

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	平成30年10月17日提出
<b>【発行者名】</b>	フィデリティ投信株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 チャック・マッケンジー
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都港区六本木七丁目7番7号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	照沼 加奈子
<b>【電話番号】</b>	03 - 4560 - 6000
<b>【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】</b>	フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き） フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）
<b>【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】</b>	各ファンドにつき2兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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致しましたので、平成30年4月18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とともに、その他の情報について訂正すべき事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

\_\_\_\_\_の部分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】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

< 訂正前 >

（略）

ファンドの基本的性格

（略）

（参考）ファンドの仕組み



ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、主として国内外債券等へ実質的に投資を行なう、「ファミリーファンド方式」です。

（略）

< 訂正後 >

（略）

ファンドの基本的性格

（略）

（参考）ファンドの仕組み



ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、主として国内外債券等へ実質的に投資を行なう、「ファミリーファンド方式」です。

（略）

##### （3）【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

（略）

委託会社の概況（2018年2月末日現在）

（略）

< 訂正後 >

（略）

委託会社の概況（2018年8月末日現在）

（略）

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

&lt;訂正前&gt;

(略)

ファンドのベンチマーク<sup>\*1</sup>

(略)

債券セクター	ベンチマーク	構成割合
(略)		
米国高利回り社債 (ハイ・イールド・ ボンド)	バンクオブアメリカ・メリルリンチ・USハイ・イールド・ コンストレインド・インデックス	40%
(略)		

(略)

運用方針

(a) ファンドの運用について

(略)

&lt;ファンドの投資対象債券セクター&gt;

(略)

好利回りの追求

債券セクター	概要	ベンチマーク	基本配分
米国高利回り社債 (ハイ・イールド・ ボンド)	格付機関によって、B a以下 (ムーディーズ社)またはB B 以下(S & P社)に格付けされ た社債および格付けを持たず にそれらと同等の信用力(債券の 元本、利息がどの程度確実に支 払われるか)と考えられる社 債。一般的に信用力が低いた め、利率が高く設定されていま す。	バンクオブアメリカ・ メリルリンチ・USハ イ・イールド・コンス トレインド・インデッ クス	40%

(略)

上記の文中で示された考え方は、2018年2月末日現在のものであり、今後、変更となる場合があります。

&lt;訂正後&gt;

(略)

ファンドのベンチマーク<sup>\*1</sup>

(略)

債券セクター	ベンチマーク	構成割合
(略)		
米国高利回り社債 (ハイ・イールド・ ボンド)	ICE バンクオブアメリカ・メリルリンチ・USハイ・イールド・ ド・コンストレインド・インデックス	40%
(略)		

(略)

## 運用方針

(a) ファンドの運用について

(略)

&lt; ファンドの投資対象債券セクター &gt;

(略)

## 好利回りの追求

債券セクター	概要	ベンチマーク	基本配分
米国高利回り社債 (ハイ・イールド ド・ボンド)	格付機関によって、B a以下 (ムーディーズ社)またはB B 以下(S & P社)に格付けされ た社債および格付けを持たず にそれらと同等の信用力(債券の 元本、利息がどの程度確実に支 払われるか)と考えられる社 債。一般的に信用力が低いた め、利率が高く設定されていま す。	ICE バンクオブアメリ カ・メリルリンチ・US ハイ・イールド・コン ストレインド・イン デックス	40%

(略)

上記の文中で示された考え方は、2018年8月末日現在のものであり、今後、変更となる場合があります。

### 3【投資リスク】

<訂正前>

（略）

以下は、ファンドのリスクを定量的に把握・比較できるように、参考情報として掲載しています。

## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

Aコース(為替ヘッジ付き)



Bコース(為替ヘッジなし)



- ※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2013年3月～2018年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。
- ※「ファンドの年間騰落率」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年間騰落率であり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。なお、当騰落率は目盛最大値に比べ値が小さいためにグラフが見えない場合があります。
- ※「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。

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

Aコース(為替ヘッジ付き)



Bコース(為替ヘッジなし)



- ※2013年3月～2018年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- ※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。
- ※ファンド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年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

【代表的な資産クラスの指数】

日本株	TOPIX(配当込)	東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数(TOPIX)の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、本商品の発行又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	MSCI コクサイ・インデックス(税引前配当金込/円ベース)	MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く先進国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他知的所有権はMSCI Inc.に帰属しております。
新興国株	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(税引前配当金込/円ベース)	MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した、エマージング諸国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他知的所有権はMSCI Inc.に帰属しております。
日本国債	NOMURA-BPI 国債	NOMURA-BPI 国債は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI 国債の知的財産権およびその他一切の権利は野村證券に帰属します。なお、野村證券株式会社はNOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて運用される当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	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	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。当指数の著作権はジェーピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属しております。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、指数提供元にて円換算しております。



<訂正後>

(略)

以下は、ファンドのリスクを定量的に把握・比較できるように、参考情報として掲載しています。

## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

Aコース(為替ヘッジ付き)



Bコース(為替ヘッジなし)



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2013年9月～2018年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

※「ファンドの年間騰落率」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年間騰落率であり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。なお、当騰落率は目盛最大値に比べ値が小さいためにグラフが見えない場合があります。

※「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。

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

Aコース(為替ヘッジ付き)



Bコース(為替ヘッジなし)



※2013年9月～2018年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※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。

※ファンド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年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

### 【代表的な資産クラスの指数】

日本株	TOPIX(配当込)	東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(旧東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数(TOPIX)の高標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、本商品の発行又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	MSCI コクサイ・インデックス(税引前配当込/円ベース)	MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く先進国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他知的所有権はMSCI Inc.に帰属しております。
新興国株	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(税引前配当込/円ベース)	MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した、エマージング諸国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他知的所有権はMSCI Inc.に帰属しております。
日本国債	NOMURA-BPI 国債	NOMURA-BPI 国債は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI 国債の知的財産権およびその他一切の権利は野村證券に帰属します。なお、野村證券株式会社はNOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて運用される当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	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	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。当指数の著作権はジェービー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属しております。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、指数提供元にて円換算しております。

#### 4【手数料等及び税金】

##### （５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、2018年2月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更となる場合があります。

（略）

<訂正後>

（略）

上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、2018年8月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更となる場合があります。

（略）

## 5【運用状況】

原届出書「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、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

Aコース（為替ヘッジ付き）

（2018年8月31日現在）

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	53,244,893,147	99.92
預金・その他の資産（負債控除後）	-	40,807,879	0.08
合計（純資産総額）		53,285,701,026	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。

その他資産の投資状況

（2018年8月31日現在）

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引（売建）	日本	52,233,228,160	98.02

（注）為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

Bコース（為替ヘッジなし）

（2018年8月31日現在）

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	6,939,743,576	100.05
預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,428,899	0.05
合計（純資産総額）		6,936,314,677	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）マザーファンドの投資状況

フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

（2018年8月31日現在）

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	226,436,479	0.34
	小計	226,436,479	0.34
新株予約権証券	アメリカ	17,339,686	0.03
	小計	17,339,686	0.03
国債証券	アメリカ	16,859,458,735	25.68
	ドイツ	2,043,582,037	3.11
	カナダ	1,574,596,135	2.40
	日本	1,566,526,300	2.39
	イタリア	1,558,024,661	2.37
	イギリス	1,547,191,564	2.36
	イスラエル	1,241,091,954	1.89
	ウクライナ	773,510,329	1.18
	スペイン	527,748,538	0.80
	トルコ	523,199,334	0.80
	アルゼンチン	520,981,905	0.79
	フランス	496,486,202	0.76
	レバノン	327,810,582	0.50
	インドネシア	301,183,464	0.46
	ロシア	294,159,291	0.45
	エジプト	252,670,318	0.38
	ブラジル	234,548,725	0.36
	ベトナム	185,893,473	0.28
	ヨルダン	179,916,270	0.27
	パキスタン	172,439,808	0.26
	ドミニカ共和国	155,663,206	0.24
	イラク	148,811,126	0.23
	エクアドル	104,921,159	0.16
	ヴェネズエラ	102,138,411	0.16
	スリランカ	94,622,132	0.14
	エルサルバドル	81,368,942	0.12
	コロンビア	75,391,693	0.11
	ベラルーシ	67,829,317	0.10
	ポルトガル	63,008,267	0.10
	ケニア	45,159,995	0.07
	モンゴル	42,660,145	0.06
	アルメニア	42,135,606	0.06
南アフリカ	40,564,143	0.06	
カメルーン	37,139,436	0.06	
メキシコ	30,447,654	0.05	

	ガボン	29,318,396	0.04
	ルワンダ	26,213,153	0.04
	オマーン	24,544,899	0.04
	コートジボアール	23,259,213	0.04
	ガーナ	21,810,185	0.03
	アンゴラ	20,753,593	0.03
	ナイジェリア	17,271,229	0.03
	ウルグアイ	15,046,964	0.02
	セネガル	14,363,723	0.02
	コスタリカ	12,894,066	0.02
	バルバドス	10,994,940	0.02
	モロッコ	6,140,307	0.01
	小計	32,535,491,525	49.55
地方債証券	アルゼンチン	384,784,062	0.59
	小計	384,784,062	0.59
特殊債券	アメリカ	1,330,523,129	2.03
	メキシコ	464,912,286	0.71
	アルゼンチン	105,812,415	0.16
	ヴェネズエラ	81,706,981	0.12
	ブラジル	65,262,854	0.10
	インドネシア	23,052,502	0.04
	チュニジア	14,565,297	0.02
	トルコ	12,901,229	0.02
	トリニダード トバゴ	11,712,787	0.02
	小計	2,110,449,480	3.21
社債券	アメリカ	19,223,058,522	29.28
	オランダ	1,391,299,652	2.12
	カナダ	1,344,008,994	2.05
	ルクセンブルグ	1,228,828,201	1.87
	イギリス	742,679,444	1.13
	マーシャル諸島	631,159,089	0.96
	フランス	387,198,390	0.59
	ケイマン諸島	339,297,868	0.52
	アルゼンチン	272,082,562	0.41
	ナイジェリア	186,573,526	0.28
	ブラジル	165,419,122	0.25
	アイルランド	162,987,158	0.25
	バミューダ	151,616,752	0.23
	メキシコ	127,437,330	0.19
	バングラディシュ	109,918,581	0.17
	日本	106,141,852	0.16
	トルコ	84,110,197	0.13
	ロシア	66,356,923	0.10

	グルジア	65,600,765	0.10
	オーストラリア	56,539,258	0.09
	モンゴル	53,566,259	0.08
	アゼルバイジャン	53,241,997	0.08
	イタリア	49,140,235	0.07
	ジャージー	32,580,128	0.05
	インドネシア	30,707,340	0.05
	グアテマラ	29,760,348	0.05
	スイス	24,952,406	0.04
	オーストリア	23,707,656	0.04
	ドミニカ共和国	20,190,708	0.03
	バーレーン	19,614,951	0.03
	ウクライナ	16,901,888	0.03
	カザフスタン	15,592,824	0.02
	小計	27,212,270,926	41.44
預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,174,771,075	4.84
合計（純資産総額）		65,661,543,233	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。

#### その他資産の投資状況

（2018年8月31日現在）

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引（売建）	日本	108,392,182	0.17
貸付債権	アメリカ	554,706,130	0.84

（注1）為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

（注2）貸付債権の時価については、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## Aコース(為替ヘッジ付き)

(2018年8月31日現在)

順位	種類	銘柄名	国名	数量 (口数)	帳簿価 額単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	親投資 信託受 益証券	フィデリティ・スト ラテジック・インカ ム・マザーファンド	日本	18,402,824,853	2.8723	52,858,433,934	2.8933	53,244,893,147	99.92

## Bコース(為替ヘッジなし)

(2018年8月31日現在)

順位	種類	銘柄名	国名	数量 (口数)	帳簿価 額単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	親投資 信託受 益証券	フィデリティ・スト ラテジック・インカ ム・マザーファンド	日本	2,398,556,519	2.8723	6,889,479,370	2.8933	6,939,743,576	100.05

## 種類別投資比率

## Aコース(為替ヘッジ付き)

(2018年8月31日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.92

## Bコース(為替ヘッジなし)

(2018年8月31日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.05



## （参考）マザーファンドの投資有価証券の主要銘柄

## フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

（2018年8月31日現在）

順位	銘柄名	通貨 地域	種類	数量	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 時価金額(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率 (%)
1	USTN 2% 01/15/21	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	15,481,000	10,934.63 1,692,790,754	10,929.86 1,692,051,447	2.000 2021/01/15	2.58
2	USTN 1.5% 7/15/20	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	12,608,000	10,876.43 1,371,301,426	10,873.88 1,370,979,370	1.500 2020/07/15	2.09
3	323 10年国債	日本・円 日本	国債証券	1,270,000,000	103.82 1,318,514,000	103.73 1,317,358,300	0.900 2022/06/20	2.01
4	AID 5.5% 9/18/23	アメリカ・ドル イスラエル	国債証券	9,969,000	12,447.38 1,240,879,579	12,439.50 1,240,093,497	5.500 2023/09/18	1.89
5	USTN 2.75% 06/30/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	10,243,000	11,062.13 1,133,094,109	11,056.47 1,132,513,939	2.750 2025/06/30	1.72
6	USTN 2.25% 07/31/21	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	10,200,000	10,967.95 1,118,731,146	10,960.18 1,117,938,178	2.250 2021/07/31	1.70
7	CANADA GOVT 0.75% 05/01/19	カナダ・ドル カナダ	国債証券	12,660,000	8,481.01 1,073,696,772	8,484.78 1,074,172,874	0.750 2019/05/01	1.64
8	GERMANY REP OF 0% 3/13/20 RGS	ユーロ ドイツ	国債証券	8,125,000	13,091.18 1,063,658,610	13,080.64 1,062,801,733	0.000 2020/03/13	1.62
9	USTB 3.625% 02/15/44	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	8,598,000	12,310.22 1,058,433,023	12,321.11 1,059,368,819	3.625 2044/02/15	1.61
10	UST NOTES 2% 07/31/2024	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	8,648,000	10,704.18 925,697,911	10,699.41 925,284,919	2.125 2024/07/31	1.41
11	USTB 6.125%	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	6,072,000	14,482.44 879,374,128	14,479.00 879,165,077	6.125 2029/08/15	1.34
12	GERMANY GOVT 0% 6/12/20 RGS	ユーロ ドイツ	国債証券	5,850,000	13,103.94 766,580,672	13,099.68 766,331,399	0.000 2020/06/12	1.17
13	USTN 2.25% 12/31/24	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	7,073,000	10,751.05 760,421,924	10,746.72 760,115,569	2.250 2024/12/31	1.16
14	USTN 2% 12/31/21	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	6,641,000	10,853.00 720,748,083	10,845.23 720,231,798	2.000 2021/12/31	1.10
15	UST NOTE 1.875% 03/31/22	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	6,670,000	10,786.25 719,443,425	10,777.48 718,858,217	1.875 2022/03/31	1.09
16	INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	アメリカ・ドル オランダ	社債券	5,770,000	11,064.35 638,413,139	11,028.26 636,330,486	7.000 2023/06/30	0.97
17	BUONI DEL TESOR 0.95% 3/1/23	ユーロ イタリア	国債証券	5,150,000	12,152.72 625,865,492	12,124.48 624,410,921	0.950 2023/03/01	0.95
18	UK GILT 4.25% 12/07/27	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	3,250,000	18,279.61 594,087,390	18,147.63 589,797,933	4.250 2027/12/07	0.90
19	APX GRP INC 8.75% 12/1/20 WI	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	4,992,000	11,078.23 553,025,491	11,106.00 554,411,520	8.750 2020/12/01	0.84
20	USTN 1.5% 10/31/19	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,936,000	10,972.72 541,613,854	10,975.84 541,767,347	1.500 2019/10/31	0.83
21	UK GILT 1.75% 22/07/2019 REGS	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	3,650,000	14,592.34 532,620,767	14,585.96 532,387,519	1.750 2019/07/22	0.81

22	SPAIN KINGDOM OF 1.4% 07/30/2	ユーロ スペイン	国債証券	4,100,000	12,952.63 531,057,889	12,871.92 527,748,537	1.400 2028/07/30	0.80
23	BUONI DEL TESORO POL 2% 2/1/28	ユーロ イタリア	国債証券	4,490,000	11,790.99 529,415,741	11,729.33 526,646,733	2.000 2028/02/01	0.80
24	ALTICE SA 7.75% 05/15/22 144A	アメリカ・ドル ルクセンブルグ	社債券	4,650,000	10,717.29 498,353,985	10,731.17 498,999,521	7.750 2022/05/15	0.76
25	UST NOTES 1.875% 1/31/22	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,543,000	10,800.14 490,650,394	10,792.70 490,312,349	1.875 2022/01/31	0.75
26	USTN 1.75% 06/30/22	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,374,000	10,711.18 468,507,087	10,703.41 468,167,044	1.750 2022/06/30	0.71
27	USTB 2.875% 8/15/45	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,265,000	10,812.69 461,161,251	10,826.13 461,734,393	2.875 2045/08/15	0.70
28	USTN 2.125% 12/31/22	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,229,000	10,843.11 458,555,130	10,818.80 457,527,002	2.125 2022/12/31	0.70
29	USTB 2.75% 08/15/47	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,268,000	10,520.26 449,005,104	10,543.70 450,005,253	2.750 2047/08/15	0.69
30	DENBURY RESOURCE 4.625 7/15/23	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	4,625,000	9,523.39 440,457,018	9,551.16 441,741,150	4.625 2023/07/15	0.67

