasury 1.5% 10/03/2025	KRW	1,988,000,000	1,847,825	0.16
Korea Treasury 4.25% 10/06/2021	KRW	58,500,000	54,701	-
			3,174,904	0.27

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Spain</i>				
CaixaBank SA, Reg. S, FRN 3.5% 15/02/2027	EUR	100,000	126,017	0.01
			126,017	0.01
<i>Sri Lanka</i>				
Sri Lanka Government Bond, Reg. S 6.25% 27/07/2021	USD	630,000	548,339	0.05
			548,339	0.05
<i>Supra National</i>				
International Finance Corp. 6.3% 25/11/2024	INR	15,000,000	213,019	0.02
			213,019	0.02
<i>Thailand</i>				
Thailand Government Bond 3.65% 20/06/2031	THB	16,725,000	690,995	0.06
			690,995	0.06
<i>Ukraine</i>				
Ukraine Government Bond, Reg. S 6.75% 20/06/2026	EUR	350,000	472,270	0.04
			472,270	0.04
<i>United Arab Emirates</i>				
Abu Dhabi Government Bond, 144A 2.5% 11/10/2022	USD	775,000	803,346	0.07
Abu Dhabi Government Bond, 144A 2.5% 16/04/2025	USD	415,000	444,087	0.04
Abu Dhabi Government Bond, Reg. S 0.75% 02/09/2023	USD	655,000	657,063	0.05
			1,904,496	0.16
<i>United Kingdom</i>				
Anglo American Capital plc, 144A 4% 11/09/2027	USD	200,000	229,706	0.02
Barclays Bank plc, Reg. S 10% 21/05/2021	GBP	50,000	70,660	0.01
BAT Capital Corp. 3.215% 06/09/2026	USD	349,000	384,773	0.03
BAT Capital Corp. 4.7% 02/04/2027	USD	123,000	144,773	0.01
BAT Capital Corp. 4.758% 06/09/2049	USD	140,000	162,583	0.01
HSBC Holdings plc, FRN 4.292% 12/09/2026	USD	250,000	285,167	0.02
HSBC Holdings plc 4% 30/03/2022	USD	110,000	114,979	0.01
HSBC Holdings plc, FRN 3.033% 22/11/2023	USD	275,000	289,108	0.02
Lloyds Banking Group plc, FRN 3.87% 09/07/2025	USD	270,000	298,004	0.03
Lloyds Banking Group plc, Reg. S, FRN 1.875% 15/01/2026	GBP	128,000	181,155	0.01
NatWest Markets plc, Reg. S 2.75% 02/04/2025	EUR	250,000	339,592	0.03
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/09/2021	USD	90,000	91,185	0.01
UK Treasury, Reg. S 1.625% 22/10/2028	GBP	365,000	560,228	0.05
UK Treasury, Reg. S 4.75% 07/12/2030	GBP	1,150,000	2,276,745	0.20
UK Treasury, Reg. S 4.25% 07/06/2032	GBP	740,000	1,461,293	0.13
UK Treasury, Reg. S 4.5% 07/09/2034	GBP	590,000	1,247,290	0.11
UK Treasury, Reg. S 0.625% 31/07/2035	GBP	1,901,000	2,639,813	0.23
UK Treasury, Reg. S 0.625% 22/10/2050	GBP	520,000	689,006	0.06
			11,466,060	0.99

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>United States of America</i>				
Abbott Laboratories 3.75% 30/11/2026	USD	57,000	66,807	0.01
AbbVie, Inc. 3.2% 14/05/2026	USD	300,000	332,692	0.03
Alexandria Real Estate Equities, Inc. 1.875% 01/02/2033	USD	372,000	372,138	0.03
Altria Group, Inc. 1% 15/02/2023	EUR	125,000	155,755	0.01
Altria Group, Inc. 4.4% 14/02/2026	USD	55,000	63,872	0.01
Altria Group, Inc. 2.2% 15/06/2027	EUR	375,000	500,433	0.04
American Campus Communities Operating Partnership LP, REIT 3.875% 30/01/2031	USD	50,000	56,696	–
American Electric Power Co., Inc. 1% 01/11/2025	USD	50,000	50,631	–
Anheuser-Busch Cos. LLC 4.9% 01/02/2046	USD	260,000	339,434	0.03
AT&T, Inc. 1.65% 01/02/2028	USD	150,000	153,174	0.01
AT&T, Inc. 2.25% 01/02/2032	USD	375,000	380,920	0.03
Avangrid, Inc. 3.8% 01/06/2029	USD	300,000	344,396	0.03
Becton Dickinson and Co. 2.823% 20/05/2030	USD	67,000	73,689	0.01
Becton Dickinson and Co. 3.734% 15/12/2024	USD	180,000	199,634	0.02
Berkshire Hathaway Energy Co. 3.75% 15/11/2023	USD	60,000	65,387	0.01
Boeing Co. (The) 3.625% 01/02/2031	USD	13,000	14,265	–
Boeing Co. (The) 4.875% 01/05/2025	USD	15,000	17,109	–
BP Capital Markets America, Inc. 2.939% 04/06/2051	USD	390,000	398,250	0.03
BP Capital Markets America, Inc. 4.234% 06/11/2028	USD	225,000	268,952	0.02
Cigna Corp. 3.4% 17/09/2021	USD	115,000	117,488	0.01
Cigna Corp. 4.125% 15/11/2025	USD	80,000	92,172	0.01
Cigna Corp. 4.375% 15/10/2028	USD	160,000	193,432	0.02
CMS Energy Corp. 3.45% 15/08/2027	USD	175,000	197,956	0.02
CMS Energy Corp. 3.6% 15/11/2025	USD	25,000	28,035	–
Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 4% 01/12/2028	USD	200,000	236,227	0.02
Enbridge Energy Partners LP 7.375% 15/10/2045	USD	22,000	33,596	–
Enterprise Products Operating LLC 2.8% 31/01/2030	USD	38,000	41,228	–
Essex Portfolio LP, REIT 3.5% 01/04/2025	USD	30,000	33,257	–
Exxon Mobil Corp. 3.482% 19/03/2030	USD	290,000	338,016	0.03
FirstEnergy Corp. 3.9% 15/07/2027	USD	225,000	248,202	0.02
FirstEnergy Corp. 2.65% 01/03/2030	USD	100,000	100,423	0.01
FirstEnergy Corp. 2.25% 01/09/2030	USD	100,000	96,800	0.01
General Motors Financial Co., Inc. 3.55% 08/07/2022	USD	140,000	146,054	0.01
Global Payments, Inc. 2.9% 15/05/2030	USD	135,000	146,906	0.01
Harley-Davidson Financial Services, Inc., Reg. S 3.875% 19/05/2023	EUR	230,000	304,618	0.03
International Business Machines Corp. 1.95% 15/05/2030	USD	290,000	298,992	0.03
Medtronic, Inc. 3.5% 15/03/2025	USD	25,000	28,061	–
Morgan Stanley, FRN 0.637% 26/07/2024	EUR	250,000	311,014	0.03
MPLX LP 2.65% 15/08/2030	USD	218,000	228,720	0.02
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2.25% 01/06/2030	USD	1,661,000	1,742,622	0.15
Oracle Corp. 3.6% 01/04/2050	USD	310,000	362,040	0.03
Philip Morris International, Inc. 2.1% 01/05/2030	USD	106,000	110,629	0.01
Philip Morris International, Inc. 2.9% 15/11/2021	USD	25,000	25,584	–

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Prologis LP, REIT 3.75% 01/11/2025	USD	25,000	28,407	–
Public Service Enterprise Group, Inc. 2% 15/11/2021	USD	80,000	80,990	0.01
Raytheon Technologies Corp. 4.125% 16/11/2028	USD	215,000	256,372	0.02
Reynolds American, Inc. 4.45% 12/06/2025	USD	195,000	222,148	0.02
Roper Technologies, Inc. 1% 15/09/2025	USD	350,000	354,386	0.03
Stryker Corp. 0.75% 01/03/2029	EUR	190,000	241,492	0.02
Thermo Fisher Scientific, Inc. 4.133% 25/03/2025	USD	161,000	183,102	0.02
US Bank NA 3.45% 16/11/2021	USD	400,000	410,318	0.04
US Treasury 1.875% 30/09/2022	USD	1,270,000	1,308,651	0.11
US Treasury 0.125% 30/11/2022	USD	20,875,000	20,877,073	1.80
US Treasury 2.5% 31/01/2024	USD	11,115,000	11,908,132	1.03
US Treasury 2.125% 31/03/2024	USD	2,125,000	2,257,861	0.19
US Treasury 2.25% 30/04/2024	USD	5,140,000	5,490,260	0.47
US Treasury 1.75% 31/12/2024	USD	4,970,000	5,264,483	0.45
US Treasury 0.375% 30/11/2025	USD	21,593,000	21,620,902	1.86
US Treasury 0.625% 15/05/2030	USD	2,960,000	2,893,260	0.25
US Treasury 0.625% 15/08/2030	USD	4,260,000	4,152,083	0.36
US Treasury 0.875% 15/11/2030	USD	35,852,000	35,714,753	3.07
US Treasury 1.25% 15/05/2050	USD	276,000	250,317	0.02
US Treasury 1.375% 15/08/2050	USD	20,073,000	18,783,291	1.62
US Treasury Inflation Indexed 0.125% 15/01/2030	USD	1,570,000	1,772,319	0.15
US Treasury Inflation Indexed 1% 15/02/2049	USD	1,900,000	2,772,706	0.24
US Treasury Inflation Indexed 1% 15/02/2046	USD	305,000	457,716	0.04
Verizon Communications, Inc. 0.85% 20/11/2025	USD	750,000	756,074	0.07
Walt Disney Co. (The) 2.65% 13/01/2031	USD	490,000	537,352	0.05
Wells Fargo & Co., Reg. S, FRN 1.338% 04/05/2025	EUR	340,000	432,813	0.04
			148,343,567	12.77
Total Bonds			324,477,085	27.93
Equities				
<i>Brazil</i>				
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	BRL	393,755	4,698,498	0.40
Pageseguro Digital Ltd. 'A'	USD	249,600	14,197,248	1.22
Petroleo Brasileiro SA, ADR	USD	193,162	2,169,209	0.19
Vale SA	BRL	349,964	5,892,024	0.51
			26,956,979	2.32
<i>Canada</i>				
TC Energy Corp.	CAD	130,608	5,309,894	0.46
			5,309,894	0.46
<i>China</i>				
Alibaba Group Holding Ltd.	HKD	141,600	4,248,484	0.37
Kweichow Moutai Co. Ltd. 'A'	CNY	31,301	9,562,892	0.82
Longfor Group Holdings Ltd., Reg. S	HKD	945,500	5,537,050	0.48
Shimao Group Holdings Ltd.	HKD	843,000	2,685,873	0.23
			22,034,299	1.90
<i>Denmark</i>				
Coloplast A/S 'B'	DKK	43,989	6,711,998	0.58
			6,711,998	0.58
<i>France</i>				
Airbus SE	EUR	69,324	7,603,438	0.65