(参考) マザーファンドの種類別および業種別投資比率  
 フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

(2018年8月31日現在)

種類	国内/外国	業種/種別	投資比率 (%)
株式	外国	素材	0.00
		運輸	0.06
		自動車・自動車部品	0.11
		公益事業	0.18
	小計		0.34
新株予約権証券	外国	-	0.03
	小計		0.03
公社債券	国内	国債証券	2.39
		社債券	0.16
	小計		2.55
	外国	国債証券	47.16
		地方債証券	0.59
		特殊債券	3.21
		社債券	41.28
	小計		92.24
合計(対純資産総額比)			95.16

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

Aコース(為替ヘッジ付き)

(2018年8月31日現在)

種類	名称等	買建/売建	数量	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	イギリス・ポンド	売建	8,956,000	1,277,049,474	1,293,515,080	2.43
	カナダ・ドル	売建	15,565,000	1,322,441,313	1,328,472,750	2.49
	ユーロ	売建	30,199,000	3,884,769,161	3,912,884,430	7.34
	アメリカ・ドル	売建	412,254,000	45,815,298,525	45,698,355,900	85.76

## Bコース(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価金額の比率をいいます。

(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考) マザーファンドのその他投資資産の主要なもの  
フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

(2018年8月31日現在)

種類	名称等	買建/売建	数量	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカ・ドル	売建	976,242	108,323,846	108,392,182	0.17
貸付債権	アメリカ・ドル	-	4,991,412.50	554,168,143	554,706,130	0.84

(注1) 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時価金額の比率をいいます。

(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(注3) 貸付債権の時価については、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。

## （ 3 ）【運用実績】

## 【純資産の推移】

2018年8月末日および同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次のとおりです。

## Aコース（為替ヘッジ付き）

年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり純資産額 (円) (分配落)	1口当たり純資産額 (円) (分配付)
2009年1月20日 (第21特定期間)	344	347	0.8251	0.8311
2009年7月21日 (第22特定期間)	375	378	0.8568	0.8628
2010年1月20日 (第23特定期間)	438	441	0.9033	0.9103
2010年7月20日 (第24特定期間)	729	735	0.8866	0.8936
2011年1月20日 (第25特定期間)	1,073	1,082	0.8728	0.8798
2011年7月20日 (第26特定期間)	1,437	1,447	0.8581	0.8636
2012年1月20日 (第27特定期間)	1,116	1,123	0.8418	0.8473
2012年7月20日 (第28特定期間)	2,273	2,289	0.8424	0.8484
2013年1月21日 (第29特定期間)	31,182	31,406	0.8320	0.8380
2013年7月22日 (第30特定期間)	185,900	187,324	0.7833	0.7893
2014年1月20日 (第31特定期間)	243,576	244,861	0.7583	0.7623
2014年7月22日 (第32特定期間)	222,359	223,531	0.7588	0.7628
2015年1月20日 (第33特定期間)	179,464	180,451	0.7276	0.7316
2015年7月21日 (第34特定期間)	143,717	144,531	0.7056	0.7096
2016年1月20日 (第35特定期間)	114,103	114,807	0.6487	0.6527
2016年7月20日 (第36特定期間)	100,945	101,537	0.6826	0.6866
2017年1月20日 (第37特定期間)	79,649	80,009	0.6634	0.6664
2017年7月20日 (第38特定期間)	71,081	71,402	0.6625	0.6655

2018年1月22日 (第39特定期間)	62,879	63,072	0.6493	0.6513
2018年7月20日 (第40特定期間)	55,034	55,210	0.6277	0.6297
2017年8月末日	69,458	-	0.6613	-
2017年9月末日	68,173	-	0.6587	-
2017年10月末日	66,823	-	0.6568	-
2017年11月末日	65,194	-	0.6536	-
2017年12月末日	63,803	-	0.6515	-
2018年1月末日	62,490	-	0.6477	-
2018年2月末日	60,994	-	0.6405	-
2018年3月末日	59,829	-	0.6382	-
2018年4月末日	58,392	-	0.6333	-
2018年5月末日	57,033	-	0.6305	-
2018年6月末日	55,583	-	0.6264	-
2018年7月末日	54,587	-	0.6269	-
2018年8月末日	53,285	-	0.6232	-

## Bコース(為替ヘッジなし)

年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり純資産額 (円) (分配落)	1口当たり純資産額 (円) (分配付)
2009年1月20日 (第21特定期間)	1,732	1,742	0.6489	0.6529
2009年7月21日 (第22特定期間)	1,849	1,858	0.7164	0.7199
2010年1月20日 (第23特定期間)	1,832	1,842	0.7474	0.7514
2010年7月20日 (第24特定期間)	1,678	1,688	0.7063	0.7103
2011年1月20日 (第25特定期間)	1,547	1,557	0.6741	0.6781
2011年7月20日 (第26特定期間)	1,422	1,431	0.6528	0.6568
2012年1月20日 (第27特定期間)	1,265	1,273	0.6202	0.6242
2012年7月20日 (第28特定期間)	1,290	1,298	0.6359	0.6399
2013年1月21日 (第29特定期間)	2,289	2,301	0.7192	0.7232
2013年7月22日 (第30特定期間)	8,214	8,257	0.7587	0.7627
2014年1月20日 (第31特定期間)	10,564	10,619	0.7739	0.7779
2014年7月22日 (第32特定期間)	10,855	10,912	0.7580	0.7620
2015年1月20日 (第33特定期間)	12,399	12,474	0.8332	0.8382
2015年7月21日 (第34特定期間)	13,115	13,192	0.8483	0.8533
2016年1月20日 (第35特定期間)	11,021	11,096	0.7353	0.7403
2016年7月20日 (第36特定期間)	9,137	9,202	0.7012	0.7062
2017年1月20日 (第37特定期間)	8,678	8,738	0.7345	0.7395
2017年7月20日 (第38特定期間)	8,066	8,123	0.7136	0.7186
2018年1月22日 (第39特定期間)	7,617	7,672	0.6878	0.6928
2018年7月20日 (第40特定期間)	7,146	7,200	0.6602	0.6652
2017年8月末日	7,862	-	0.7036	-
2017年9月末日	7,940	-	0.7145	-

2017年10月末日	7,852	-	0.7121	-
2017年11月末日	7,824	-	0.7007	-
2017年12月末日	7,826	-	0.7036	-
2018年1月末日	7,409	-	0.6757	-
2018年2月末日	7,495	-	0.6558	-
2018年3月末日	7,304	-	0.6455	-
2018年4月末日	7,340	-	0.6560	-
2018年5月末日	7,171	-	0.6453	-
2018年6月末日	7,071	-	0.6489	-
2018年7月末日	7,018	-	0.6512	-
2018年8月末日	6,936	-	0.6456	-



## 【分配の推移】

## Aコース（為替ヘッジ付き）

期	1口当たりの分配金(円)
第21特定期間（116期～121期計算期間合計）	0.0340
第22特定期間（122期～127期計算期間合計）	0.0360
第23特定期間（128期～133期計算期間合計）	0.0400
第24特定期間（134期～139期計算期間合計）	0.0420
第25特定期間（140期～145期計算期間合計）	0.0420
第26特定期間（146期～151期計算期間合計）	0.0405
第27特定期間（152期～157期計算期間合計）	0.0330
第28特定期間（158期～163期計算期間合計）	0.0360
第29特定期間（164期～169期計算期間合計）	0.0360
第30特定期間（170期～175期計算期間合計）	0.0360
第31特定期間（176期～181期計算期間合計）	0.0320
第32特定期間（182期～187期計算期間合計）	0.0240
第33特定期間（188期～193期計算期間合計）	0.0240
第34特定期間（194期～199期計算期間合計）	0.0240
第35特定期間（200期～205期計算期間合計）	0.0240
第36特定期間（206期～211期計算期間合計）	0.0240
第37特定期間（212期～217期計算期間合計）	0.0210
第38特定期間（218期～223期計算期間合計）	0.0180
第39特定期間（224期～229期計算期間合計）	0.0140
第40特定期間（230期～235期計算期間合計）	0.0120

## Bコース（為替ヘッジなし）

期	1口当たりの分配金(円)
第21特定期間（116期～121期計算期間合計）	0.0240
第22特定期間（122期～127期計算期間合計）	0.0230
第23特定期間（128期～133期計算期間合計）	0.0230
第24特定期間（134期～139期計算期間合計）	0.0240
第25特定期間（140期～145期計算期間合計）	0.0240
第26特定期間（146期～151期計算期間合計）	0.0240
第27特定期間（152期～157期計算期間合計）	0.0240
第28特定期間（158期～163期計算期間合計）	0.0240
第29特定期間（164期～169期計算期間合計）	0.0240
第30特定期間（170期～175期計算期間合計）	0.0240
第31特定期間（176期～181期計算期間合計）	0.0240
第32特定期間（182期～187期計算期間合計）	0.0240
第33特定期間（188期～193期計算期間合計）	0.0270
第34特定期間（194期～199期計算期間合計）	0.0300
第35特定期間（200期～205期計算期間合計）	0.0300
第36特定期間（206期～211期計算期間合計）	0.0300
第37特定期間（212期～217期計算期間合計）	0.0300
第38特定期間（218期～223期計算期間合計）	0.0300
第39特定期間（224期～229期計算期間合計）	0.0300
第40特定期間（230期～235期計算期間合計）	0.0300

## 【収益率の推移】

## Aコース（為替ヘッジ付き）

期	収益率(%)
第21特定期間（116期～121期計算期間合計）	6.3
第22特定期間（122期～127期計算期間合計）	8.2
第23特定期間（128期～133期計算期間合計）	10.1
第24特定期間（134期～139期計算期間合計）	2.8
第25特定期間（140期～145期計算期間合計）	3.2
第26特定期間（146期～151期計算期間合計）	3.0
第27特定期間（152期～157期計算期間合計）	1.9
第28特定期間（158期～163期計算期間合計）	4.3
第29特定期間（164期～169期計算期間合計）	3.0
第30特定期間（170期～175期計算期間合計）	1.5
第31特定期間（176期～181期計算期間合計）	0.9
第32特定期間（182期～187期計算期間合計）	3.2
第33特定期間（188期～193期計算期間合計）	0.9
第34特定期間（194期～199期計算期間合計）	0.3
第35特定期間（200期～205期計算期間合計）	4.7
第36特定期間（206期～211期計算期間合計）	8.9
第37特定期間（212期～217期計算期間合計）	0.3
第38特定期間（218期～223期計算期間合計）	2.6
第39特定期間（224期～229期計算期間合計）	0.1
第40特定期間（230期～235期計算期間合計）	1.5

## Bコース（為替ヘッジなし）

期	収益率(%)
第21特定期間（116期～121期計算期間合計）	20.9
第22特定期間（122期～127期計算期間合計）	13.9
第23特定期間（128期～133期計算期間合計）	7.5
第24特定期間（134期～139期計算期間合計）	2.3
第25特定期間（140期～145期計算期間合計）	1.2
第26特定期間（146期～151期計算期間合計）	0.4
第27特定期間（152期～157期計算期間合計）	1.3
第28特定期間（158期～163期計算期間合計）	6.4
第29特定期間（164期～169期計算期間合計）	16.9
第30特定期間（170期～175期計算期間合計）	8.8
第31特定期間（176期～181期計算期間合計）	5.2
第32特定期間（182期～187期計算期間合計）	1.0
第33特定期間（188期～193期計算期間合計）	13.5
第34特定期間（194期～199期計算期間合計）	5.4
第35特定期間（200期～205期計算期間合計）	9.8
第36特定期間（206期～211期計算期間合計）	0.6
第37特定期間（212期～217期計算期間合計）	9.0
第38特定期間（218期～223期計算期間合計）	1.2
第39特定期間（224期～229期計算期間合計）	0.6
第40特定期間（230期～235期計算期間合計）	0.3

（注）収益率とは、各特定期間末の基準価額（分配付）から前特定期間末の基準価額（分配落）を控除した額を前特定期間末の基準価額（分配落）で除して得た数に100を乗じて得た数字です。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## （４）【設定及び解約の実績】

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数量は次のとおりです。

## Aコース（為替ヘッジ付き）

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第21特定期間 (2008年7月23日～2009年1月20日)	7,727,031	18,872,063	417,682,153
第22特定期間 (2009年1月21日～2009年7月21日)	33,412,326	12,970,083	438,124,396
第23特定期間 (2009年7月22日～2010年1月20日)	81,074,878	34,124,786	485,074,488
第24特定期間 (2010年1月21日～2010年7月20日)	410,594,707	72,784,202	822,884,993
第25特定期間 (2010年7月21日～2011年1月20日)	550,181,722	143,213,845	1,229,852,870
第26特定期間 (2011年1月21日～2011年7月20日)	673,360,340	227,408,219	1,675,804,991
第27特定期間 (2011年7月21日～2012年1月20日)	289,992,304	639,456,056	1,326,341,239
第28特定期間 (2012年1月21日～2012年7月20日)	1,848,841,716	476,914,630	2,698,268,325
第29特定期間 (2012年7月21日～2013年1月21日)	35,614,303,030	834,470,520	37,478,100,835
第30特定期間 (2013年1月22日～2013年7月22日)	207,720,317,789	7,858,662,665	237,339,755,959
第31特定期間 (2013年7月23日～2014年1月20日)	103,054,822,532	19,171,017,287	321,223,561,204
第32特定期間 (2014年1月21日～2014年7月22日)	5,734,683,340	33,898,897,608	293,059,346,936
第33特定期間 (2014年7月23日～2015年1月20日)	3,499,306,575	49,916,272,734	246,642,380,777
第34特定期間 (2015年1月21日～2015年7月21日)	3,596,247,688	46,561,253,127	203,677,375,338
第35特定期間 (2015年7月22日～2016年1月20日)	2,226,982,240	29,997,608,732	175,906,748,846
第36特定期間 (2016年1月21日～2016年7月20日)	2,455,253,194	30,468,076,524	147,893,925,516
第37特定期間 (2016年7月21日～2017年1月20日)	4,724,528,557	32,556,241,247	120,062,212,826
第38特定期間 (2017年1月21日～2017年7月20日)	1,990,275,525	14,764,073,453	107,288,414,898
第39特定期間 (2017年7月21日～2018年1月22日)	1,684,150,435	12,137,892,490	96,834,672,843
第40特定期間 (2018年1月23日～2018年7月20日)	1,085,851,077	10,244,484,814	87,676,039,106

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

## Bコース(為替ヘッジなし)

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第21特定期間 (2008年7月23日～2009年1月20日)	14,473,059	145,830,122	2,668,975,243
第22特定期間 (2009年1月21日～2009年7月21日)	15,727,825	103,427,009	2,581,276,059
第23特定期間 (2009年7月22日～2010年1月20日)	22,283,648	151,674,518	2,451,885,189
第24特定期間 (2010年1月21日～2010年7月20日)	37,021,716	112,024,451	2,376,882,454
第25特定期間 (2010年7月21日～2011年1月20日)	55,295,207	135,897,958	2,296,279,703
第26特定期間 (2011年1月21日～2011年7月20日)	177,636,827	294,654,373	2,179,262,157
第27特定期間 (2011年7月21日～2012年1月20日)	71,064,657	210,032,661	2,040,294,153
第28特定期間 (2012年1月21日～2012年7月20日)	354,385,919	365,547,403	2,029,132,669
第29特定期間 (2012年7月21日～2013年1月21日)	1,485,014,674	331,251,739	3,182,895,604
第30特定期間 (2013年1月22日～2013年7月22日)	8,735,735,391	1,091,443,165	10,827,187,830
第31特定期間 (2013年7月23日～2014年1月20日)	4,921,358,277	2,096,763,116	13,651,782,991
第32特定期間 (2014年1月21日～2014年7月22日)	3,122,846,363	2,452,692,794	14,321,936,560
第33特定期間 (2014年7月23日～2015年1月20日)	4,095,213,340	3,535,550,986	14,881,598,914
第34特定期間 (2015年1月21日～2015年7月21日)	3,291,320,164	2,712,129,314	15,460,789,764
第35特定期間 (2015年7月22日～2016年1月20日)	1,895,711,296	2,367,878,050	14,988,623,010
第36特定期間 (2016年1月21日～2016年7月20日)	637,630,281	2,594,815,506	13,031,437,785
第37特定期間 (2016年7月21日～2017年1月20日)	1,066,001,308	2,281,243,506	11,816,195,587
第38特定期間 (2017年1月21日～2017年7月20日)	1,058,355,864	1,571,046,562	11,303,504,889
第39特定期間 (2017年7月21日～2018年1月22日)	1,051,981,323	1,280,119,063	11,075,367,149
第40特定期間 (2018年1月23日～2018年7月20日)	997,351,639	1,247,612,287	10,825,106,501

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## &lt; 参考情報 &gt;

(2018年8月31日現在)

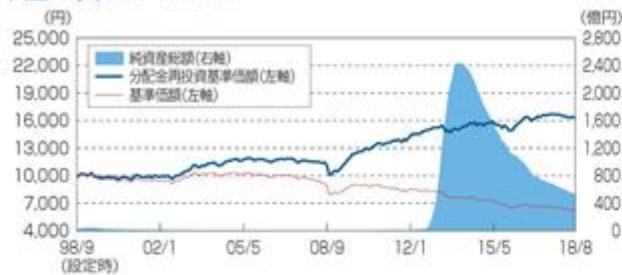
※運用実績等について別途月次等で適時開示している場合があります。この場合、委託会社のホームページにおいて閲覧できます。