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Edenred	EUR	96,564	5,474,868	0.47
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	18,564	11,586,553	1.00
Peugeot SA	EUR	81,595	2,229,853	0.19
			26,894,712	2.31
<i>Germany</i>				
Bayer AG	EUR	37,335	2,196,364	0.19
Carl Zeiss Meditec AG	EUR	25,586	3,403,902	0.29
Deutsche Boerse AG	EUR	27,338	4,650,598	0.40
MTU Aero Engines AG	EUR	16,500	4,301,552	0.37
			14,552,416	1.25
<i>Hong Kong</i>				
AIA Group Ltd.	HKD	527,200	6,460,409	0.56
Budweiser Brewing Co. APAC Ltd., Reg. S	HKD	928,200	3,065,085	0.26
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	HKD	109,100	5,981,013	0.52
Shimao Services Holdings Ltd., Reg. S	HKD	7,829	12,078	–
SITC International Holdings Co. Ltd.	HKD	2,801,000	6,048,248	0.52
			21,566,833	1.86
<i>Italy</i>				
Enel SpA	EUR	931,225	9,415,034	0.81
Ferrari NV	EUR	14,091	3,247,472	0.28
FinecoBank Banca Fineco SpA	EUR	224,102	3,668,575	0.32
			16,331,081	1.41
<i>Japan</i>				
Keyence Corp.	JPY	10,100	5,673,333	0.49
Murata Manufacturing Co. Ltd.	JPY	47,800	4,314,522	0.37
Nidec Corp.	JPY	19,000	2,388,456	0.21
Nintendo Co. Ltd.	JPY	11,300	7,204,290	0.62
SMC Corp.	JPY	9,300	5,669,798	0.49
SoftBank Corp.	JPY	755,200	9,456,913	0.81
Tokio Marine Holdings, Inc.	JPY	102,600	5,274,329	0.45
Tokyo Electron Ltd.	JPY	31,200	11,603,119	1.00
			51,584,760	4.44
<i>Mexico</i>				
America Movil SAB de CV, ADR 'L'	USD	127,347	1,851,625	0.16
			1,851,625	0.16
<i>Netherlands</i>				
Akzo Nobel NV	EUR	37,408	4,015,157	0.35
ASML Holding NV	EUR	54,278	26,361,031	2.27
Coca-Cola European Partners plc	USD	52,084	2,595,346	0.22
Koninklijke DSM NV	EUR	22,133	3,807,060	0.33
Koninklijke Philips NV	EUR	43,311	2,316,438	0.20
			39,095,032	3.37
<i>New Zealand</i>				
Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd.	NZD	220,898	5,240,124	0.45
			5,240,124	0.45
<i>South Korea</i>				
Samsung Electronics Co. Ltd. Preference	KRW	76,556	5,186,893	0.45
			5,186,893	0.45

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>Switzerland</i>				
Givaudan SA	CHF	1,658	6,985,587	0.60
Nestle SA	CHF	124,229	14,630,199	1.26
Novartis AG	CHF	52,796	4,988,575	0.43
Zurich Insurance Group AG	CHF	33,376	14,081,030	1.21
			40,685,391	3.50
<i>Taiwan</i>				
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	1,957,000	36,914,015	3.18
			36,914,015	3.18
<i>United Kingdom</i>				
AstraZeneca plc	GBP	173,209	17,347,869	1.49
BAE Systems plc	GBP	628,590	4,201,709	0.36
British American Tobacco plc, ADR	USD	10,569	396,232	0.04
British American Tobacco plc	GBP	225,791	8,361,470	0.72
Croda International plc	GBP	61,381	5,536,585	0.48
Ocado Group plc	GBP	231,269	7,232,874	0.62
Rio Tinto plc	GBP	34,723	2,597,358	0.22
Spirax-Sarco Engineering plc	GBP	32,352	4,997,062	0.43
			50,671,159	4.36
<i>United States of America</i>				
Alphabet, Inc. 'C'	USD	4,349	7,618,926	0.66
Altria Group, Inc.	USD	210,440	8,628,040	0.74
Amazon.com, Inc.	USD	2,284	7,438,828	0.64
American Tower Corp., REIT	USD	20,818	4,672,808	0.40
Amphenol Corp. 'A'	USD	35,244	4,608,858	0.40
Baker Hughes Co.	USD	200,602	4,182,552	0.36
Berkshire Hathaway, Inc. 'A'	USD	30	10,434,450	0.90
BlackRock, Inc.	USD	10,278	7,415,988	0.64
Boeing Co. (The)	USD	7,495	1,604,380	0.14
Broadcom, Inc.	USD	49,871	21,836,017	1.88
Brookfield Infrastructure Partners LP	CAD	45,154	2,234,110	0.19
Chevron Corp.	USD	36,701	3,099,400	0.27
Cigna Corp.	USD	17,780	3,701,440	0.32
Coca-Cola Co. (The)	USD	47,344	2,596,345	0.22
Crown Castle International Corp., REIT	USD	48,116	7,659,586	0.66
CSX Corp.	USD	41,771	3,790,718	0.33
Darden Restaurants, Inc.	USD	44,305	5,277,612	0.45
Domino's Pizza, Inc.	USD	12,216	4,684,347	0.40
Equinix, Inc., REIT	USD	8,973	6,408,337	0.55
Gaming and Leisure Properties, Inc., REIT	USD	111,498	4,727,515	0.41
General Motors Co.	USD	89,767	3,737,898	0.32
Gilead Sciences, Inc.	USD	42,097	2,452,571	0.21
Home Depot, Inc. (The)	USD	37,637	9,997,140	0.86
Honeywell International, Inc.	USD	16,197	3,445,102	0.30
Humana, Inc.	USD	22,692	9,309,847	0.80
JPMorgan Chase & Co.	USD	137,409	17,460,562	1.50
Keurig Dr Pepper, Inc.	USD	250,559	8,017,888	0.69
LyondellBasell Industries NV 'A'	USD	44,433	4,072,729	0.35
Mastercard, Inc. 'A'	USD	13,410	4,786,565	0.41
Merck & Co., Inc.	USD	86,798	7,100,076	0.61