※下記データは過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

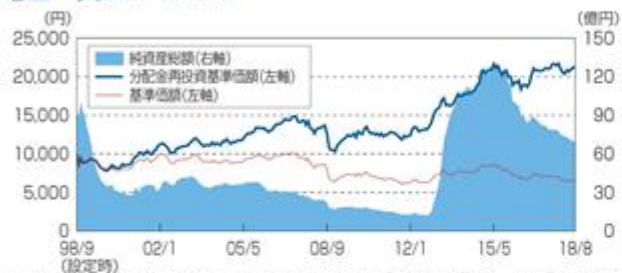
※各々のグラフ、表にある比率は、それぞれの項目を四捨五入して表示しています。

## 基準価額・純資産の推移

## Aコース(為替ヘッジ付き)



## Bコース(為替ヘッジなし)



※分配金再投資基準価額は、ファンド設定時に10,000円でスタートしてからの分配金を再投資した実績評価額です。ただし、購入時手数料および分配金にかかる税金は考慮していません。

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

## 主要な資産の状況(マザーファンド)

## 資産別組入状況

債券等	95.6%
株式	0.3%
新株予約権証券(ワラント)	0.0%
現金・その他	4.0%

## 組入上位10銘柄

銘柄	クーポン	償還日	格付	比率
1 米国国債	2%	2021/1/15	AA/Aa	2.6%
2 米国国債	1.5%	2020/7/15	AA/Aa	2.1%
3 第323回 10年国債	0.9%	2022/6/20	A	2.0%
4 米国政府保証債	5.5%	2023/9/18	AA/Aa	1.9%
5 米国国債	2.75%	2025/6/30	AA/Aa	1.7%
6 米国国債	2.25%	2021/7/31	AA/Aa	1.7%
7 カナダ国債	0.75%	2019/5/1	AAA/Aaa	1.6%
8 ドイツ国債	0%	2020/3/13	AAA/Aaa	1.6%
9 米国国債	3.625%	2044/2/15	AA/Aa	1.6%
10 米国国債	2%	2024/7/31	AA/Aa	1.4%

## 国別組入状況

アメリカ	58.2%
カナダ	4.4%
イギリス	3.5%
ドイツ	3.1%
日本	2.5%
イタリア	2.4%
オランダ	2.1%
アルゼンチン	2.0%
イスラエル	1.9%
その他	15.8%

## 格付別組入状況(対投資債券比率)

AAA/Aaa	5.8%
AA/Aa	34.2%
A	3.4%
BBB/Baa	6.4%
BB/Ba	16.1%
B	24.7%
CCC/Caa	8.0%
CC/Ca以下	0.7%
格付なし	0.8%

## 通貨別組入状況(対投資資産比率)

アメリカドル	85.1%
ユーロ	7.4%
カナダドル	2.5%
日本円	2.5%
イギリスポンド	2.5%

## 組入債券種別内訳(対投資資産比率)

米国国債・政府機関債	31.1%
ハイ・イールド・ボンド	40.6%
先進国債券(除く米国)	14.9%
エマージング債券	13.4%

※別途記載がない限り、主要な資産の状況は対純資産総額比率です。

※未払金等の発生により、「現金・その他」の数値がマイナスになることがあります。

※債券等には、金銭債権が含まれます。

※銘柄はご参考のため、英文表記の一部をカタカナで表記しております。実際の発行体名と異なる場合があります。

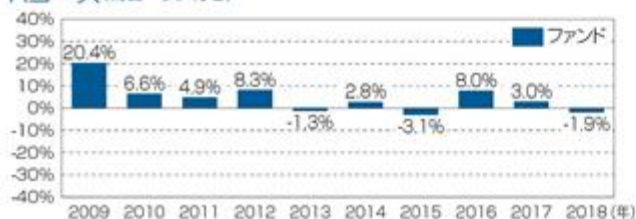
※クーポンは、銘柄属性として発行時に定められたものを表示しております。

※格付は、S&P社もしくはムーディーズ社による格付を採用し、S&P社の格付を優先して採用しています。「プラス/マイナス」の符号は省略しています。なお、両社による格付のない場合は、「格付なし」に分類しています。

※国は発行国を表示しています。

## 年間収益率の推移

## Aコース(為替ヘッジ付き)



※Aコース(為替ヘッジ付き)は、ベンチマークを設定しておりません。

※ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして算出しています。

※2018年は年初以降8月末までの実績となります。

## Bコース(為替ヘッジなし)



### 第3【ファンドの経理状況】

原届出書「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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）ならびに同規則第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。

ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

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40特定期間（平成30年1月23日から平成30年7月20日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。



## 1【財務諸表】

## 【フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第39特定期間 平成30年1月22日現在	第40特定期間 平成30年7月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	3,307,985	2,520,033
親投資信託受益証券	62,257,037,555	56,349,379,020
派生商品評価勘定	744,934,588	-
未収入金	407,332,040	436,547,699
流動資産合計	63,412,612,168	56,788,446,752
資産合計	63,412,612,168	56,788,446,752
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	160,114,630	1,335,291,374
未払金	2,039,461	-
未払収益分配金	193,669,345	175,352,078
未払解約金	82,552,449	166,710,381
未払受託者報酬	3,113,376	2,468,013
未払委託者報酬	85,929,377	68,117,364
その他未払費用	5,948,415	5,708,271
流動負債合計	533,367,053	1,753,647,481
負債合計	533,367,053	1,753,647,481
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	96,834,672,843	87,676,039,106
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	33,955,427,728	32,641,239,835
（分配準備積立金）	6,198,621	252,831,828
元本等合計	62,879,245,115	55,034,799,271
純資産合計	62,879,245,115	55,034,799,271
負債純資産合計	63,412,612,168	56,788,446,752

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第39特定期間		第40特定期間	
	自	平成29年7月21日 平成30年1月22日	自	平成30年1月23日 平成30年7月20日
<b>営業収益</b>				
受取利息		114		109
有価証券売買等損益		998,039,463		581,804,290
為替差損益		368,231,769		1,058,172,277
<b>営業収益合計</b>		<b>629,807,808</b>		<b>476,367,878</b>
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		18,488,846		15,579,045
委託者報酬		510,293,194		429,982,795
その他費用		5,959,215		5,708,271
<b>営業費用合計</b>		<b>534,741,255</b>		<b>451,270,111</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>95,066,553</b>		<b>927,637,989</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>		<b>95,066,553</b>		<b>927,637,989</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>95,066,553</b>		<b>927,637,989</b>
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（ ）		5,184,747		6,435,205
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>36,207,343,306</b>		<b>33,955,427,728</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>4,162,773,259</b>		<b>3,731,389,346</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,162,773,259		3,731,389,346
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>575,579,349</b>		<b>395,455,561</b>
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		575,579,349		395,455,561
<b>分配金</b>		<b>1,425,160,138</b>		<b>1,100,543,108</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>33,955,427,728</b>		<b>32,641,239,835</b>

## （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．デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間の取扱い ファンドの特定期間は前期末日および翌日が休日のため、平成30年1月23日から平成30年7月20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39特定期間 平成30年1月22日現在	第40特定期間 平成30年7月20日現在
1．元本の推移		
期首元本額	107,288,414,898 円	96,834,672,843 円
期中追加設定元本額	1,684,150,435 円	1,085,851,077 円
期中一部解約元本額	12,137,892,490 円	10,244,484,814 円
2．受益権の総数	96,834,672,843 口	87,676,039,106 口
3．元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回っている場合におけるその差額	33,955,427,728 円	32,641,239,835 円
4．1口当たり純資産額	0.6493 円	0.6277 円

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第39特定期間 自 平成29年 7月21日 至 平成30年 1月22日</p>	<p style="text-align: center;">第40特定期間 自 平成30年 1月23日 至 平成30年 7月20日</p>
<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.35%以内の額</p>	<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左</p>
<p>2．分配金の計算過程 （自平成29年 7月21日 至平成29年 8月21日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（180,074,316円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（3,438,421,854円）及び分配準備積立金（6,833,526円）より分配対象収益は3,625,329,696円（1口当たり0.034378円）であり、うち316,361,880円（1口当たり0.003000円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成29年 8月22日 至平成29年 9月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（189,833,741円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（3,262,645,997円）及び分配準備積立金（6,731,978円）より分配対象収益は3,459,211,716円（1口当たり0.033204円）であり、うち312,543,695円（1口当たり0.003000円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成29年 9月21日 至平成29年10月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（161,789,137円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（3,080,867,602円）及び分配準備積立金（6,583,484円）より分配対象収益は3,249,240,223円（1口当たり0.031791円）であり、うち204,413,166円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p>	<p>2．分配金の計算過程 （自平成30年 1月23日 至平成30年 2月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（123,322,634円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,736,000,966円）及び分配準備積立金（6,107,724円）より分配対象収益は2,865,431,324円（1口当たり0.029986円）であり、うち191,115,761円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成30年 2月21日 至平成30年 3月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（456,148,722円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,628,828,598円）及び分配準備積立金（6,008,846円）より分配対象収益は3,090,986,166円（1口当たり0.032835円）であり、うち188,274,901円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成30年 3月21日 至平成30年 4月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（151,487,452円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,584,957,480円）及び分配準備積立金（268,250,343円）より分配対象収益は3,004,695,275円（1口当たり0.032476円）であり、うち185,038,318円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p>

(自平成29年10月21日 至平成29年11月20日)  
計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(160,976,761円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,986,538,070円)及び分配準備積立金(6,454,409円)より分配対象収益は3,153,969,240円(1口当たり0.031396円)であり、うち200,912,772円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自平成29年11月21日 至平成29年12月20日)  
計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(172,420,009円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,893,227,096円)及び分配準備積立金(6,325,957円)より分配対象収益は3,071,973,062円(1口当たり0.031147円)であり、うち197,259,280円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自平成29年12月21日 至平成30年1月22日)  
計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(149,698,734円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,816,391,323円)及び分配準備積立金(6,198,621円)より分配対象収益は2,972,288,678円(1口当たり0.030694円)であり、うち193,669,345円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自平成30年4月21日 至平成30年5月21日)  
計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(155,781,767円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,510,842,277円)及び分配準備積立金(263,577,498円)より分配対象収益は2,930,201,542円(1口当たり0.032189円)であり、うち182,060,980円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自平成30年5月22日 至平成30年6月20日)  
計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(136,223,161円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,439,479,662円)及び分配準備積立金(258,135,984円)より分配対象収益は2,833,838,807円(1口当たり0.031716円)であり、うち178,701,070円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自平成30年6月21日 至平成30年7月20日)  
計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(148,287,101円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,352,727,035円)及び分配準備積立金(252,831,828円)より分配対象収益は2,753,845,964円(1口当たり0.031409円)であり、うち175,352,078円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドおよび主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権および金銭債務であり、その内容を当ファンドおよび親投資信託受益証券の貸借対照表、有価証券に関する注記、デリバティブ取引に関する注記および附属明細表に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、為替変動リスク、価格変動リスクの回避および信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的としております。</p> <p>当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク等があります。</p>
3．金融商品に係るリスク管理体制	投資リスクの管理および投資行動のチェックについては、運用部門が自ら行う方法と運用部門から独立したコンプライアンス部門が行う方法を併用し検証しています。

## ．金融商品の時価等に関する事項

1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2．時価の算定方法	<p>（１）有価証券          売買目的有価証券          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」に記載しております。</p> <p>（２）デリバティブ取引          「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>（３）上記以外の金融商品          短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。</p> <p>当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第39特定期間 平成30年 1月22日現在	第40特定期間 平成30年 7月20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	712,111,401	1,616,760,155
合 計	712,111,401	1,616,760,155

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

種類	第39特定期間 平成30年 1月22日 現在			第40特定期間 平成30年 7月20日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 以外の取 引								
為替予 約取引								
売建	61,597,371,278	-	61,012,551,320	584,819,958	53,559,967,376	-	54,895,258,750	1,335,291,374
アメリ カ・ド ル	53,510,414,828	-	52,765,480,240	744,934,588	46,766,680,913	-	47,943,519,030	1,176,838,117
イギリ ス・ポ ンド	1,603,935,552	-	1,637,105,880	33,170,328	1,351,748,884	-	1,358,850,470	7,101,586
カナ ダ・ド ル	1,657,366,936	-	1,682,082,240	24,715,304	1,342,553,763	-	1,380,085,250	37,531,487
ユーロ	4,825,653,962	-	4,927,882,960	102,228,998	4,098,983,816	-	4,212,804,000	113,820,184
合計	61,597,371,278	-	61,012,551,320	584,819,958	53,559,967,376	-	54,895,258,750	1,335,291,374

## （注1）時価の算定方法

1. 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

（1）予約為替の受渡し日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。

(2) 当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに算出したレートにより評価しております。

当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値により評価しております。

2. 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客相場の仲値により評価しております。

(注2) デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておられません。

(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。

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(ア) 株式

該当事項はありません。

(イ) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド	19,225,308,434	56,349,379,020	
親投資信託受益証券 合計		19,225,308,434	56,349,379,020	
合計		19,225,308,434	56,349,379,020	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額の数値は証券数を表示しております。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



## 【フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース(為替ヘッジなし)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第39特定期間 平成30年1月22日現在	第40特定期間 平成30年7月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	11,328,652	5,731,693
親投資信託受益証券	7,610,956,890	7,140,627,901
未収入金	80,435,321	78,410,230
流動資産合計	7,702,720,863	7,224,769,824
<b>資産合計</b>		
7,702,720,863		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	55,376,835	54,125,532
未払解約金	18,051,136	14,096,560
未払受託者報酬	380,474	315,946
未払委託者報酬	10,501,180	8,720,307
その他未払費用	914,283	905,590
流動負債合計	85,223,908	78,163,935
<b>負債合計</b>		
85,223,908		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	11,075,367,149	10,825,106,501
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,457,870,194	3,678,500,612
(分配準備積立金)	597,763,128	534,233,127
元本等合計	7,617,496,955	7,146,605,889
<b>純資産合計</b>		
7,617,496,955		
<b>負債純資産合計</b>		
7,702,720,863		

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第39特定期間 自 平成29年 7月21日 至 平成30年 1月22日	第40特定期間 自 平成30年 1月23日 至 平成30年 7月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	25	29
有価証券売買等損益	109,108,638	84,440,056
営業収益合計	109,108,663	84,440,085
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	2,169,165	1,935,297
委託者報酬	59,869,933	53,415,531
その他費用	914,283	905,590
営業費用合計	62,953,381	56,256,418
営業利益又は営業損失（ ）	46,155,282	28,183,667
経常利益又は経常損失（ ）	46,155,282	28,183,667
当期純利益又は当期純損失（ ）	46,155,282	28,183,667
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（ ）	1,795,919	825,915
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,236,991,109	3,457,870,194
剰余金増加額又は欠損金減少額	377,692,326	427,202,789
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	377,692,326	427,202,789
剰余金減少額又は欠損金増加額	308,939,440	342,463,392
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	308,939,440	342,463,392
分配金	333,991,334	334,379,397
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,457,870,194	3,678,500,612

## （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本となる重要な事項	特定期間の取扱い ファンドの特定期間は前期末日および翌日が休日のため、平成30年1月23日から平成30年7月20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39特定期間 平成30年1月22日現在	第40特定期間 平成30年7月20日現在
1．元本の推移 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	11,303,504,889 円 1,051,981,323 円 1,280,119,063 円	11,075,367,149 円 997,351,639 円 1,247,612,287 円
2．受益権の総数	11,075,367,149 口	10,825,106,501 口
3．元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っている場合におけるその差額	3,457,870,194 円	3,678,500,612 円
4．1口当たり純資産額	0.6878 円	0.6602 円

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第39特定期間 自 平成29年 7月21日 至 平成30年 1月22日</p>	<p style="text-align: center;">第40特定期間 自 平成30年 1月23日 至 平成30年 7月20日</p>
<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.35%以内の額</p>	<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左</p>
<p>2．分配金の計算過程 （自平成29年 7月21日 至平成29年 8月21日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（20,466,892円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（632,653,851円）及び分配準備積立金（659,314,961円）より分配対象収益は1,312,435,704円（1口当たり0.116853円）であり、うち56,157,555円（1口当たり0.005000円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成29年 8月22日 至平成29年 9月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（26,965,889円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（596,003,395円）及び分配準備積立金（648,842,998円）より分配対象収益は1,271,812,282円（1口当たり0.114285円）であり、うち55,641,895円（1口当たり0.005000円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成29年 9月21日 至平成29年10月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（25,872,833円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（574,854,243円）及び分配準備積立金（636,492,005円）より分配対象収益は1,237,219,081円（1口当たり0.111644円）であり、うち55,409,341円（1口当たり0.005000円）を分配金額としております。</p>	<p>2．分配金の計算過程 （自平成30年 1月23日 至平成30年 2月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（15,594,506円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（530,328,636円）及び分配準備積立金（583,187,305円）より分配対象収益は1,129,110,447円（1口当たり0.099059円）であり、うち56,991,904円（1口当たり0.005000円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成30年 2月21日 至平成30年 3月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（56,365,250円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（491,474,653円）及び分配準備積立金（577,424,099円）より分配対象収益は1,125,264,002円（1口当たり0.099031円）であり、うち56,813,789円（1口当たり0.005000円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成30年 3月21日 至平成30年 4月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（26,183,930円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（487,353,380円）及び分配準備積立金（564,491,536円）より分配対象収益は1,078,028,846円（1口当たり0.096380円）であり、うち55,925,907円（1口当たり0.005000円）を分配金額としております。</p>