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Mettler-Toledo International, Inc.	USD	5,273	6,009,533	0.52
Microsoft Corp.	USD	130,027	28,920,605	2.49
Pfizer, Inc.	USD	225,518	8,301,318	0.71
Philip Morris International, Inc.	USD	162,005	13,412,394	1.15
Procter & Gamble Co. (The)	USD	15,553	2,164,045	0.19
S&P Global, Inc.	USD	15,343	5,043,704	0.43
Thermo Fisher Scientific, Inc.	USD	15,375	7,161,368	0.62
Union Pacific Corp.	USD	12,997	2,706,235	0.23
United Parcel Service, Inc. 'B'	USD	16,277	2,741,047	0.24
UnitedHealth Group, Inc.	USD	37,412	13,119,640	1.13
Verizon Communications, Inc.	USD	120,661	7,088,834	0.61
Viatris, Inc.	USD	158,784	2,975,612	0.26
Visa, Inc. 'A'	USD	23,495	5,139,061	0.44
Watsco, Inc.	USD	17,200	3,896,660	0.34
Wynn Resorts Ltd.	USD	13,593	1,533,698	0.13
			303,214,389	26.10
Total Equities			674,801,600	58.10
Total Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing			999,278,685	86.03
Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market				
Bonds				
<i>Brazil</i>				
BRAZIL NTNB, FRN 1.977% 15/08/2024	BRL	180,000	1,369,137	0.12
			1,369,137	0.12
<i>Canada</i>				
Province of Quebec Canada 1.9% 01/09/2030	CAD	1,760,000	1,459,601	0.13
Toronto-Dominion Bank (The) 1.15% 12/06/2025	USD	400,000	408,624	0.03
			1,868,225	0.16
<i>France</i>				
BPCE SA 0.64% 27/01/2022	JPY	300,000,000	2,914,412	0.25
BPCE SA, 144A 5.15% 21/07/2024	USD	211,000	240,477	0.02
Vinci SA, 144A 3.75% 10/04/2029	USD	225,000	264,085	0.03
			3,418,974	0.30
<i>Germany</i>				
Daimler Finance North America LLC, 144A 3% 22/02/2021	USD	250,000	250,833	0.02
Daimler Finance North America LLC, 144A 2% 06/07/2021	USD	200,000	201,624	0.02
Deutsche Bank AG 2.129% 24/11/2026	USD	200,000	204,642	0.02
Deutsche Telekom International Finance BV, 144A 2.485% 19/09/2023	USD	175,000	183,215	0.01
			840,314	0.07
<i>Japan</i>				
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/09/2024	JPY	27,000,000	264,893	0.02
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2027	JPY	15,000,000	148,133	0.01

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2028	JPY	309,200,000	3,021,714	0.26
Japan Government CPI Linked Bond 0.1% 10/03/2029	JPY	404,000,000	3,928,705	0.34
Mizuho Financial Group, Inc., FRN 2.721% 16/07/2023	USD	347,000	358,486	0.03
Nissan Motor Acceptance Corp., 144A 2.6% 28/09/2022	USD	60,000	61,583	0.01
			7,783,514	0.67
<i>Malaysia</i>				
Malaysia Government Bond 3.62% 30/11/2021	MYR	325,000	82,122	0.01
Malaysia Government Bond 3.9% 30/11/2026	MYR	2,300,000	621,658	0.05
Malaysia Government Bond 3.899% 16/11/2027	MYR	3,090,000	843,176	0.07
Malaysia Government Bond 4.893% 08/06/2038	MYR	4,906,000	1,439,825	0.12
Malaysia Government Bond 3.757% 22/05/2040	MYR	6,929,000	1,810,541	0.16
Malaysia Government Bond 4.736% 15/03/2046	MYR	1,134,000	322,446	0.03
			5,119,768	0.44
<i>Mexico</i>				
Mexico Government Bond 0.62% 05/07/2022	JPY	100,000,000	965,338	0.08
			965,338	0.08
<i>Netherlands</i>				
Enel Finance International NV, 144A 2.75% 06/04/2023	USD	200,000	209,389	0.02
Enel Finance International NV, 144A 3.5% 06/04/2028	USD	550,000	626,936	0.05
			836,325	0.07
<i>United Kingdom</i>				
AstraZeneca plc 3.375% 16/11/2025	USD	350,000	393,795	0.04
Niagara Mohawk Power Corp., Reg. S 3.508% 01/10/2024	USD	5,000	5,495	–
			399,290	0.04
<i>United States of America</i>				
Altria Group, Inc. 3.4% 06/05/2030	USD	25,000	28,079	–
Amazon.com, Inc. 2.5% 03/06/2050	USD	610,000	632,952	0.06
Amgen, Inc. 1.9% 21/02/2025	USD	79,000	83,184	0.01
Apple, Inc. 2.4% 20/08/2050	USD	230,000	235,895	0.02
Apple, Inc. 2.65% 11/05/2050	USD	71,000	75,360	0.01
Bank of America Corp. 1.319% 19/06/2026	USD	246,000	251,412	0.02
Bank of America Corp., FRN 2.456% 22/10/2025	USD	109,000	116,240	0.01
Bank of America Corp., FRN 3.419% 20/12/2028	USD	298,000	337,146	0.03
BMW US Capital LLC, 144A 3.15% 18/04/2024	USD	105,000	113,254	0.01
Broadcom, Inc. 3.15% 15/11/2025	USD	130,000	142,003	0.01
Broadcom, Inc. 4.15% 15/11/2030	USD	130,000	150,579	0.01
Charter Communications Operating LLC 2.3% 01/02/2032	USD	510,000	510,764	0.04
Citigroup, Inc., FRN 3.106% 08/04/2026	USD	525,000	574,291	0.05
Citigroup, Inc., FRN 2.572% 03/06/2031	USD	340,000	362,494	0.03
Comcast Corp. 3.95% 15/10/2025	USD	115,000	132,179	0.01
CSX Corp. 2.5% 15/05/2051	USD	200,000	198,668	0.02

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
CSX Corp. 3.8% 15/04/2050	USD	12,000	14,868	–
Equinix, Inc., REIT 1.8% 15/07/2027	USD	222,000	228,773	0.02
Equinix, Inc., REIT 2.15% 15/07/2030	USD	910,000	927,032	0.08
Exelon Corp. 3.497% 01/06/2022	USD	90,000	93,633	0.01
Exelon Corp. 3.4% 15/04/2026	USD	20,000	22,538	–
FHLMC Q52216 3.5% 01/11/2047	USD	31,669	33,622	–
General Mills, Inc. 3.2% 16/04/2021	USD	35,000	35,271	–
GNMA MA5764 4.5% 20/02/2049	USD	467,262	505,746	0.04
GNMA MA5877 4.5% 20/04/2049	USD	9,622	10,407	–
Goldman Sachs Group, Inc. (The) 1.093% 09/12/2026	USD	400,000	404,501	0.04
Grand Parkway Transportation Corp. 3.236% 01/10/2052	USD	150,000	156,998	0.01
Interstate Power and Light Co. 2.3% 01/06/2030	USD	75,000	79,430	0.01
Intuit, Inc. 1.35% 15/07/2027	USD	90,000	92,185	0.01
JPMorgan Chase & Co. 1.045% 19/11/2026	USD	750,000	758,661	0.07
JPMorgan Chase & Co., FRN 4.005% 23/04/2029	USD	340,000	399,388	0.03
JPMorgan Chase & Co., FRN 3.54% 01/05/2028	USD	100,000	114,387	0.01
Keurig Dr Pepper, Inc. 4.597% 25/05/2028	USD	400,000	487,398	0.04
Keurig Dr Pepper, Inc. 3.2% 01/05/2030	USD	30,000	34,003	–
Morgan Stanley 0.985% 10/12/2026	USD	1,310,000	1,320,280	0.11
Ohio Turnpike & Infrastructure Commission 3.216% 15/02/2048	USD	175,000	178,514	0.02
Pacific Gas and Electric Co. 2.1% 01/08/2027	USD	1,068,000	1,085,375	0.09
Pacific Gas and Electric Co. 3.3% 01/12/2027	USD	250,000	267,234	0.02
Pacific Gas and Electric Co. 3.3% 01/08/2040	USD	880,000	879,350	0.08
Pacific Oil and Gas 3.85% 15/11/2023	USD	20,000	21,272	–
PayPal Holdings, Inc. 2.3% 01/06/2030	USD	72,000	77,184	0.01
Philip Morris International, Inc. 0.875% 01/05/2026	USD	208,000	208,973	0.02
Southern California Edison Co. 2.85% 01/08/2029	USD	420,000	458,440	0.04
Southern California Gas Co. 2.55% 01/02/2030	USD	440,000	477,551	0.04
UMBS BJ9358 4% 01/03/2048	USD	65,400	69,906	0.01
UMBS MA4228 1.5% 01/01/2036	USD	1,492,000	1,535,974	0.13
UMBS SB8083 1.5% 01/01/2036	USD	58,191	59,906	0.01
UMBS SI2002 4% 01/03/2048	USD	263,254	281,783	0.02
Wells Fargo & Co., FRN 2.393% 02/06/2028	USD	750,000	798,849	0.07
			16,063,932	1.38
Total Bonds			38,664,817	3.33
Total Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market			38,664,817	3.33
Recently issued securities				
Bonds				
<i>South Korea</i>				
Hyundai Capital America, 144A 2.375% 15/10/2027	USD	264,000	277,104	0.03
			277,104	0.03
<i>Switzerland</i>				
UBS Group AG, 144A 1.008% 30/07/2024	USD	250,000	252,560	0.02
			252,560	0.02

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2020

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<i>United States of America</i>				
AT&T, Inc., Reg. S 2.55% 01/12/2033	USD	116,000	119,538	0.01
Berkshire Hathaway Energy Co., 144A 1.65% 15/05/2031	USD	300,000	300,338	0.03
BMW US Capital LLC, 144A 3.9% 09/04/2025	USD	130,000	146,413	0.01
BMW US Capital LLC, 144A 4.15% 09/04/2030	USD	130,000	157,335	0.01
New York Life Insurance Co., 144A 3.75% 15/05/2050	USD	41,000	49,094	–
T-Mobile USA, Inc., 144A 3.875% 15/04/2030	USD	425,000	492,685	0.04
T-Mobile USA, Inc., 144A 2.55% 15/02/2031	USD	200,000	210,264	0.02
T-Mobile USA, Inc., 144A 3% 15/02/2041	USD	211,000	219,144	0.02
Viatrix, Inc., 144A 2.3% 22/06/2027	USD	75,000	79,931	0.01
			1,774,742	0.15
Total Bonds			2,304,406	0.20
Total Recently issued securities			2,304,406	0.20
Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings				
Collective Investment Schemes - UCITS				
<i>Luxembourg</i>				
JPMorgan USD Treasury CNAV Fund - JPM USD Treasury CNAV Institutional (dist.)	USD	76,115,151	76,115,151	6.55
			76,115,151	6.55
Total Collective Investment Schemes - UCITS			76,115,151	6.55
Total Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings			76,115,151	6.55
Total Investments			1,116,363,059	96.11
Cash			36,997,161	3.19
Other assets/(liabilities)			8,189,794	0.70
Total net assets			1,161,550,014	100.00

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

To Be Announced Contracts							
Country	Security Description	Currency	Nominal Value	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets	
United States of America	GNMA, 4.50%, 15/01/2050	USD	118,168	126,545	(504)	0.01	
United States of America	GNMA, 4.50%, 15/02/2050	USD	282,832	303,148	(215)	0.03	
United States of America	UMBS, 1.50%, 25/02/2035	USD	4,390,807	4,511,585	11,170	0.39	
United States of America	UMBS, 2.00%, 25/02/2050	USD	461,074	478,076	2,301	0.04	
United States of America	UMBS, 4.50%, 25/02/2050	USD	669,572	726,603	614	0.06	
United States of America	UMBS, 2.00%, 25/03/2050	USD	599,087	620,171	2,031	0.05	
Total To Be Announced Contracts Long Positions				6,766,128	15,397	0.58	
Net To Be Announced Contracts				6,766,128	15,397	0.58	