(自平成29年10月21日 至平成29年11月20日)  
計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(19,258,893円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(562,182,230円)及び分配準備積立金(624,393,254円)より分配対象収益は1,205,834,377円(1口当たり0.108411円)であり、うち55,614,247円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自平成29年11月21日 至平成29年12月20日)  
計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(27,410,720円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(538,263,953円)及び分配準備積立金(615,907,430円)より分配対象収益は1,181,582,103円(1口当たり0.105893円)であり、うち55,791,461円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自平成29年12月21日 至平成30年1月22日)  
計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(18,646,937円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(520,054,196円)及び分配準備積立金(597,763,128円)より分配対象収益は1,136,464,261円(1口当たり0.102612円)であり、うち55,376,835円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自平成30年4月21日 至平成30年5月21日)  
計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(27,032,602円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(458,665,207円)及び分配準備積立金(557,482,265円)より分配対象収益は1,043,180,074円(1口当たり0.093821円)であり、うち55,593,964円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自平成30年5月22日 至平成30年6月20日)  
計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(17,103,831円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(428,971,255円)及び分配準備積立金(546,883,188円)より分配対象収益は992,958,274円(1口当たり0.090387円)であり、うち54,928,301円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自平成30年6月21日 至平成30年7月20日)  
計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(24,797,687円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(390,223,117円)及び分配準備積立金(534,233,127円)より分配対象収益は949,253,931円(1口当たり0.087690円)であり、うち54,125,532円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドおよび主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権および金銭債務であり、その内容を当ファンドおよび親投資信託受益証券の貸借対照表、有価証券に関する注記、デリバティブ取引に関する注記および附属明細表に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、為替変動リスク、価格変動リスクの回避および信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的としております。</p> <p>当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク等があります。</p>
3．金融商品に係るリスク管理体制	投資リスクの管理および投資行動のチェックについては、運用部門が自ら行う方法と運用部門から独立したコンプライアンス部門が行う方法を併用し検証しています。

## ．金融商品の時価等に関する事項

1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2．時価の算定方法	<p>（１）有価証券          売買目的有価証券          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」に記載しております。</p> <p>（２）上記以外の金融商品          短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。</p> <p>当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第39特定期間 平成30年 1月22日現在	第40特定期間 平成30年 7月20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	86,365,164	204,659,664
合 計	86,365,164	204,659,664

## （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。

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

（ア）株式

該当事項はありません。

（イ）株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益 証券	フィデリティ・ストラテジック・イン カム・マザーファンド	2,436,242,887	7,140,627,901	
親投資信託受益証券	合計	2,436,242,887	7,140,627,901	
合計		2,436,242,887	7,140,627,901	

（注）親投資信託受益証券における券面総額の数値は証券数を表示しております。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

（参考情報）

ファンドは、「フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド」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、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は以下のとおりです。

「フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

（１）貸借対照表

区 分	平成30年 1月22日現在	平成30年 7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,312,319,353	1,648,348,033
株式	502,898,402	389,479,977
新株予約権証券	53,161,210	16,591,169
国債証券	38,146,120,902	34,842,257,438
地方債証券	399,078,089	397,585,460
特殊債券	2,356,292,304	2,160,882,977
社債券	31,092,823,873	28,809,285,001
貸付債権	377,950,068	803,584,119
派生商品評価勘定	829,008	81,806
未収入金	373,656,407	897,805,417
未収利息	807,226,569	716,381,497
前払費用	53,650,028	43,028,129
流動資産合計	76,476,006,213	70,725,311,023
資産合計	76,476,006,213	70,725,311,023
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,372,017	896,269
未払金	542,966,839	984,380,674
未払解約金	522,328,489	563,657,275
流動負債合計	1,066,667,345	1,548,934,218
負債合計	1,066,667,345	1,548,934,218
純資産の部		
元本等		
元本	26,059,373,265	23,601,987,627
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	49,349,965,603	45,574,389,178
元本等合計	75,409,338,868	69,176,376,805
純資産合計	75,409,338,868	69,176,376,805
負債純資産合計	76,476,006,213	70,725,311,023



## (2) 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	<p>(1) 株式、新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. 貸付債権の評価基準及び評価方法	<p>貸付債権 原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年 1月22日現在	平成30年 7月20日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	29,968,466,543 円	26,059,373,265 円
期中追加設定元本額	794,151,298 円	1,559,286,791 円
期中一部解約元本額	4,703,244,576 円	4,016,672,429 円
2. 期末元本額及びその内訳		
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）	21,513,939,303 円	19,225,308,434 円
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）	2,630,090,846 円	2,436,242,887 円
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド（資産成長型）Cコース（為替ヘッジ付き）	1,148,725,483 円	1,086,245,138 円
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド（資産成長型）Dコース（為替ヘッジなし）	766,617,633 円	854,191,168 円
計	26,059,373,265 円	23,601,987,627 円
3. 受益権の総数	26,059,373,265 口	23,601,987,627 口
4. 1口当たり純資産額	2.8938 円	2.9310 円

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権および金銭債務であり、その内容を貸借対照表、有価証券に関する注記、デリバティブ取引に関する注記および附属明細表に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、為替変動リスク、価格変動リスクの回避および信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的としております。</p> <p>当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク等があります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	投資リスクの管理および投資行動のチェックについては、運用部門が自ら行う方法と運用部門から独立したコンプライアンス部門が行う方法を併用し検証しています。

## ・金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券          売買目的有価証券          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」に記載しております。</p> <p>(2) 貸付債権          重要な会計方針に係る事項に関する注記「貸付債権の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(3) デリバティブ取引          「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(4) 上記以外の金融商品          短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。</p> <p>当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成30年 1月22日現在	平成30年 7月20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)
株式	35,410,791	6,695,360
新株予約権証券	1,341,257	247,629
国債証券	258,266,084	192,329,459
地方債証券	3,243,701	171,280
特殊債券	16,399,332	49,744,364
社債券	256,657,768	35,423,487
合 計	12,818,185	199,536,067

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

種類	平成30年 1月22日 現在			平成30年 7月20日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	736,213,489	-	735,384,481	829,008	562,789,282	-	563,603,745	814,463
アメリカ・ドル	522,328,489	-	521,830,231	498,258	562,789,282	-	563,603,745	814,463
ユーロ	213,885,000	-	213,554,250	330,750	-	-	-	-
買建	215,092,679	-	213,720,662	1,372,017	-	-	-	-
アメリカ・ドル	215,092,679	-	213,720,662	1,372,017	-	-	-	-
合計	951,306,168	-	949,105,143	543,009	562,789,282	-	563,603,745	814,463

## （注1）時価の算定方法

- 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。
  - 予約為替の受渡し日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。
  - 当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 

当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに算出したレートにより評価しております。

当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値により評価しております。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客相場の仲値により評価しております。

（注2）デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておりません。

## （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。

（3）附属明細表

有価証券明細表

（ア）株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	GENERAL MOTORS CO	17,757	39.31	698,027.67	
	ALLERGAN PLC	6,006	173.39	1,041,380.34	
	UC HOLDINGS INC	12,675	25.48	322,959.00	
	WARRIOR MET COAL INC	242	26.49	6,410.58	
	VISTRA ENRGY SR 0 PC 7% 7/1/19	11,300	92.93	1,050,154.20	
	SOUTHEASTERN GROCERS INC	11,157	30.45	339,730.65	
アメリカ・ドル	小計	59,137		3,458,662.44 (389,479,977)	
合計		59,137		389,479,977 (389,479,977)	

（イ）株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	アメリカ・ドル	GULFMARK OFFSHORE WT 10/21/42	4,398.00	147,333.00	
		アメリカ・ドル 小計	4,398.00	147,333.00 (16,591,169)	
新株予約権証券	合計			16,591,169 (16,591,169)	
国債証券	日本円	323 10年国債	1,330,000,000	1,383,013,800	
		9 40年国債	300,000,000	262,611,000	
	日本円 小計		1,630,000,000	1,645,624,800	
	アメリカ・ドル	AID 5.5% 9/18/23	9,969,000.00	11,200,769.64	
		AID UKRAINE 1.471% 09/29/21	1,959,000.00	1,879,680.09	
		ANGOLA 7% 8/16/19 REGS	125,000.00	125,957.49	
		ANGOLA GOVT 9.375% 5/8/48 144A	200,000.00	205,284.00	
		ARAB RP EGYPT 5.875% 6/25 144A	210,000.00	201,602.10	
		ARGENTINA GOVT 7.125% 06/28/17	260,000.00	204,360.00	
		ARGENTINA REP 6.875% 4/22/21	3,600,000.00	3,551,400.00	

ARGENTINA REP 7.5% 4/22/26	1,845,000.00	1,739,853.45	
ARGENTINA REP 7.625% 4/22/46	355,000.00	299,623.55	
BARBADOS GOVT 7% 8/04/22 144A	160,000.00	88,000.00	
BARBADOS GOVT 7.25% 12/21 144A	20,000.00	11,200.00	
BELARUS REPUB 6.875% 2/23 144A	485,000.00	505,661.00	
BELARUS REPUB 7.625% 6/27 144A	160,000.00	170,521.60	
BRAZIL GLBL 7.125% 1/20/37	190,000.00	208,050.00	
BRAZIL GLBL 8.25% 1/20/34	1,005,000.00	1,183,387.50	
BRAZIL GOVT 5.625% 1/7/41	960,000.00	878,400.00	
BRAZIL REP 5.625% 02/21/2047	290,000.00	258,680.00	
CAMEROON RP 9.5% 11/19/25 144A	310,000.00	332,450.20	
COLOMBIA GLB 10.375% 1/28/33	275,000.00	429,687.50	
COLOMBIA REP 7.375% 9/18/37	250,000.00	319,062.50	
COSTA RICA 7% 4/4/2044 144A	230,000.00	234,025.00	
CROATIA GOVT 5.5% 4/4/23 144A	110,000.00	117,276.50	
DOMINICAN REP 5.5% 01/25 144A	150,000.00	150,769.50	
DOMINICAN REP 5.95% 01/27 144A	260,000.00	264,550.00	
DOMINICAN REP 6.6% 1/24 144A	200,000.00	211,048.00	
DOMINICAN REP 6.875% 1/26 144A	290,000.00	311,474.50	
DOMINICAN REP 7.45% 04/44 144A	385,000.00	420,612.50	
DOMINICAN REPubLI 6% 7/28 144A	150,000.00	152,025.00	
ECUADOR GOVT 7.875% 1/28 144A	200,000.00	179,300.00	
ECUADOR GOVT 8.875% 10/27 144A	630,000.00	595,350.00	

ECUADOR RP 9.65% 12/13/26 144A	400,000.00	397,000.00	
EGYPT GOVT 5.577% 2/21/23 144A	230,000.00	225,367.80	
EGYPT GOVT 7.903% 2/21/48 144A	200,000.00	194,174.00	
EGYPT REP 6.125% 1/31/22 144A	975,000.00	981,220.50	
EGYPT REP OF 7.5% 1/31/27 144A	230,000.00	235,262.40	
EGYPT REP OF 8.5% 1/31/47 144A	620,000.00	637,862.20	
EL SALVADOR 7.375 12/1/19 144A	495,000.00	513,562.50	
EL SALVADOR 7.75% 1/24/23 144A	150,000.00	160,294.50	
EL SALVADOR REP 7.65 6/35 REGS	25,000.00	25,687.50	
GABONESE GOVT 6.375 12/24 144A	255,000.00	229,102.20	
GHANA GOVT 10.725% 10/30 144A	70,000.00	88,570.30	
GHANA REP 8.625% 06/16/49	200,000.00	200,872.00	
GOVT OF PAKITN 6.75% 12/19/144A	445,000.00	443,972.05	
INDONESIA 6.625% 2/17/37 144A	240,000.00	284,606.40	
INDONESIA 7.75% 1/17/38 144A	505,000.00	669,569.40	
INDONESIA 8.5% 10/12/35 REGS	1,100,000.00	1,528,516.00	
INDONESIA GOVT 5.25 1/42 144A	200,000.00	210,418.00	
IRAQ REP 5.8% 1/15/28 REGS	1,250,000.00	1,153,275.00	
IRAQ REP 6.75% 03/09/23 144A	200,000.00	196,332.00	
ISRAEL GLBL 5.5% 12/4/23	8,000.00	9,026.00	
IVORY COAST GOV STEP 12/32 RGS	231,250.00	218,531.25	

JORDAN GOVT 3% 6/30/25	1,629,000.00	1,618,867.62	
KENYA GOVT 7.25% 2/28/28 144A	125,000.00	122,618.75	
KENYA GOVT 8.25% 2/28/48 144A	200,000.00	192,320.00	
KENYA REP 5.875% 06/24/19 144A	65,000.00	65,694.85	
KENYA REP 6.875% 06/24/24 144A	100,000.00	99,750.00	
LEBANE 144A 5.8% 4/14/20 REGS	80,000.00	77,000.00	
LEBANESE REP GMTN 5.5 4/19	80,000.00	78,980.00	
LEBANON REP 5.15% 11/12/18	900,000.00	896,454.00	
LEBANON REP 5.45% 11/28/19	1,030,000.00	1,004,250.00	
LEBANON REP 6% 1/27/23 REGS	200,000.00	174,220.00	
LEBANON REP 6% 5/20/19 RGS	750,000.00	743,587.50	
MEXICO GOV 6.05% 1/11/40	245,000.00	274,645.00	
MONGOLIA GOVT 8.75% 3/24 144A	395,000.00	434,026.00	
NIGERIA GOVT 7.143% 2/30 144A	200,000.00	193,590.00	
NIGERIA REP 7.625% 11/47 144A	200,000.00	186,788.00	
OMAN SULTANATE 6.75% 1/48 144A	265,000.00	246,683.20	
PAKISTAN GOVT 7.25% 04/19 144A	1,010,000.00	1,012,716.90	
PAKISTAN GOVT 8.25% 04/24 144A	235,000.00	234,468.90	
REP OF ARMENIA 6% 9/30/20 144A	311,000.00	320,099.86	
REP OF ARMENIA 7.15% 3/25 144A	85,000.00	91,205.00	
RUSSIA FED 12.75% 6/24/28 REGS	785,000.00	1,281,826.50	
RUSSIAN FED 5.875 9/16/43 144A	270,000.00	296,119.80	
RUSSIAN FEDN 5.25% 06/47 144A	1,000,000.00	985,000.00	



RUSSIAN FEDN 5.625 4/4/42 144A	250,000.00	266,250.00	
RWANDA INTL GOV6.625 5/23 144A	235,000.00	236,478.15	
SENEGAL GOV 6.75% 3/13/48 144A	150,000.00	131,475.00	
SOUTH AFRICA GOVT 4.875% 04/26	200,000.00	196,406.00	
SOUTH AFRICA GOVT 5.875% 06/22	135,000.00	136,606.50	
SOUTH AFRICA GOVT 6.25% 3/8/41	100,000.00	101,960.00	
SRI LANKA GOV 6.25 10/4/20 144	175,000.00	178,290.00	
SRI LANKA GOV 6.25 7/27/21 144	250,000.00	253,985.00	
SRI LANKA GOVT 5.125 4/19 144A	75,000.00	75,280.50	
SRI LANKA GOVT 5.75% 4/23 144A	355,000.00	348,329.55	
TURKEY GLBL 7% 6/5/20	250,000.00	255,180.00	
TURKEY GLBL 7.375% 2/05/25	540,000.00	552,625.20	
TURKEY GOVT 5.75% 05/11/2047	125,000.00	99,932.50	
TURKEY REP 5.125% 3/25/22	385,000.00	370,870.50	
TURKEY REP 5.625% 3/30/21	440,000.00	435,534.00	
TURKEY REP 6.25% 9/26/22	1,365,000.00	1,356,673.50	
TURKEY REP 6.75% 5/30/40	415,000.00	379,725.00	
TURKEY REP 7.25% 3/05/38	450,000.00	435,361.50	
TURKEY REP GLB 6.875% 3/17/36	845,000.00	788,182.20	
TURKEY REPUBLI 4.875% 10/09/26	105,000.00	91,245.00	
TURKEY REPUBLIC OF 6% 03/25/27	100,000.00	92,832.00	

UKRAINE CAB 7.75% 09/01/21 RGS	337,000.00	337,640.30	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/20 144A	650,000.00	652,216.50	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/21 144A	2,225,000.00	2,229,227.50	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/22 144A	2,180,000.00	2,163,802.60	
UNITED MEXICAN 4.75% 3/08/44	270,000.00	259,470.00	
UNITED STATES TREASURY BOND 3.	874,000.00	902,405.00	
URUGUAY REP PIK 7.875% 1/15/33	100,000.00	134,630.00	
US TREASURY BND 3% 5/15/47	78,000.00	78,575.64	
UST NOTE 1.5% 08/15/26	200,000.00	180,850.00	
UST NOTE 1.875% 03/31/22	6,920,000.00	6,719,666.00	
UST NOTE 2% 8/15/25	319,000.00	302,488.56	
UST NOTE 2.25% 02/15/27	400,000.00	382,140.00	
UST NOTES 1.125% 09/30/21	2,663,000.00	2,536,800.43	
UST NOTES 1.875% 1/31/22	4,543,000.00	4,418,203.79	
UST NOTES 2% 07/31/2024	8,648,000.00	8,329,061.76	
UST NOTES 2.125% 06/30/22	129,000.00	126,192.96	
USTB 2.5% 2/15/46	232,000.00	211,834.56	
USTB 2.75% 08/15/47	4,268,000.00	4,092,243.76	
USTB 2.75% 11/15/47	1,385,000.00	1,327,591.75	
USTB 2.875% 8/15/45	4,265,000.00	4,197,826.25	
USTB 3% 11/15/44	100,000.00	100,792.00	
USTB 3% 11/15/45	2,900,000.00	2,922,417.00	
USTB 3.625% 02/15/44	8,788,000.00	9,839,044.80	
USTB 4.5% 2/15/36	1,845,000.00	2,259,756.00	