Interest Rate Swap Contracts

Nominal Amount	Currency	Counterparty	Security Description	Maturity Date	Market Value USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
2,800,000	EUR	Citigroup	Pay floating EURIBOR 6 month Receive fixed (0.122)%	25/07/2024	24,880	24,880	–
Total Unrealised Gain on Interest Rate Swap Contracts					24,880	24,880	–
Net Unrealised Gain on Interest Rate Swap Contracts					24,880	24,880	–

Financial Futures Contracts

Security Description	Number of Contracts	Currency	Global Exposure USD	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
US 2 Year Note, 31/03/2021	18	USD	3,977,578	3,784	–
US 5 Year Note, 31/03/2021	18	USD	2,270,953	4,908	–
US 10 Year Ultra Bond, 22/03/2021	(10)	USD	(1,563,594)	3,385	–
Total Unrealised Gain on Financial Futures Contracts				12,077	–
Euro-Bund, 08/03/2021	(7)	EUR	(1,519,097)	(6,554)	–
US Ultra Bond, 22/03/2021	(2)	USD	(427,125)	(4,413)	–
Total Unrealised Loss on Financial Futures Contracts				(10,967)	–
Net Unrealised Gain on Financial Futures Contracts				1,110	–

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Forward Currency Exchange Contracts							
Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
MYR	2,030,000	USD	497,756	07/01/2021	Standard Chartered	6,864	–
AUD	460,000	USD	342,578	08/01/2021	UBS	12,075	–
CNH	1,770,000	USD	271,429	08/01/2021	Citibank	702	–
CNH	1,750,000	USD	267,637	08/01/2021	Standard Chartered	1,420	–
CZK	14,155,000	EUR	539,064	08/01/2021	HSBC	472	–
EUR	1,140,000	USD	1,375,615	08/01/2021	Bank of America	17,188	–
EUR	6,522,127	USD	7,841,326	08/01/2021	Morgan Stanley	127,130	0.01
EUR	810,000	USD	982,240	08/01/2021	Standard Chartered	7,384	–
GBP	460,000	USD	612,574	08/01/2021	Citibank	16,498	–
SGD	350,000	USD	261,614	08/01/2021	Bank of America	3,218	–
ZAR	2,380,000	USD	154,009	08/01/2021	Bank of America	7,863	–
CLP	473,300,000	USD	641,676	14/01/2021	Citibank	24,381	–
JPY	69,740,000	USD	671,857	14/01/2021	Goldman Sachs	3,640	–
JPY	725,460,000	USD	6,959,053	14/01/2021	HSBC	67,707	0.01
JPY	31,100,000	USD	300,197	14/01/2021	Morgan Stanley	1,036	–
KRW	2,858,440,000	USD	2,629,499	14/01/2021	Citibank	2,361	–
CNH	5,120,000	USD	782,303	19/01/2021	Goldman Sachs	4,299	–
DKK	3,720,000	USD	607,276	19/01/2021	Goldman Sachs	3,542	–
THB	22,600,000	USD	752,155	19/01/2021	UBS	2,176	–
USD	998,593	BRL	5,110,000	22/01/2021	Goldman Sachs	14,876	–
EUR	770,000	USD	939,798	25/01/2021	HSBC	1,352	–
EUR	400,000	USD	488,109	25/01/2021	Morgan Stanley	800	–
GBP	1,994,710	USD	2,693,775	25/01/2021	Morgan Stanley	34,459	–
CAD	3,060,000	USD	2,346,489	29/01/2021	Bank of America	57,723	0.01
CAD	2,510,000	USD	1,924,169	29/01/2021	Citibank	47,913	0.01
EUR	4,316,066	DKK	32,120,000	29/01/2021	Citibank	579	–
EUR	151,857	DKK	1,130,000	29/01/2021	Goldman Sachs	39	–
MXN	15,990,000	USD	766,539	29/01/2021	Goldman Sachs	34,748	–
CAD	340,000	USD	262,034	10/02/2021	Barclays	5,109	–
CAD	3,630,000	USD	2,800,730	10/02/2021	UBS	51,411	0.01
Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts						558,965	0.05
EUR Hedged Share Class							
CHF	16,826	EUR	15,556	15/01/2021	J.P. Morgan	4	–
EUR	14,442,616	CHF	15,554,280	15/01/2021	J.P. Morgan	73,372	0.01
EUR	12,046,750	HKD	113,593,770	15/01/2021	J.P. Morgan	67,683	–
EUR	148,651	JPY	18,741,868	15/01/2021	J.P. Morgan	115	–
EUR	218,697,138	USD	266,011,175	15/01/2021	J.P. Morgan	1,233,687	0.11
GBP	22,979	EUR	25,238	15/01/2021	J.P. Morgan	586	–
HKD	3,768	EUR	396	15/01/2021	J.P. Morgan	2	–
JPY	179,224	EUR	1,415	15/01/2021	J.P. Morgan	7	–
USD	8,805	EUR	7,178	15/01/2021	J.P. Morgan	34	–

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)