USTB 4.75% 2/15/37	3,210,000.00	4,075,319.70	
USTB 5.25% 2/15/29	230,000.00	280,025.00	
USTB 6.125%	6,382,000.00	8,351,931.94	
USTB 7.125% 2/15/23	257,000.00	305,287.73	
USTCOUP 2/15/34	1,130,000.00	711,425.40	
USTN 1.25% 07/31/23	1,750,000.00	1,627,500.00	
USTN 1.375% 02/29/20	683,000.00	670,166.43	
USTN 1.375% 04/30/20	961,000.00	940,915.10	
USTN 1.5% 10/31/19	6,936,000.00	6,849,022.56	
USTN 1.5% 3/31/19	50,000.00	49,734.00	
USTN 1.5% 7/15/20	12,608,000.00	12,339,071.36	
USTN 1.625% 05/31/23	2,915,000.00	2,767,763.35	
USTN 1.625% 08/31/22	445,000.00	426,172.05	
USTN 1.75% 06/30/22	4,374,000.00	4,217,148.36	
USTN 1.75% 12/31/20	1,098,000.00	1,074,963.96	
USTN 1.875% 07/31/22	2,560,000.00	2,478,080.00	
USTN 2% 01/15/21	16,131,000.00	15,883,227.84	
USTN 2% 09/30/20	203,000.00	200,310.25	
USTN 2% 10/31/22	1,200,000.00	1,165,068.00	
USTN 2% 12/31/21	6,891,000.00	6,734,849.94	
USTN 2.25% 02/29/20	1,800,000.00	1,791,126.00	
USTN 2.25% 07/31/21	12,050,000.00	11,903,110.50	
USTN 2.25% 12/31/24	7,073,000.00	6,844,188.45	
USTN 2.375% 05/15/27	300,000.00	289,194.00	
USTN 2.5% 03/31/23	3,977,000.00	3,936,275.52	
USTN 2.5% 05/31/20	2,400,000.00	2,396,136.00	
USTN 2.75% 02/15/28	390,000.00	386,829.30	

	USTN 2.75% 04/30/23	120,000.00	120,084.00	
	USTN 2.75% 06/30/25	11,143,000.00	11,104,222.36	
	USTN 2.875% 05/15/28	100,000.00	100,285.00	
	USTN 3.625% 8/15/19	341,000.00	345,248.86	
	VENEZUELA 11.95% 8/31 REGS	1,495,000.00	433,550.00	
	VENEZUELA REP 9.25% 9/15/27	1,805,000.00	518,937.50	
	VENEZUELA REPUB 12.75% 8/23/22	345,000.00	99,187.50	
	VIETNAM PAR 3/5.5% 3/12/28	1,629,250.01	1,591,598.02	
	VIETNAM SOCIALIST FRN 3/13/28	70,000.00	61,497.80	
アメリカ・ドル 小計		219,738,500.01	220,221,748.54 (24,799,171,103)	
イギリス・ポンド	UK GILT 1.75% 22/07/2019 REGS	2,500,000.00	2,525,975.00	
	UK GILT 2.5% 07/22/65 REGS	2,300,000.00	3,055,780.00	
	UK GILT 4.25% 12/07/27	4,450,000.00	5,657,774.50	
イギリス・ポンド 小計		9,250,000.00	11,239,529.50 (1,647,827,420)	
カナダ・ドル	CANADA GOV 1% 06/01/2027	2,600,000.00	2,369,562.00	
	CANADA GOVT 0.75% 05/01/19	14,050,000.00	13,947,294.50	
	CANADA GOVT 3.5% 12/01/45	1,075,000.00	1,365,615.50	
	CANADA GOVT I/L 1.25% 12/01/47	1,600,000.00	2,113,520.00	
カナダ・ドル 小計		19,325,000.00	19,795,992.00 (1,680,679,721)	
ユーロ	BELGIUM GOVT 1.25% 4/33 REGS	1,000,000.00	1,026,740.00	
	BUONI DEL TES 2.7% 3/1/47	1,350,000.00	1,216,147.50	
	BUONI DEL TESOR 0.95% 3/1/23	6,400,000.00	6,222,592.00	
	BUONI DEL TESORO POL 2% 2/1/28	5,490,000.00	5,261,176.80	
	BUONI DEL TESORO POLIENNALI 0.	2,100,000.00	2,050,440.00	

		FRANCE GOVT 2% 05/48 RGS 144A	500,000.00	556,730.00	
		FRANCE REPUBLIC OF 2.25% 05/25	4,100,000.00	4,643,988.00	
		GERMANY GOVT 0.25% 2/15/27 RGS	875,000.00	882,183.75	
		GERMANY GOVT 2.5% 8/15/46	565,000.00	778,536.10	
		GERMANY REP OF 0% 3/13/20 RGS	9,425,000.00	9,525,470.50	
		IRELAND GOVT 1.3% 5/15/33 RGS	1,050,000.00	1,051,218.00	
		PORTUGAL GOVT 4.95% 10/25/23	2,700,000.00	3,311,496.00	
		SPAIN GOVT 1.4% 04/30/2028 144	2,075,000.00	2,096,829.00	
		ユーロ 小計	37,630,000.00	38,623,547.65 (5,068,954,394)	
国債証券 合計				34,842,257,438 (33,196,632,638)	
地方債証券	アメリカ・ドル	BUENOS AIRES 10.875% 1/21 144A	200,000.00	206,702.00	
		BUENOS AIRES 10.875% 1/21 REGS	1,080,000.00	1,116,190.80	
		BUENOS AIRES 9.95% 06/21 144A	630,000.00	647,331.30	
		PROV CORDOBA 7.45% 9/1/24 144A	360,000.00	323,553.60	
		PROV OF SANTA FE 7% 3/23 144A	560,000.00	513,105.60	
		PROVINCE CRDB 7.125% 6/21 144A	750,000.00	723,757.50	
		アメリカ・ドル 小計	3,580,000.00	3,530,640.80 (397,585,460)	
地方債証券 合計				397,585,460 (397,585,460)	
特殊債券	アメリカ・ドル	BANCO DO BRASIL 9.0% PERP 144A	620,000.00	620,124.00	
		BANQUE CENTRL 5.75% 1/25 144A	200,000.00	181,500.00	
		FNMA 0.875% 08/02/19	1,201,000.00	1,181,471.74	
		FNMA 1% 12/31/19	2,977,000.00	2,954,106.87	
		FNMA 1.125% 12/14/18	2,195,000.00	2,186,044.40	

		PDVSA 12.75% 2/17/22 144A	400,000.00	105,000.00	
		PDVSA PETR VENZ 5.375% 4/12/27	325,000.00	75,855.00	
		PDVSA PETRO VENZ 5.5% 4/12/37	390,000.00	90,636.00	
		PEMEX MASTER TR 6.625 6/15/38	200,000.00	195,940.00	
		PEMEX PRO FDG 6.625% 6/15/35	1,670,000.00	1,664,656.00	
		PERTAMINA PT 6% 5/3/42 144A	200,000.00	204,816.00	
		PETROL VENEZUELA 6% 11/26 144A	1,090,000.00	243,516.90	
		PETROLEOS DE VENEZUELA SA 6.0%	315,000.00	70,875.00	
		PETROLEOS DE VENEZUELA SA 8.5%	131,250.00	112,415.62	
		PETROLEOS MEX 6.5% 6/02/41	2,275,000.00	2,187,185.00	
		PETROLEOS MEXCNS 6.75% 9/21/47	930,000.00	903,402.00	
		PETROLEOS MEXN 6.375% 1/23/45	785,000.00	735,238.85	
		PETROLEOS MX 6.625% PERP 144A	370,000.00	351,500.00	
		PETROLEOS VENZ 9.75 5/35 144A	670,000.00	164,150.00	
		TENN VLY AUTH 1.75% 10/15/18	3,611,000.00	3,608,219.53	
		TURKIYE IHRAC 6.125% 5/24 144A	140,000.00	126,485.80	
		TVA 5.25% 9/15/39	267,000.00	336,908.61	
		TVA 5.5% 6/15/38	4,000.00	5,226.20	
		YPF SOCIEDAD 8.75% 4/4/24 144A	895,000.00	883,812.50	
		アメリカ・ドル 小計	21,861,250.00	19,189,086.02 (2,160,882,977)	
特殊債券 合計				2,160,882,977 (2,160,882,977)	
社債券	アメリカ・ドル	ACCESS BANK 9.25/VAR 6/24/21	170,000.00	169,019.10	
		ACCESS MTN BE 10.5% 10/21 144A	45,000.00	46,675.80	
		ACRISURE LLC 7% 11/15/25 144A	425,000.00	383,562.50	

AEROPUERTOS 6.875% 2/1/27 144A	210,000.00	201,230.40	
AES CORP 4% 03/15/21	600,000.00	596,958.00	
AES CORP 5.125% 09/01/2027	245,000.00	246,357.30	
AIRCASTLE LTD 6.25% 12/19 WI	95,000.00	98,087.50	
ALBERTSO FRN 3ML+375 1/24 144A	150,000.00	150,562.50	
ALBERTSON'S INC 7.45% 8/01/29	45,000.00	36,787.50	
ALBERTSONS COM 5.75% 03/15/25	570,000.00	510,150.00	
ALBERTSONS MTN 6.625% 6/01/28	475,000.00	356,250.00	
ALCOA NEDERLA 6.125% 5/28 144A	200,000.00	203,500.00	
ALFA BANK 8%/VAR PERP RGS	400,000.00	393,520.00	
ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31	2,594,000.00	3,093,345.00	
ALLY FINL INC 5.75% 11/20/2025	3,231,000.00	3,307,736.25	
ALLY LLC MTN 8% 12/31/18	545,000.00	555,900.00	
ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18 Escrow	610,000.00	-	
ALTICE FINCO 7.625% 2/25 144A	815,000.00	735,537.50	
ALTICE FINCO 8.125% 01/24 144A	305,000.00	309,575.00	
ALTICE FING SA 7.5% 05/26 144A	1,040,000.00	1,024,400.00	
ALTICE FRANCE 8.125% 2/27 144A	710,000.00	718,875.00	
ALTICE SA 7.625% 2/15/25 144A	660,000.00	619,383.60	
ALTICE SA 7.75% 05/15/22 144A	4,650,000.00	4,620,937.50	
AMC ENT HLDGS 6.125% 05/15/27	250,000.00	243,125.00	
AMC NETWORKS INC 4.75% 12/15/2	60,000.00	59,850.00	
ANTERO LP/ FIN 5.375% 09/15/24	205,000.00	206,537.50	

ANTERO RES CORP 5.625% 6/01/23	860,000.00	875,050.00	
ANTERO RES CRP 5.125% 12/22 WI	20,000.00	20,104.00	
ANTERO RS FN 5.375% 11/21 WI	945,000.00	954,450.00	
APERGY CORP 6.375% 5/1/26 144A	100,000.00	101,500.00	
APX GROUP 7.875% 12/01/22 WI	910,000.00	905,450.00	
APX GROUP INC 7.625% 09/01/23	665,000.00	583,949.80	
APX GRP INC 8.75% 12/1/20 WI	4,992,000.00	4,917,120.00	
ARAMARK SERVICES 5% 2/28 144A	470,000.00	452,962.50	
ARCELORMITTA 7% 10/15/39	461,000.00	517,703.00	
ARCELORMITTAL STEP 3/01/41	20,000.00	22,210.00	
ARDAGH PKG FIN 7.25% 5/24 144	990,000.00	1,030,837.50	
ASHTON WOOD 6.875 2/15/21 144A	1,121,000.00	1,123,802.50	
AVANTOR INC 6% 10/01/24 144A	845,000.00	838,662.50	
AXTEL SAB 6.375% 11/14/24 144A	140,000.00	137,060.00	
BALBOA MRGR 11.375% 12/21 144A	1,780,000.00	1,913,500.00	
BALL CORP 4.875% 3/15/26	625,000.00	622,656.25	
BANCO DE RESERVAS 7% 2/23 144A	230,000.00	232,875.00	
BANCO HIPO 9.75% 11/30/20 144A	870,000.00	902,581.50	
BANCO MACRO 6.75% 11/4/26 144A	545,000.00	508,212.50	
BANGLALINK DIG 8.625 5/19 144A	975,000.00	978,705.00	
BANK OF AMERICA 5.86%/VAR PERP	1,075,000.00	1,057,262.50	
BARCLAYS 7.625% 11/21/22	2,240,000.00	2,426,860.80	



BBA US HLDGS 5.375% 5/26 144A	100,000.00	100,500.00	
BGEO GROUP JSC 6% 7/26/23 144A	405,000.00	402,598.35	
BIG RIVER STL 7.25% 9/25 144A	245,000.00	251,737.50	
BMC EAST LLC 5.5% 10/1/24 144A	355,000.00	341,687.50	
BOMBARDIER INC 7.5% 12/24 144A	280,000.00	297,763.20	
BOYD GAMING CORP 6% 8/26 144A	135,000.00	134,156.25	
BRAND ENERGY 8.5% 7/25 144A	680,000.00	685,100.00	
BROOKFIELD RES 6.125 7/22 144A	460,000.00	462,300.00	
C&W SR FIN 6.875% 9/15/27 144A	330,000.00	316,965.00	
CALIF RES 8.0% 12/15/22 144A	2,080,000.00	1,861,600.00	
CALPINE CORP 5.75% 01/15/25	555,000.00	509,212.50	
CATALENT PHA 4.875% 1/26 144A	95,000.00	91,941.00	
CCO HLDGS LLC 5.75% 01/15/24	2,885,000.00	2,902,136.90	
CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144	2,045,000.00	1,931,236.65	
CCO HLDGS/CAP 5.25% 9/30/22	200,000.00	201,374.00	
CCO HLDGS/CAP 5.5% 05/26 144A	765,000.00	745,951.50	
CDK GLOBAL INC 5.875% 06/15/26	95,000.00	97,493.75	
CENTENE ESCRO 5.375% 6/26 144A	690,000.00	705,525.00	
CEQUEL 7.5% 4/01/28 144A	690,000.00	712,425.00	
CEQUEL COM HLDG I/CAP CP 7.75% 7/25 144A	390,000.00	411,450.00	
CF INDUS INC 5.375% 03/15/44	330,000.00	292,020.30	
CF INDUSTRI INC 5.15% 03/15/34	575,000.00	529,000.00	
CF INDUSTRIES INC 4.95% 6/43	825,000.00	697,125.00	

CHARLES RIVER 5.5% 4/26 144A	195,000.00	196,218.75	
CHEMOURS CO 5.375% 05/15/2027	145,000.00	140,468.75	
CHENIERE CORPUS 5.125% 06/27	675,000.00	673,312.50	
CHENIERE CORPUS 5.875% 3/31/25	540,000.00	565,650.00	
CHESAPEAKE 8% 12/15/22 REGS	661,000.00	697,355.00	
CHESAPEAKE ENERGY 3ML+325 4/19	555,000.00	554,306.25	
CHESAPEAKE ENERGY 4.875% 04/22	1,370,000.00	1,308,350.00	
CHESAPEAKE ENERGY 5.75 3/15/23	465,000.00	438,262.50	
CHESAPEAKE ENERGY 8% 01/15/25	1,595,000.00	1,610,950.00	
CHESAPEAKE ENERGY 8% 06/15/27	2,365,000.00	2,376,825.00	
CHOBANI 7.5% 04/15/25 144A	260,000.00	247,325.00	
CHS/CMNTY HEA 8.625% 1/24 144A	635,000.00	655,637.50	
CHS/CMNTY HEALTH 6.25% 3/31/23	2,490,000.00	2,297,025.00	
CHUKCHANSI EC 9.75 5/30/20 RGS	28,827.42	19,026.09	
CIMPOR FIN OP 5.75% 07/24 144A	250,000.00	194,375.00	
CIT GROUP INC NEW 5.25% 3/7/25	250,000.00	253,750.00	
CIT GROUP NEW 5.375% 5/15/20	3,000.00	3,078.75	
CITGO HLDG 10.75% 2/20 144A	1,145,000.00	1,222,287.50	
CITIGROUP 5.35% PERP	1,375,000.00	1,356,093.75	
COMCEL TRST 6.875% 2/6/24 144A	260,000.00	269,100.00	
COMMUNITY HLTH 5.125 8/21	380,000.00	357,200.00	