As at 31 December 2020

Forward Currency Exchange Contracts							
Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
JPY Hedged Share Class							
GBP	403	JPY	55,850	15/01/2021	J.P. Morgan	10	–
JPY	399,353,146	CHF	3,400,915	15/01/2021	J.P. Morgan	25,348	–
JPY	1,595,480,438	EUR	12,619,884	15/01/2021	J.P. Morgan	32,588	–
JPY	323,022,346	HKD	24,089,433	15/01/2021	J.P. Morgan	21,343	–
JPY	6,027,551,277	USD	57,994,225	15/01/2021	J.P. Morgan	388,968	0.04
Unrealised Gain on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts						1,843,747	0.16
Total Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts						2,402,712	0.21
GBP	205,000	EUR	229,473	06/01/2021	Citibank	(3)	–
USD	500,105	ILS	1,670,000	06/01/2021	Standard Chartered	(19,596)	–
USD	347,975	AUD	460,000	08/01/2021	HSBC	(6,678)	–
USD	1,340,809	CNH	8,760,000	08/01/2021	Goldman Sachs	(6,013)	–
USD	616,764	CZK	13,470,000	08/01/2021	Citibank	(10,418)	–
USD	1,085,841	EUR	890,000	08/01/2021	Citibank	(1,522)	–
USD	265,035	MXN	5,340,000	08/01/2021	Goldman Sachs	(3,214)	–
USD	540,877	MXN	10,870,000	08/01/2021	HSBC	(5,166)	–
USD	577,891	ZAR	8,870,000	08/01/2021	Goldman Sachs	(25,390)	–
ZAR	2,390,000	USD	163,519	08/01/2021	UBS	(967)	–
JPY	56,200,000	USD	545,666	14/01/2021	Citibank	(1,316)	–
USD	992,801	AUD	1,320,000	14/01/2021	Bank of America	(24,980)	–
USD	325,294	AUD	430,000	14/01/2021	HSBC	(6,256)	–
USD	983,363	INR	72,700,000	14/01/2021	HSBC	(10,502)	–
USD	1,515,953	KRW	1,674,370,000	14/01/2021	Citibank	(25,695)	–
EUR	440,000	USD	540,127	25/01/2021	HSBC	(2,327)	–
USD	272,670	GBP	200,000	25/01/2021	Morgan Stanley	(877)	–
USD	4,200,002	CAD	5,570,000	29/01/2021	Citibank	(176,294)	(0.02)
USD	1,504,084	MXN	32,360,000	29/01/2021	Morgan Stanley	(117,531)	(0.01)
USD	409,629	ZAR	6,780,000	29/01/2021	Bank of America	(50,135)	(0.01)
CAD	350,000	USD	275,341	10/02/2021	BNY Mellon	(342)	–
USD	2,714,475	CAD	3,490,000	10/02/2021	Goldman Sachs	(27,667)	(0.01)
Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts						(522,889)	(0.05)
EUR Hedged Share Class							
CHF	65	EUR	60	15/01/2021	J.P. Morgan	–	–
EUR	220,213	CHF	238,616	15/01/2021	J.P. Morgan	(523)	–
EUR	23,696,286	GBP	21,605,191	15/01/2021	J.P. Morgan	(591,563)	(0.05)
EUR	114,473	HKD	1,087,665	15/01/2021	J.P. Morgan	(421)	–
EUR	38,722,918	JPY	4,895,095,091	15/01/2021	J.P. Morgan	(95,293)	(0.01)
EUR	2,078,194	USD	2,546,190	15/01/2021	J.P. Morgan	(6,666)	–
HKD	118,525	EUR	12,555	15/01/2021	J.P. Morgan	(53)	–
JPY	5,040,820	EUR	39,988	15/01/2021	J.P. Morgan	(39)	–
USD	277,537	EUR	227,985	15/01/2021	J.P. Morgan	(1,057)	–

Capital Group Global Allocation Fund (LUX) (continued)
As at 31 December 2020

Forward Currency Exchange Contracts							
Currency Purchased	Amount Purchased	Currency Sold	Amount Sold	Maturity Date	Counterparty	Unrealised Gain/(Loss) USD	% of Net Assets
JPY Hedged Share Class							
CHF	294	JPY	34,559	15/01/2021	J.P. Morgan	(2)	–
EUR	1,090	JPY	137,831	15/01/2021	J.P. Morgan	(3)	–
HKD	2,138	JPY	28,663	15/01/2021	J.P. Morgan	(2)	–
JPY	1,209,576	CHF	10,375	15/01/2021	J.P. Morgan	(7)	–
JPY	2,067,476	EUR	16,401	15/01/2021	J.P. Morgan	(16)	–
JPY	647,340,910	GBP	4,666,351	15/01/2021	J.P. Morgan	(111,703)	(0.01)
JPY	9,200,901	HKD	690,970	15/01/2021	J.P. Morgan	(13)	–
JPY	3,642,476	USD	35,336	15/01/2021	J.P. Morgan	(55)	–
USD	5,004	JPY	520,353	15/01/2021	J.P. Morgan	(36)	–
Unrealised Loss on NAV Hedged Share Classes Forward Currency Exchange Contracts						(807,452)	(0.07)
Total Unrealised Loss on Forward Currency Exchange Contracts						(1,330,341)	(0.12)
Net Unrealised Gain on Forward Currency Exchange Contracts						1,072,371	0.09

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
7,500,000	USD	Citigroup	CDX.NA.IG.35-V1	Sell	1.00%	20/12/2025	183,728	183,728	0.02
Total Unrealised Gain on Credit Default Swap Contracts							183,728	183,728	0.02
Net Unrealised Gain on Credit Default Swap Contracts							183,728	183,728	0.02

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

<補足情報>

日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)

●当ファンドの仕組みは次のとおりです。

形態	追加型株式投資信託	
信託期間	無期限	
運用方針	NOMURA-BPI短期インデックスをベンチマークとし、これを上回る投資成果を目指します。主としてマザーファンドを通じて、わが国の公社債・金融商品に投資し、信託財産の安定的な成長を目指して安定運用を行いません。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。	
主要運用対象	ベビーファンド	日本短期債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	わが国の公社債・金融商品を主要投資対象とします。
組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への投資は行ないません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資は行ないません。
分配方針	経費等控除後の利子等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	
決算日	原則として毎年7月22日。ただし、該当日が休業日のときは該当日以降の最初の営業日を決算日とします。なお、第1計算期間の終了日は平成20年7月22日とします。	
委託会社	三菱UFJ国際投信株式会社	

損益の状況

(2020年7月23日～2021年7月26日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 7円
支払利息	△ 7
(B) 有価証券売買損益	471,542
売買益	471,554
売買損	△ 12
(C) 信託報酬等	△ 200,489
(D) 当期損益金(A+B+C)	271,046
(E) 前期繰越損益金	1,598,028
(F) 追加信託差損益金	5,099,350
(配当等相当額)	(7,672,604)
(売買損益相当額)	(△ 2,573,254)
(G) 計(D+E+F)	6,968,424
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	6,968,424
追加信託差損益金	5,099,350
(配当等相当額)	(7,672,604)
(売買損益相当額)	(△ 2,573,254)
分配準備積立金	5,881,291
繰越損益金	△ 4,012,217

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

●組入資産の明細

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
日本短期債券マザーファンド	121,025	120,848	135,917

(注) 日本短期債券マザーファンド全体の受益権口数は(期末: 1,514,616,498口)です。

<補足情報>

日本短期債券マザーファンド

●当ファンドの仕組みは次のとおりです。

運用方針	わが国の公社債・金融商品を主要投資対象とし、ポートフォリオのデュレーション調整と銘柄選択による収益獲得を目指して運用を行ないます。ポートフォリオのデュレーションはベンチマークの平均を中心に調整します。デュレーション調整は主としてファンダメンタルズ分析に基づく中期的な金利見通しに沿って行ないます。銘柄選択は信用リスクと金利スプレッドを定量的・定性的に分析して行ないます。NOMURA-BPI短期インデックスをベンチマークとし、同指数を上回る投資成果を目指して運用を行ないます。
主要運用対象	わが国の公社債・金融商品を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は行ないません。
決算日	原則として毎年7月22日。ただし、該当日が休業日のときは該当日以降の最初の営業日を決算日とします。
委託会社	三菱UFJ国際投信株式会社

損益の状況

(2020年7月23日～2021年7月26日)

項目	当期
(A) 配当等収益	6,402,255円
受取利息	6,424,384
支払利息	△ 22,129
(B) 有価証券売買損益	△ 158,620
売買益	3,686,000
売買損	△ 3,844,620
(C) 当期損益金(A+B)	6,243,635
(D) 前期繰越損益金	184,704,237
(E) 追加信託差損益金	35,074,648
(F) 解約差損益金	△ 37,100,568
(G) 計(C+D+E+F)	188,921,952
次期繰越損益金(G)	188,921,952

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

●組入資産の明細 (2021年7月26日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	50,000	55,459	3.3	—	—	3.3	—
普通社債券	1,600,000 (1,600,000)	1,601,941 (1,601,941)	94.0 (94.0)	— (—)	— (—)	41.1 (41.1)	52.9 (52.9)
合計	1,650,000 (1,600,000)	1,657,400 (1,601,941)	97.3 (94.0)	— (—)	— (—)	44.4 (41.1)	52.9 (52.9)

(注1) ()内は非上場債で内書き。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注4) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄		当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	第87回利付国債(20年)	2.2	50,000	55,459	2026/3/20
	小計		50,000	55,459	
普通社債券	第14回アサヒグループホールディングス	0.12	100,000	100,238	2025/10/15
	第14回セブン&アイ・ホールディングス	0.19	100,000	100,399	2025/12/19
	第15回Zホールディングス	0.35	100,000	100,240	2023/6/9
	第67回神戸製鋼所	0.2	100,000	100,194	2026/6/10
	第18回日立製作所	0.06	100,000	99,944	2023/3/10
	第50回日本電気	0.29	100,000	100,155	2022/6/15
	第46回IHI	0.22	100,000	100,018	2023/9/1
	第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	100,020	2024/8/2
	第37回丸井グループ	0.12	100,000	99,867	2023/12/1
	第19回みずほ銀行(劣後特約付)	1.67	100,000	100,826	2022/2/24
	第22回芙蓉総合リース	0.04	100,000	99,935	2022/10/28
	第5回イオンフィナンシャルサービス	0.23	100,000	100,041	2022/5/27
	第75回アコム	0.309	100,000	100,171	2023/2/28
	第5回ソフトバンク	0.1	100,000	99,897	2023/7/28
	第1回クレディ・アグリコル・エス・エー(2017)	0.443	100,000	100,155	2022/6/9
	第6回マラヤン・バンキング	0.224	100,000	99,841	2023/2/13
	小計		1,600,000	1,601,941	
	合計		1,650,000	1,657,400	

●参考情報 (2021年10月29日現在)

以下は、ファンドが実質的に投資する外国投資信託証券(キャピタル・グループ・グローバル・アロケーション・ファンド(LUX)(クラスCh-JPY))の内容です。

【資産状況】

国別構成比率

国名	株式	債券	比率合計
米国	31.5%	14.6%	46.0%
日本	3.4%	3.3%	6.7%
英国	5.4%	1.1%	6.6%
台湾	3.8%	0.0%	3.8%
スイス	3.4%	0.0%	3.4%
その他国	13.4%	11.6%	25.0%
現金・その他			8.5%

資産別構成比率

資産	証券種別	比率
株式		60.8%
債券		30.6%
	国債証券	25.3%
	社債券	4.3%
	その他証券	1.0%
現金・その他		8.5%

組入銘柄数

資産	銘柄数
株式	106
債券	396

組入上位10銘柄

	銘柄名	国名	資産	業種／証券種別	比率
1	MICROSOFT CORP	米国	株式	情報技術	2.9%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	台湾	株式	情報技術	2.9%
3	HOME DEPOT INC	米国	株式	一般消費財・サービス	2.5%
4	US TREASURY BOND 0.875% 11-15-30	米国	債券	国債証券	2.4%
5	NESTLE SA	スイス	株式	生活必需品	2.1%
6	BROADCOM INC	米国	株式	情報技術	1.9%
7	JPMORGAN CHASE & CO	米国	株式	金融	1.8%
8	US TREASURY NOTE 0.375% 11-30-25	米国	債券	国債証券	1.8%
9	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	1.7%
10	US TREASURY NOTE 0.125% 11-30-22	米国	債券	国債証券	1.4%

(注) 国についてはMSCI分類、業種についてはGICS(世界産業分類基準)に基づいていますが(債券は除く)、当社の判断に基づき分類したものが含まれる場合があります。