CONSOLID FRN 3ML+375 6/22 144A	395,000.00	395,142.20	
CONSOLIDATED 6.5% 5/26 144A	645,000.00	636,679.50	
CONTINENTAL OK 4.375% 01/15/28	345,000.00	344,993.10	
CORTES NP 9.25% 10/15/24 144A	160,000.00	158,000.00	
COSAN OVERSEAS 8.25% PERP	800,000.00	806,296.00	
COTY INC 6.5% 04/15/26 144A	420,000.00	402,612.00	
COVEY PK 7.5% 5/15/25 144A	100,000.00	102,000.00	
CRC ESCROW 5.25% 10/15/25 144A	1,870,000.00	1,778,837.50	
CREDIT AGR 6.625%/VAR PRP 144A	285,000.00	287,157.45	
CREDIT AGR 8.125%/VAR PERP 144A	1,140,000.00	1,225,500.00	
CREDIT AGRIC 7.875% PERP 144A	200,000.00	209,202.00	
CREDITO REAL 7.5% 03/19 144A	550,000.00	556,600.00	
CROWN AMER 4.25% 09/30/26	180,000.00	162,450.00	
CROWN AMERICAS 4.75% 2/26 144A	310,000.00	291,400.00	
CSC HLDGS 5.5% 04/15/27 144A	1,470,000.00	1,414,140.00	
CSC HLDGS LLC 5.375% 2/28 144A	395,000.00	371,300.00	
CSN ISLANDS XI 6.875 9/19 144A	365,000.00	361,371.90	
CSN RESOURCES SA 6.5 7/20 144A	435,000.00	412,641.00	
CTR PARTNERSHIP 5.25% 6/1/25	515,000.00	499,550.00	
CYRUSONE LP/FIN 5% 03/15/24	115,000.00	115,000.00	
CYRUSONE LP/FIN 5.375% 3/15/27	175,000.00	173,250.00	
DCP MIDSTR 5.85% 5/21/43 144A	185,000.00	169,506.25	
DCP MIDSTREAM OP 5.375% 07/25	290,000.00	293,625.00	

DENBURY RESOURC 6.375% 8/15/21	115,000.00	108,100.00	
DENBURY RESOURCE 4.625 7/15/23	4,625,000.00	3,977,500.00	
DENBURY RESOURCES 5.5% 05/22	380,000.00	346,750.00	
DIAMOND FIN 7.125% 6/24 144A	470,000.00	499,069.50	
DISH CORP 5% 03/15/23 WI	1,100,000.00	951,500.00	
DISH DBS CORP 5.875% 7/22	1,740,000.00	1,639,950.00	
DISH DBS CORP 6.75% 6/01/21 WI	35,000.00	35,131.25	
DRAX FINCO 6.625% 11/1/25 144A	255,000.00	255,318.75	
DTEK FINANCE PIK VAR 12/24	425,000.00	433,648.75	
DYNEGY INC 5.875% 6/1/23	405,000.00	416,643.75	
DYNEGY INC 7.375% 11/22 W/I	735,000.00	766,693.20	
DYNEGY INC 7.625% 11//24 W/I	2,430,000.00	2,609,212.50	
DYNEGY INC 8% 01/15/25 144A	350,000.00	378,437.50	
DYNEGY INC 8.125% 1/30/26 144A	800,000.00	875,000.00	
EAGLE INTER 7.5% 5/1/25 144A	105,000.00	104,475.00	
ELDORADO RESRT 6% 04/01/25	325,000.00	327,437.50	
ENDEAVOR ENERGY 5.5% 1/26 144A	120,000.00	117,300.00	
ENDEAVOR ENERGY 5.75 1/28 144A	125,000.00	122,656.25	
ENERGY TRANSFER 5.5% 6/1/27	656,000.00	660,920.00	
ENERGY TRANSFER 9% 4/15/19	10,000.00	10,430.20	
ENSCO PLC 4.5% 10/01/2024	820,000.00	676,500.00	
ENSCO PLC 5.2% 3/15/25	140,000.00	116,900.00	
ENSCO PLC 7.75% 02/01/2026	305,000.00	291,275.00	

ENSEMBLE S MRG 9% 9/30/23 144A	700,000.00	726,250.00	
ENTEGRIS INC 4.625% 02/26 144A	315,000.00	298,371.15	
EP ENERGY LLC 7.75% 5/26 144A	895,000.00	908,425.00	
EP ENRGY/EVRST 8% 11/29/24 144	260,000.00	259,350.00	
EQUINIX INC 5.375% 5/15/27	285,000.00	284,287.50	
ESAL GMBH 6.25% 02/05/23 144A	725,000.00	691,476.00	
ESH HOSPITALTY 5.25% 5/25 144A	1,015,000.00	980,743.75	
EW SCRIPPS 5.125% 05/25 144A	45,000.00	41,850.00	
EXTERRAN PARTNER 6% 10/22 WI	1,110,000.00	1,095,681.00	
EXTERRAN PR/EXLP 6% 4/1/21 WI	1,595,000.00	1,587,025.00	
FERREXPO 10.375% 4/7/19 REGS	150,000.00	153,750.00	
FERREXPO 10.38% 4/7/19 REGS	122,500.00	125,562.50	
FIDELITY BANK 10.5% 10/22 144A	220,000.00	217,318.20	
FIRST QUANTUM 6.5% 3/24 144A	305,000.00	290,512.50	
FIRST QUANTUM 6.875% 3/26 144A	305,000.00	287,270.35	
FIRST QUANTUM 7.25% 4/23 144A	345,000.00	338,962.50	
FIRST QUANTUM 7.5% 4/25 144A	310,000.00	304,575.00	
FLY LEASING 5.25% 10/15/24	235,000.00	222,110.25	
FMG RES AUG 4.75% 5/15/22 144A	225,000.00	217,968.75	
FMG RES AUGUS 5.125% 3/23 144A	295,000.00	283,937.50	
FORD MTR CR LLC 5.75% 2/01/21	105,000.00	110,180.70	
FORD MTR CR LLC 5.875% 8/2/21	95,000.00	100,590.75	
FREEPORT MCMOR 6.875% 02/15/23	1,835,000.00	1,940,512.50	

FRESENIUS MC II 6.5% 9/18 REGS	10,000.00	10,046.10	
FRONTERA ENERGY 9.7% 6/23 144A	215,000.00	221,718.75	
FRONTIER COMM 8.5% 4/26 144A	685,000.00	658,456.25	
FRONTIER COMMS 11% 9/15/25	1,075,000.00	846,885.00	
FTI CONSULTING 6% 11/15/22 WI	1,807,000.00	1,856,692.50	
GCI INC 6.875% 4/15/25	720,000.00	743,400.00	
GEORGIAN OL&GS 6.75% 4/21 144A	190,000.00	190,343.90	
GLP CAP LP / GLP 5.25% 6/25	265,000.00	269,065.10	
GLP CAP LP/ FIN II 5.375% 4/26	210,000.00	211,575.00	
GOLDEN NUGGET 8.75% 10/25 144A	265,000.00	271,625.00	
GRAY TELE 5.875% 07/15/26 144A	2,000,000.00	1,930,000.00	
GTH FINANCE 7.25% 4/26/23 144A	425,000.00	447,312.50	
HCA INC 5.875% 02/15/26	595,000.00	606,900.00	
HCA INC 5.875% 3/15/22	1,905,000.00	1,993,106.25	
HCA INC 5.875% 5/01/23	65,000.00	67,356.25	
HEALTHSOUTH 5.75% 11/01/24	962,000.00	971,620.00	
HESS INFRA 5.625% 02/26 144A	365,000.00	365,000.00	
HILCORP ENRGY 5.75% 10/25 144A	1,475,000.00	1,467,625.00	
HILTON DOMEST 5.125% 5/26 144A	700,000.00	692,125.00	
HMAN FIN 6.375% 07/15/22 144A	460,000.00	440,450.00	
HOLOGIC 4.375% 10/15/25 144A	280,000.00	271,236.00	
HOLOGIC IN 4.625% 2/01/28 144A	95,000.00	89,537.50	
HUB INTEL LTD 7% 5/01/26 144A	260,000.00	256,100.00	

ICAHN ENTR LP 5.875% 2/1/22 WI	770,000.00	771,925.00	
ICAHN LP/FN COR 6.25% 02/01/22	580,000.00	587,250.00	
ICAHN LP/FN COR 6.375% 12/15/2	770,000.00	769,037.50	
ICAHN LP/FN COR 6.75% 02/01/24	350,000.00	353,500.00	
IHS MARKIT LTD 4% 3/1/26 144A	125,000.00	119,062.50	
ILFC MTN 7.125% 9/1/18 REGS	65,000.00	65,274.95	
INDIGO NATURAL 6.875 2/26 144A	315,000.00	305,550.00	
INTELSAT JACKSON 8% 02/24 144A	1,465,000.00	1,540,081.25	
INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	5,770,000.00	5,661,235.50	
IRSA INVER Y 11.5 7/20/20 REGS	5,000.00	5,200.00	
IRSA PROP 8.75% 03/23 144A	325,000.00	325,874.25	
J2 CLOUD/GLOBL 6% 7/15/25 144A	220,000.00	222,200.00	
JAGUAR LD RVR 4.5% 10/27 144A	895,000.00	785,362.50	
JBS INVTS 7.75% 10/28/20 144A	210,000.00	214,874.10	
JBS USA / FIN 5.75% 6/25 144A	420,000.00	393,229.20	
JBS USA/FIN 6.75% 02/28 144A	595,000.00	564,506.25	
JEFFERIES FIN 7.375% 4/20 144A	200,000.00	203,000.00	
JONAH ENERGY 7.25% 10/25 144A	511,000.00	433,072.50	
JOSEPH T RYERSON 11% 5/22 144A	315,000.00	347,287.50	
JPMORGAN CHASE 5.15% PERP	1,810,000.00	1,783,936.00	
JURASSIC 6.875% 02/15/21 144A	1,095,000.00	1,075,837.50	
KAZMUNA IGAZ 6.375% 10/48 144A	135,000.00	138,543.75	
KAZMUNA IGAZ FI 4.75% 4/25 144A	140,000.00	142,275.00	

KFC CO/PIZZA 4.75% 6/1/27 144A	255,000.00	240,018.75	
KOSMOS ENERGY 7.875% 8/20 144A	375,000.00	381,562.50	
KOSMOS ENRGY 7.875% 08/21 144A	534,000.00	543,345.00	
LAMAR MEDIA CRP 5% 05/01/23	75,000.00	75,750.00	
LANDRYS 6.75% 10/15/24 144A	680,000.00	679,517.20	
LAUREATE EDU 8.25% 5/1/25 144A	825,000.00	882,750.00	
LBC TANK TRM 6.875 5/15/23 144	200,000.00	199,750.00	
LEGACY RESVS 6.625% 12/21 WI	2,000,000.00	1,600,000.00	
LEGACY RSVS/FIN 8% 12/20 WI	750,000.00	637,500.00	
LENNAR CORP 5.375% 10/01/2022	10,000.00	10,150.00	
LEVEL 3 FIN INC 6.125% 1/15/21	1,370,000.00	1,380,192.80	
LSB INDUSTRIE 9.625% 5/23 144A	160,000.00	160,800.00	
MAGNESITA FIN 8.625% PERP 144A	450,000.00	448,879.50	
MAGNOLIA OIL & GAS OPER LLC /	255,000.00	256,912.50	
MATCH GROUP INC 5% 12/27 144A	225,000.00	212,679.00	
MATTEL INC 6.75% 12/25 144A	245,000.00	237,650.00	
MCGRAW-HILL 7.875% 5/24 144A	946,000.00	875,050.00	
MEG ENERGY 6.375% 1/30/23 144A	275,000.00	251,625.00	
MEG ENERGY 7% 3/31/24 144A	705,000.00	643,312.50	
METALSA SA DE CV 4.9% 04/24/20	150,000.00	147,750.00	
METINVEST 7.75% 4/23/23 144A	1,030,000.00	971,918.30	
MICRON TEC 5.5% 02/01/25	490,000.00	506,537.50	



MOMENTIVE PERF 8.875 10/20 WI	1,055,000.00	-	
MOMENTIVE PRF MATL 3.88% 10/21	1,425,000.00	1,498,031.25	
MPT OPER PARTNER 5% 10/15/27	691,000.00	664,223.75	
MPT OPER PARTNERSHP 5.25% 8/26	300,000.00	295,500.00	
MSCI INC 5.75% 08/15/2025 144A	380,000.00	392,350.00	
MURRAY ENERGY 11.25% 4/21 144A	175,000.00	131,250.00	
NAVIENT CORP 5.875% 10/24	1,010,000.00	969,600.00	
NAVIENT CORP 6.75% 6/15/26	335,000.00	325,452.50	
NAVIOS 8.125% 11/15/21 144A	935,000.00	766,700.00	
NAVIOS MARIT 11.25% 8/22 144A	475,000.00	450,062.50	
NAVIOS MARITIM 7.375 1/22 144A	3,365,000.00	2,649,937.50	
NAVIOS STH/FIN 7.25% 5/22 144A	130,000.00	124,800.00	
NEPTUNE 10.125% 01/15/23 144A	2,095,000.00	2,304,500.00	
NEPTUNE 10.875% 10/15/25 144A	1,130,000.00	1,309,387.50	
NEPTUNE 6.625% 10/15/25 144A	560,000.00	579,717.60	
NETFLIX 4.875% 04/15/28 144A	315,000.00	298,462.50	
NETFLIX 5.875% 11/15/28 144A	410,000.00	414,100.00	
NETFLIX INC 4.375% 11/15/26	835,000.00	789,075.00	
NEW COTAI 10.625%PIK 5/19 144A	1,303,568.00	1,277,496.64	
NEXTERA ENERGY 4.25% 9/24 144A	205,000.00	198,337.50	
NEXTERA ENERGY 4.5% 9/27 144A	145,000.00	135,575.00	
NOBLE HLDG 7.875% 2/01/26 144A	265,000.00	271,625.00	
NOBLE HLDG INTL 6.2% 8/01/40	295,000.00	213,875.00	

NOBLE HLDG INTL 7.75% 1/15/24	748,000.00	716,210.00	
NOSTRUM OIL 8% 7/25/22 144A	805,000.00	726,512.50	
NOVA CHEM 4.875% 6/1/24 144A	355,000.00	340,800.00	
NOVA CHEM 5.25% 6/1/27 144A	360,000.00	334,800.00	
NRG ENERGY INC 5.75% 1/28 144A	1,140,000.00	1,125,750.00	
NRG ENERGY INC 6.625% 01/15/27	1,175,000.00	1,210,250.00	
NUMERICABLE 7.375% 05/26 144A	1,035,000.00	1,016,887.50	
NVA HLDGS INC 6.875% 4/26 144A	145,000.00	143,731.25	
OASIS PETE INC 6.875% 3/15/22	322,000.00	328,440.00	
OCI NV 6.625% 4/15023 144A	995,000.00	1,007,437.50	
ODEBRECHT FIN 7.125 6/42 144A	850,000.00	348,500.00	
ODEBRECHT FIN 7.5% PERP 144A	750,000.00	318,757.50	
OIL & GAS HLDG 7.5% 10/27 144A	185,000.00	168,368.50	
OLIN CORP 5% 02/01/30	230,000.00	216,775.00	
ORCHESTRA BORR 6.75% 6/22 144A	205,000.00	212,175.00	
PACIFIC DRILL 7.25% 12/17 144A	1,055,000.00	527,500.00	
PAN AM ENERGY 7.875% 5/21 144A	375,000.00	382,526.25	
PARSLEPARSLEY ENG 6.25% 6/24 1	95,000.00	98,325.00	
PARSLEY 5.625% 10/15/27 144A	145,000.00	143,550.00	
PBF HLD LLC/FIN 7% 11/15/23	675,000.00	701,156.25	
PBF HLDG / FIN 7.25% 06/15/25	360,000.00	377,100.00	
PBF LOGISTICS 6.875% 05/23	515,000.00	520,150.00	
PEABODY SEC 6% 3/31/22 144	115,000.00	116,725.00	
PEABODY SEC 6.375% 3/25 144A	145,000.00	148,987.50	

PENN NATL 5.625% 1/15/27 144A	80,000.00	75,808.00	
PETKIM 5.875% 1/26/23 144A	200,000.00	179,000.00	
PETROBRAS GLB FINA 8.75% 05/26	1,480,000.00	1,644,724.00	
PILGRIM PRIDE 5.875% 9/27 144A	175,000.00	163,406.25	
PILGRIMS PRIDE 5.75% 3/25 144A	100,000.00	95,250.00	
PISCES MIDCO 8% 4/15/26 144A	420,000.00	436,800.00	
PLASTIPAK HLD 6.25% 10/25 144A	85,000.00	77,987.50	
PLATFORM 5.875% 12/1/25 144A	295,000.00	292,787.50	
PLATFORM SPECLTY 6.5 2/22 144A	565,000.00	578,418.75	
POLYUS GLD 5.25% 2/7/23 144A	200,000.00	196,704.00	
POST HLDGS 5.625% 01/28 144A	405,000.00	382,218.75	
POST HLDGS 5.75% 3/1/27 144	825,000.00	800,250.00	
PRESTIGE BRND 6.375% 3/24 144A	260,000.00	259,025.00	
PRIDE INTL INC 7.875% 8/15/40	685,000.00	623,350.00	
PT BUKIT MAK 7.75% 2/13/22 144	275,000.00	275,327.25	
QEP RESOURCES 5.25% 5/01/23	25,000.00	24,750.00	
QORVO INC 5.5% 7/15/26 144A	290,000.00	291,812.50	
QUINTILES IMS 5% 10/15/26 144A	325,000.00	315,250.00	
RADIATE HOLD 6.875% 2/23 144A	100,000.00	96,750.00	
RADIATE HOLDCO 6.625% 2/25 144	140,000.00	130,550.00	
RITE AID 6.875% 12/15/28 144A	1,865,000.00	1,454,700.00	
RITE AID CORP 7.7% 2/15/27	510,000.00	446,887.50	
ROSE ROCK MIDSTRM 5.625% 07/22	560,000.00	547,400.00	

ROYAL BK SC 6% 12/19/23	290,000.00	307,420.30	
ROYAL BK SCTLND 5.125% 5/28/24	780,000.00	793,392.60	
RUMO LUXEMBG 7.375% 2/9/24 144	410,000.00	423,407.00	
RURAL/METRO C 10.125 7/19 REGS	10,000.00	-	
SABRA HEALTH CA LP 5.5% 2/1/21	595,000.00	605,412.50	
SABRA HLTH /CPTL 5.375% 6/1/23	360,000.00	361,800.00	
SB CAP SA T5Y+ 02/26/2024 144A	165,000.00	165,330.00	
SCIENTIFIC GAMES 10% 12/1/22	2,165,000.00	2,315,186.05	
SCIENTIFIC GAMES 5% 10/25 144A	440,000.00	414,700.00	
SCIENTIFIC GAMES 6.25 9/20 WI	120,000.00	119,400.00	
SEMGROUP CORP 7.25% 03/15/26	700,000.00	691,250.00	
SERVICE CORP 5.375% 1/22 WI	285,000.00	287,850.00	
SESI LLC 7.75% 09/15/24	190,000.00	194,750.00	
SHEA HOMES 5.875% 4/23 144A	240,000.00	239,100.00	
SHEA HOMES 6.125% 4/25 144A	1,575,000.00	1,567,125.00	
SLM CORP 5.5% 12/31/23	300,000.00	291,750.00	
SLM CORP 6.125% 03/25/2024	865,000.00	849,862.50	
SM ENERGY CO 5.0% 01/15/2024	450,000.00	427,779.00	
SM ENERGY CO 5.625% 06/01/25	725,000.00	696,000.00	
SM ENERGY CO 6.5 1/1/23	25,000.00	25,281.25	
SM ENERGY CO 6.75% 09/15/26	210,000.00	212,100.00	
SOFTBANK 5.125% 09/19/27 RGS	495,000.00	464,567.40	
SOFTBANK GR 4.75% 09/19/24 RGS	495,000.00	470,324.25	
SOLERA LLC/FIN 10.5% 3/24 144A	2,015,000.00	2,221,537.50	

SOUTHERN GAS 6.875% 03/26 144A	495,000.00	538,579.80	
SOUTHWESTERN ENRGY 7.5% 4/1/26	280,000.00	289,800.00	
SOUTHWESTERN ENRGY 7.75% 10/27	210,000.00	218,400.00	
SPRINGLEAF FIN CRP 7.125% 3/26	275,000.00	274,945.00	
SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32	1,015,000.00	1,082,243.75	
SPRINT COMMUNICATIONS 6% 11/15/22	1,145,000.00	1,139,389.50	
SPRINT CORP 7.125% 06/15/24	895,000.00	902,876.00	
SPRINT CORP 7.62% 02/15/2025	210,000.00	216,846.00	
SPRINT CORP 7.625% 03/01/2026	230,000.00	234,600.00	
SPRINT CORP 7.875% 9/15/23	3,090,000.00	3,223,951.50	
SPRINT NEXTEL 9% 11/15/18 REGS	65,000.00	66,137.50	
SRC ENERGY INC 6.25% 12/01/25	175,000.00	175,875.00	
STARS GROUP HLDS/ST 7% 7/15/26	270,000.00	275,400.00	
STILLWATER 6.125% 6/27/22 144A	445,000.00	421,637.50	
STILLWATER 7.125% 6/27/25 144A	95,000.00	87,982.35	
SUMMIT MIDSTREAM 5.75% 4/25	280,000.00	267,750.00	
SUNOCO LP 4.875% 1/15/23 144A	310,000.00	301,171.20	
SUNOCO LP 5.5% 2/15/26 144A	265,000.00	250,756.25	
TALEN ENERGY SUP 6.5% 6/1/25	465,000.00	345,262.50	
TALEN ENRGY 10.5% 1/15/26 144A	1,085,000.00	952,087.50	

TARGA RES LP 5.375% 02/01/27	260,000.00	254,150.00	
TARGA RES LP/FI 4.25% 11/15/23	250,000.00	238,750.00	
TARGA RES P 5.875% 4/26 144A	210,000.00	213,412.50	
TEEKAY CORP 8.5% 1/15/20	1,480,000.00	1,546,600.00	
TEINE ENERGY 6.875% 09/22 144A	755,000.00	762,550.00	
TENET HEALTH 4.625% 7/24 144A	840,000.00	805,350.00	
TENET HEALTH 7.5% 1/1/22 144A	270,000.00	283,329.90	
TENET HEALTHCAR 8.125% 4/22 WI	3,240,000.00	3,406,050.00	
TENET HEALTHCARE 6.75% 6/15/23	1,790,000.00	1,798,967.90	
TERRAFORM POWE 4.25% 1/23 144A	145,000.00	139,925.00	
TERRAFORM POWER 5% 1/28 144A	150,000.00	140,250.00	
TERRAFORM POWR 6.12% 6/25 144A	400,000.00	424,500.00	
TERVITA 7.625% 12/21 144A	115,000.00	117,300.00	
TESLA INC 5.3% 08/15/2025 144A	700,000.00	631,750.00	
TESORO LOG LP/FN 6.375% 5/24	340,000.00	361,930.00	
TEVA PH FIN NV 6.75% 03/01/28	605,000.00	634,239.65	
THC ESCROW 5.125% 5/25 144A	1,075,000.00	1,033,343.75	
TOPS HLDG/MRKT 8.0% 06/22 144A	1,325,000.00	708,875.00	
TPC GROUP 8.75% 12/15/20 144A	1,175,000.00	1,163,250.00	
TRADE BK MONG 9.375% 5/20 144A	455,000.00	482,309.10	
TRANSDIGM UK 6.875% 5/26 144A	270,000.00	274,050.00	
TRANSOCEAN GD 5.875% 1/24 144A	360,000.00	360,450.00	
TRANSOCEAN PO 6.125% 8/25 144A	220,000.00	221,100.00	
TRANSPORTADORA 6.75% 5/25 144A	485,000.00	445,375.50	

TRONOX FIN 5.75% 10/1/25 144A	140,000.00	136,112.20	
TRONOX INC 6.5% 4/15/26 144A	555,000.00	551,531.25	
TTM TECH 5.625% 10/1/25 144A	105,000.00	103,425.00	
TURKIYE IS B 5.5% 4/21/22 144A	245,000.00	223,312.60	
TURKIYE VAKIFL 5.75% 1/23 144A	200,000.00	175,932.00	
TURKIYE VK BK6.875/VARF2/25 RGS	250,000.00	214,075.00	
TV AZTECA SAB 8.25% 8/9/24 RGS	800,000.00	812,000.00	
ULTRA RES 6.875% 04/15/22 144A	260,000.00	184,275.00	
ULTRA RES 7.125% 04/15/25 144A	220,000.00	143,550.00	
US AWYS 12-2 A 4.625% 12/03/26	27,425.89	28,131.83	
US AWYS 12-2 B 6.75% 12/3/22	22,426.06	23,625.85	
US AWYS 2013-1B 5.375% 5/15/23	150,451.89	153,806.96	
USA COMPRESSI 6.875% 4/26 144A	100,000.00	102,625.00	
USIS MERGER 6.875% 05/25 144A	405,000.00	396,900.00	
VALEANT PHARM 5.5% 11/25 144A	145,000.00	144,043.00	
VALEANT PHARM 5.5% 3/23 144A	1,530,000.00	1,434,420.90	
VALEANT PHARM 8.50% 1/27 144A	270,000.00	275,737.50	
VALEANT PHARMA 9% 12/25 144A	310,000.00	324,337.50	
VALEANT PHARMA 9.25% 4/26 144A	910,000.00	954,926.70	
VECTOR GROUP 6.125% 2/1/25 144	960,000.00	920,400.00	
VEDANTA RES 6.375% 7/22 144A	200,000.00	194,000.00	
VEDANTA RES PLC 8.25 6/21 144A	235,000.00	242,332.00	
VERITAS /BERMU 10.5% 2/24 144A	1,155,000.00	984,637.50	

VIACOM INC 5.875/VAR 02/28/57	260,000.00	251,542.20	
VIACOM INC 6.25/VAR 02/28/57	350,000.00	337,956.50	
VIRGIN MEDIA FI 4.875% 2/15/22	200,000.00	193,250.00	
VIZIENT 10.375% 3/01/24 144A	600,000.00	661,500.00	
VOC CRUISE LTD 5% 2/15/28 144A	240,000.00	228,000.00	
VPII ESCROW 7.5% 7/15/21 144A	1,405,000.00	1,431,695.00	
VRX ESCROW 5.875% 5/23 144A	4,184,000.00	3,978,984.00	
VRX ESCROW 6.125% 4/15/25 144A	1,640,000.00	1,517,000.00	
VTR FIN BV 6.875% 1/15/24 144A	225,000.00	229,162.50	
WALTER ENERGY 9.5% 10/19 144A	735,000.00	-	
WASTE PRO 5.5% 2/15/26 144A	95,000.00	91,200.00	
WAYNE MERGER 8.25% 8/1/23 144A	95,000.00	98,087.50	
WEATHERFORD 9.875% 3/1/25 144A	1,070,000.00	1,064,650.00	
WEEKLEY HOMES 6% 2/1/23	70,000.00	68,075.00	
WELLCARE HEALTH 5.25% 4/1/25	280,000.00	278,950.00	
WEST ST MERGR 6.375% 9/25 144A	1,405,000.00	1,348,800.00	
WHITING PETRO 6.625% 1/26 144A	195,000.00	201,337.50	
WILLIAM LYON HOMES INC 5.875%	250,000.00	235,000.00	
WIND TRE SPA 5% 01/20/26 144A	495,000.00	451,999.35	
WP ROCKET MRGR 10.125 7/19 REG	15,000.00	-	
WPX ENERGY INC 8.25% 8/01/23	480,000.00	543,600.00	
WYNDHAM HOTEL 5.375% 4/26 144A	420,000.00	416,850.00	



	WYNN MACAU 4.875% 10/24 144A	225,000.00	213,468.75	
	WYNN MACAU 5.5% 10/27 144A	275,000.00	261,992.50	
	ZAYO GRP/CAP 5.75% 1/15/27 144	780,000.00	772,200.00	
	ZENITH BK PLC 6.25% 04/19 144A	635,000.00	639,438.65	
	ZENITH BNK 7.375% 5/30/22 144A	600,000.00	604,122.00	
	ZIGGO SEC 5.5% 1/15/27 144A	980,000.00	935,900.00	
	アメリカ・ドル 小計	264,464,199.26	255,832,386.12 (28,809,285,001)	
社債券 合計			28,809,285,001 (28,809,285,001)	
合計			66,226,602,045 (64,580,977,245)	

（注）新株予約権証券における券面総額の数値は証券数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

1. 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に関するもので、内書きであります。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株 予約権証券 時価比率	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 6銘柄	0.69%	-%	-%	87.07%
	新株予約権証券 1銘柄	-%	0.03%	-%	
	国債証券 155銘柄	-%	-%	43.84%	
	地方債証券 6銘柄	-%	-%	0.70%	
	特殊債券 24銘柄	-%	-%	3.82%	
	社債券 418銘柄	-%	-%	50.92%	
イギリス・ポンド	国債証券 3銘柄	-%	-%	100%	2.54%
カナダ・ドル	国債証券 4銘柄	-%	-%	100%	2.59%
ユーロ	国債証券 13銘柄	-%	-%	100%	7.80%

#### 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 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

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## その他特定資産の明細表

特定資産の種類 / 通貨	銘柄	数量	帳簿単価 帳簿金額	評価単価 評価金額	評価損益	備考
貸付債権 / アメリカ・ ドル	CAL RES 1LN 2ND OUT TERM 12/31/21 C1	465,000.00	110.25 512,662.50	110.25 512,662.50	-	-
	CHEMOURS TERM B-2 1LN 4/03/25 C1	1,142,137.50	99.12 1,132,143.79	99.49 1,136,426.81	4,283.02	-
	CINEMARK TERM B 03/29/25 C1	492,525.00	100.00 492,525.00	100.06 492,835.29	310.29	-
	CINEWORLD TERM B 1LN 2/28/25 C1	902,737.50	99.47 897,962.01	99.58 898,973.08	1,011.07	-
	INTELSAT TERM B-3 11/27/23 C1	345,000.00	99.83 344,437.65	100.08 345,303.60	865.95	-
	MEDIACOM TERM N 02/15/24 C1	394,012.50	99.81 393,275.69	99.58 392,369.46	906.23	-
	PLY GEM HOLDINGS TRM B 4/12/25 C1	590,000.00	99.97 589,852.50	100.15 590,920.40	1,067.90	-
	SBA COMMUNICATIONS TERM B 4/25 C1	95,000.00	99.75 94,762.50	99.63 94,656.10	106.40	-
	SOUTHEASTERN GROC TERM B 5/24 C1	505,263.16	96.12 485,684.21	96.20 486,103.58	419.37	-
	SOUTHEASTERN GROC TERM B 5/24 C2	505,263.15	96.12 485,684.20	96.20 486,103.57	419.37	-
	SOUTHEASTERN GROC TERM B 5/24 C3	489,473.69	96.12 470,506.58	96.20 470,912.84	406.26	-
	TOPS MRKTS TRM D/D UNFNDD 2/19 C1	261,167.30	100.00 261,167.30	100.00 261,167.30	-	-
	TOPS MRKTS TRM DIP FUNDED 02/23/19 C1	261,167.30	100.00 261,167.30	100.00 261,167.30	-	-
	UBER TERM B INCR 4/4/25 C1	300,000.00	100.42 301,275.00	100.50 301,500.00	225.00	-
	UBER TERM B NEW 07/13/23 C1	354,098.98	100.00 354,098.98	100.22 354,895.70	796.72	-
VALEANT PHARMA TRM B INCR 06/01/25 C1	50,000.00	99.85 49,925.00	99.99 49,995.00	70.00	-	
貸付債権 / アメリカ・ドル 小計			7,127,130.21 (802,586,132)	7,135,992.53 (803,584,119)	8,862.32 (997,986)	
貸付債権 合計			802,586,132 (802,586,132)	803,584,119 (803,584,119)	997,986 (997,986)	
合計			802,586,132 (802,586,132)	803,584,119 (803,584,119)	997,986 (997,986)	

1. 小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建貸付債権に関するもので、内書きであります。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## Aコース（為替ヘッジ付き）

（2018年8月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	53,518,670,105	円
負債総額	232,969,079	円
純資産総額（ - ）	53,285,701,026	円
発行済数量	85,508,125,026	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6232	円

## Bコース（為替ヘッジなし）

（2018年8月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	6,957,163,918	円
負債総額	20,849,241	円
純資産総額（ - ）	6,936,314,677	円
発行済数量	10,744,774,568	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6456	円

## （参考）マザーファンドの純資産額計算書

## フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

（2018年8月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	65,961,737,259	円
負債総額	300,194,026	円
純資産総額（ - ）	65,661,543,233	円
発行済数量	22,694,716,358	口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.8933	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) 資本金等（2018年2月末日現在）

（略）

<訂正後>

(1) 資本金等（2018年8月末日現在）

（略）

## 2【事業の内容及び営業の概況】

< 訂正前 >

（略）

2018年2月28日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、追加型株式投資信託164本、親投資信託56本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額4,108,760,088,660円です。

< 訂正後 >

（略）

2018年8月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、追加型株式投資信託164本、親投資信託56本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,528,680,171,463円です。

### 3【委託会社等の経理状況】

原届出書「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、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

当社の財務諸表は、「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条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

当社の財務諸表は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

当社は財務諸表の適正性を確保するための特段の取り組みを行っております。具体的には、企業会計基準及び同適用指針、日本公認会計士協会が公表する委員会報告等の公開情報、各種関係諸法令の改廃に応じて、当社として必要な対応を適時に協議しております。

## （１）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第31期 (平成29年3月31日)	第32期 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	881,556	975,413
立替金	85,308	72,930
前払費用	30,449	28,800
未収委託者報酬	5,342,216	5,464,066
未収収益	1,378,266	1,921,861
未収入金	* 1 286,806	365,790
繰延税金資産	453,542	607,573
流動資産計	8,458,145	9,436,436
固定資産		
無形固定資産		
電話加入権	7,487	7,487
無形固定資産合計	7,487	7,487
投資その他の資産		
長期貸付金	* 1 21,722,618	22,863,900
長期差入保証金	15,558	17,804
繰延税金資産	796,264	778,438
その他	230	230
投資その他の資産合計	22,534,671	23,660,373
固定資産計	22,542,158	23,667,860
資産合計	31,000,304	33,104,296
負債の部		
流動負債		
預り金	141,925	103,438
未払金	* 1	
未払手数料	2,371,159	2,425,583
その他未払金	2,767,150	2,622,149
未払費用	568,610	551,982
未払法人税等	36,838	193,363
未払消費税等	466,813	291,148
賞与引当金	1,703,603	1,858,394
その他流動負債	1,467	931
流動負債合計	8,057,569	8,046,992
固定負債		
長期賞与引当金	194,809	239,904
退職給付引当金	5,094,290	4,786,190
固定負債合計	5,289,099	5,026,094
負債合計	13,346,669	13,073,087
純資産の部		
株主資本		
資本金	1,000,000	1,000,000
利益剰余金		
利益準備金	100,000	100,000
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	16,553,634	18,931,208
利益剰余金合計	16,653,634	19,031,208
株主資本合計	17,653,634	20,031,208
純資産合計	17,653,634	20,031,208
負債・純資産合計	31,000,304	33,104,296

## （２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第31期 （自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）	第32期 （自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日）
営業収益		
委託者報酬	47,434,300	47,015,140
その他営業収益	3,825,412	4,392,629
営業収益計	51,259,712	51,407,769
営業費用	* 1	
支払手数料	22,288,152	22,128,840
広告宣伝費	672,366	493,950
調査費		
調査費	460,109	487,993
委託調査費	10,233,243	10,160,657
営業雑経費		
通信費	56,369	50,195
印刷費	151,589	117,152
協会費	35,216	35,503
諸会費	1,100	1,555
営業費用計	33,898,147	33,475,849
一般管理費		
給料		
給料・手当	2,735,513	2,529,490
賞与	1,993,857	2,272,929
福利厚生費	587,661	593,981
交際費	28,792	27,478
旅費交通費	170,657	176,209
租税公課	132,592	129,039
弁護士報酬	14,000	15,719
不動産賃貸料・共益費	568,831	602,626
支払ロイヤリティ	1,414,418	1,033,326
退職給付費用	294,160	201,666
消耗器具備品費	21,484	5,733
事務委託費	5,550,653	6,503,327
諸経費	359,514	322,446
一般管理費計	13,872,137	14,413,974
営業利益	3,489,427	3,517,944
営業外収益		
受取利息	* 1	
受取利息	118,872	122,290
保険配当金	14,367	8,991
受取配当金	130	-
為替差益	30,178	86,339
雑益	3,442	4,534
営業外収益計	166,991	222,156
営業外費用		
寄付金	300	-
為替差損	-	-
営業外費用計	300	-
経常利益	3,656,118	3,740,101
特別利益		
投資有価証券売却益	148,786	-
特別利益計	148,786	-
特別損失		
特別退職金	225,526	285,710
事務過誤損失	9	596
特別損失計	225,535	286,306
税引前当期純利益	3,579,369	3,453,794
法人税、住民税及び事業税	799,824	1,212,425
法人税等調整額	(769,601)	(136,204)
法人税等合計	30,223	1,076,221
当期純利益	3,549,146	2,377,574



## （ 3 ）【株主資本等変動計算書】

第31期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本				株主資本合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		
			その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	100,000	13,004,488	13,104,488	14,104,488
当期変動額					
当期純利益	-	-	3,549,146	3,549,146	3,549,146
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	3,549,146	3,549,146	3,549,146
当期末残高	1,000,000	100,000	16,553,634	16,653,634	17,653,634

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	125,824	125,824	14,230,313
当期変動額			
当期純利益	-	-	3,549,146
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	125,824	125,824	125,824
当期変動額合計	125,824	125,824	3,423,322
当期末残高	-	-	17,653,634

第32期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本				株主資本合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		
			その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	100,000	16,553,634	16,653,634	17,653,634
当期変動額					
当期純利益	-	-	2,377,574	2,377,574	2,377,574
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	2,377,574	2,377,574	2,377,574
当期末残高	1,000,000	100,000	18,931,208	19,031,208	20,031,208

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	-	-	17,653,634
当期変動額			
当期純利益	-	-	2,377,574
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-
当期変動額合計	-	-	2,377,574
当期末残高	-	-	20,031,208

## 重要な会計方針

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## その他有価証券

## 時価のあるもの

期末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は総平均法により算定）を採用しております。

## 時価のないもの

総平均法による原価法を採用しております。

## 2. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

債権等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当期末において発生していると認められる額を計上しております。退職給付見込額を当期までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。過去勤務債務については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による按分額を定額法により費用処理しております。数理計算上の差異については、発生年度に全額費用処理しております。

## (3) 賞与引当金、長期賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、賞与支給見込額の当期負担額を計上しております。

## 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (未適用の会計基準等)

## 第32期

自 平成29年4月1日

至 平成30年3月31日

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）

「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

## (1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

## (2) 適用予定日

平成34年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 注記事項

(貸借対照表関係)

\*1 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。

	第31期 (平成29年3月31日)	第32期 (平成30年3月31日)
未収入金	153,988 千円	75,889 千円
その他未払金	2,076,244 千円	2,274,334 千円
長期貸付金	20,030,000 千円	21,400,000 千円

(損益計算書関係)

\*1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	第31期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)	第32期 (自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日)
営業費用	12,599,807 千円	13,524,345 千円
受取利息	48,779 千円	57,463 千円

(株主資本等変動計算書関係)

第31期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				
普通株式	20,000株	-	-	20,000株
合計	20,000株	-	-	20,000株

第32期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				
普通株式	20,000株	-	-	20,000株
合計	20,000株	-	-	20,000株

(リース取引関係)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用について短期的な預金及びグループ会社への貸付金に限定しております。また、所要資金は自己資金で賄っており、銀行借入、社債発行等による資金調達は行っていません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金は、銀行の信用リスクに晒されておりますが、預金に関しては数行に分散して預入しており、リスクの軽減を図っております。営業債権である未収委託者報酬および未収収益、未収入金については、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。未収入金及びその他未払金の一部には、海外の関連会社との取引により生じた外貨建ての資産・負債を保有しているため、為替相場の変動による市場リスクに晒されております。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

預金に係る銀行の信用リスクに関しては、口座開設時及びその後も継続的に銀行の信用力を評価し、格付けの高い金融機関でのみで運用し、預金に係る信用リスクを管理しております。未収委託者報酬及び未収収益は、投資信託または取引相手ごとに残高を管理し、当社が運用している資産の中から報酬を徴収するため、信用リスクは僅少であります。また、未収入金は、概ね、海外の関連会社との取引により生じたものであり、原則、翌月中に決済が行われる事により、回収が不能となるリスクは僅少であります。

## 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は、原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、外貨建ての債権債務に関する為替の変動リスクに関しては、個別の案件ごとに毎月残高照合等を行い、リスクを管理しております。

## 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

## 2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません。

## 第31期（平成29年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	881,556	881,556	-
(2) 未収委託者報酬	5,342,216	5,342,216	-
(3) 未収入金	286,806	286,806	-
(4) 長期貸付金	21,722,618	21,722,618	-
資産計	28,233,196	28,233,196	-
(1) 未払手数料	2,371,159	2,371,159	-
(2) その他未払金	2,767,150	2,767,150	-
負債計	5,138,309	5,138,309	-

## 第32期（平成30年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	975,413	975,413	-
(2) 未収委託者報酬	5,464,066	5,464,066	-
(3) 未収収益	1,921,861	1,921,861	-
(4) 未収入金	365,790	365,790	-
(5) 長期貸付金	22,863,900	22,863,900	-
資産計	31,591,030	31,591,030	-
(1) 未払手数料	2,425,583	2,425,583	-
(2) その他未払金	2,622,149	2,622,149	-
負債計	5,047,732	5,047,732	-

## (注) 1. 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## 第31期（平成29年3月31日）

## 資 産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収入金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(4) 長期貸付金

変動金利によるものであり、時価はほぼ帳簿価額に等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## 負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金

短期間で決済され、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

第32期(平成30年3月31日)

資 産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、(4) 未収入金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 長期貸付金

変動金利によるものであり、時価はほぼ帳簿価額に等しいことから、当該帳簿価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金

短期間で決済され、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注) 2. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期(平成29年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金及び預金	881,556	-	-	-
未収委託者報酬	5,342,216	-	-	-
未収入金	286,806	-	-	-
合計	6,510,579	-	-	-

金銭債権のうち長期貸付金(21,722,618千円)については、契約上返済期限の定めがないため、上記に含めておりません。

第32期(平成30年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金及び預金	975,413	-	-	-
未収委託者報酬	5,464,066	-	-	-
未収収益	1,921,861	-	-	-
未収入金	365,790	-	-	-
合計	8,727,132	-	-	-

金銭債権のうち長期貸付金(22,863,900千円)については、契約上返済期限の定めがないため、上記に含めておりません。

(有価証券関係)

第31期(平成29年3月31日)

1. その他有価証券  
該当事項はありません。

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

売却額(千円)	売却益の合計(千円)	売却損の合計(千円)
322,623	148,786	-

第32期(平成30年3月31日)

1. その他有価証券  
該当事項はありません。
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)  
該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

## (退職給付関係)

第31期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は確定給付型年金制度及び確定拠出型年金制度を採用しております。

## 2. 確定給付型年金制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(千円)
退職給付債務の期首残高	5,434,582
勤務費用	211,876
利息費用	9,092
数理計算上の差異の発生額	13,576
退職給付の支払額	532,305
制度改定による変動額	-
為替変動による影響額	51,769
その他	3,080
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>5,081,972</u>

## (2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(千円)
非積立型制度の退職給付債務	5,081,972
未認識過去勤務費用	12,318
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>5,094,290</u>
<u>退職給付引当金</u>	<u>5,094,290</u>
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>5,094,290</u>

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	211,876
利息費用	9,092
数理計算上の差異の費用処理額	13,576
過去勤務債務の費用処理額	3,045
<u>確定給付型年金制度に係る退職給付費用</u>	<u>231,499</u>

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は97,624千円であります。

第32期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は確定給付型年金制度及び確定拠出型年金制度を採用しております。

2. 確定給付型年金制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(千円)
退職給付債務の期首残高	5,081,972
勤務費用	195,462
利息費用	10,317
数理計算上の差異の発生額	59,517
退職給付の支払額	315,132
制度改定による変動額	-
為替変動による影響額	130,690
その他	5,965
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>4,776,447</u>

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(千円)
非積立型制度の退職給付債務	4,776,447
未認識過去勤務費用	9,743
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>4,786,190</u>
<u>退職給付引当金</u>	<u>4,786,190</u>
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>4,786,190</u>

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	195,462
利息費用	10,317
数理計算上の差異の費用処理額	59,517
過去勤務債務の費用処理額	2,575
<u>確定給付型年金制度に係る退職給付費用</u>	<u>143,687</u>

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は90,790千円であります。

(ストック・オプション等関係)

該当事項はありません。

(税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第31期 (平成29年3月31日)	第32期 (平成30年3月31日)
(流動)	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払費用	178,920	186,465
賞与引当金	518,171	561,152
その他	28,302	62,704
繰延税金資産合計	725,393	810,321
繰延税金負債		
未払金	271,851	202,748
繰延税金資産又は繰延税金負債( )の純額	453,542	607,573
(固定)	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,567,372	1,473,419
資産除去債務	2,685	2,685
その他	69,626	81,708
繰延税金資産小計	1,639,683	1,557,812
評価性引当額	806,442	765,291
繰延税金資産合計	833,241	792,521
繰延税金負債		
長期貸付金	36,976	14,084
繰延税金資産又は繰延税金負債( )の純額	796,264	778,437

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	第31期 (平成29年3月31日)	第32期 (平成30年3月31日)
法定実効税率	30.86%	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.67%	1.32%
評価性引当額	31.49%	1.47%
過年度法人税等	0.08%	0.27%
税率変更差異	0.00%	0.00%
その他	0.12%	0.42%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	0.84%	31.16%

(持分法損益等)

該当事項はありません。



## （企業結合等関係）

該当事項はありません。

## （資産除去債務関係）

当社は建物所有者との間で事業用不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと思われる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

## （賃貸等不動産関係）

該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

## セグメント情報

第31期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）及び 第32期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

当社は資産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

第31期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

## 1. サービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託の運用	投資顧問業	合計
外部顧客への売上高	47,434,300	2,071,319	49,505,619

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

本邦の外部顧客への売上高が損益計算書の売上高の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

（単位：千円）

投資信託の名称	委託者報酬	関連するサービスの種類
フィデリティ・US リート・ファンドB（為替ヘッジなし）	18,437,379	投資信託の運用
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	12,375,032	投資信託の運用
フィデリティ・日本成長株・ファンド	4,758,201	投資信託の運用

第32期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

## 1. サービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託の運用	投資顧問業	合計
外部顧客への売上高	47,015,140	2,583,082	49,598,222

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

本邦の外部顧客への売上高が損益計算書の売上高の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

（単位：千円）

投資信託の名称	委託者報酬	関連するサービスの種類
フィデリティ・US リート・ファンドB（為替ヘッジなし）	14,973,284	投資信託の運用
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	13,887,634	投資信託の運用
フィデリティ・日本成長株・ファンド	5,377,121	投資信託の運用

## 関連当事者情報

第31期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称	会社等の所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
親会社	FIL Limited	英領バ ミュー ダ、ベン ブローク 市	千米ドル  6,981	投資 顧問業	被所有 間接 100 %	投資顧問契 約の再委任 等役員の兼 任	委託調査 等報酬 （注3）  共通発生 経費負担額 （注4）	千円  148,301  9,369,491	未収入金  未払金	千円  50,544  774,378
親会社	フィデ リティ・ジャ パン・ホール ディングス株 式会社	東京都 港区	千円  4,510,000	グループ 会社経営 管理	被所有 直接 100 %	当社事業 活動の管 理等役員 の兼任	金銭の貸付 （注1）  利息の受取 （注1） 共通発生 経費負担額 （注4） 連結法人税の 個別帰属額 固定資産の 譲渡	千円  3,790,000  48,780  275,171  -  1,363,103	長期 貸付金  未収入金  未払金  未払金  未払金	千円  20,030,000  15,988  135,607  588,819  -
親会社	FIL Asia Holdings Pte. Limited	シンガ ポール、ブル バード市	千米ドル  215,735	グループ 会社経営 管理	被所有 間接 100%	営業取引	共通発生 経費負担額 （注4）	千円  2,837,501	未払金	千円  410,638

## (2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

属性	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
同一の親会社をもつ会社	フィデリティ証券株式会社	東京都港区	千円	証券業	なし	当社設定投資信託の募集・販売	共通発生経費負担額(注4)	千円	未払金	千円
			8,157,500				752,870	46,354		
同一の親会社をもつ会社	FIL Investment Management (Hong Kong) Limited	香港、セントラル市	千米ドル	証券投資顧問業	なし	当社事業活動へのサービスの提供	共通発生経費負担額(注4)	千円	未払金	千円
			22,897				930,544	91,375		
同一の親会社をもつ会社	FIL (Luxembourg) S.A.	ルクセンブルグ、ルクセンブルグ市	千米ドル	証券投資顧問業	なし	商標使用契約	ロイヤリティの支払	千円	未払金	千円
			1,622					1,414,418		282,976

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1)資金の貸付については、市場金利等を勘案して利率を合理的に決定しております。

(注2)取引金額には消費税等を含めておりません。期末残高には消費税等を含めております。

(注3)当社の主要な事業領域である投信・投資顧問業から包括的に発生する収益であります。

(注4)共通発生経費については、直課可能なものは実際発生額に基づき、直課不可能なものは各社の規模に応じた一定の比率により負担しております。

(注5)代行手数料については、一般取引条件を基に、両社協議の上合理的に決定しております。

第32期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称	会社等の所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
親会社	FIL Limited	英領バ ミュー ダ、ベン ブローク 市	千米ドル  6,825	投資 顧問業	被所有 間接 100 %	投資顧問契 約の再委任 等役員の兼 任	委託調査 等報酬 （注3）	千円  41,611	未収入金	千円  55,710
							共通発生 経費負担額 （注4）	9,313,596	未払金	565,117
親会社	フィデリ ティ・ジャ パン・ホー ルディン グス株式 会社	東京都 港区	千円  4,510,000	グループ 会社経営 管理	被所有 直接 100 %	当社事業 活動の管 理等役員 の兼任	金銭の貸付 （注1）	千円  1,370,000	長期 貸付金	千円  21,400,000
							利息の受取 （注1）	57,463	未収入金	20,178
							共通発生 経費負担額 （注4）	525,884	未払金	100,806
							連結法人税の 個別帰属額	-	未払金	926,608
親会社	FIL Asia Holdings Pte. Limited	シンガ ポール、 ブルバ ード市	千米ドル  189,735	グループ 会社経営 管理	被所有 間接 100%	営業取引	共通発生 経費負担額 （注4）	千円  3,456,684	未払金	千円  681,294

## (2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

属性	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
同一の親会社をもつ会社	フィデリティ証券株式会社	東京都港区	千円 8,557,500	証券業	なし	当社設定投資信託の募集・販売	共通発生経費負担額（注4） 投資信託販売に係る代行手数料（注5）	千円 648,819 1,046,990	未収入金 未払金	千円 9,821 206,260
同一の親会社をもつ会社	FIL Investment Management (Hong Kong) Limited	香港、セントラル市	千米ドル 22,897	証券投資顧問業	なし	当社事業活動へのサービスの提供	共通発生経費負担額（注4）	千円 1,025,434	未払金	千円 60,135
同一の親会社をもつ会社	FIL (Luxembourg) S.A.	ルクセンブルグ、ルクセンブルグ市	千米ドル 1,676	証券投資顧問業	なし	商標使用契約	ロイヤリティの支払	千円 1,033,326	未払金	千円 29,993

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資金の貸付については、市場金利等を勘案して利率を合理的に決定しております。

(注2) 取引金額には消費税等を含めておりません。期末残高には消費税等を含めております。

(注3) 当社の主要な事業領域である投信・投資顧問業から包括的に発生する収益であります。

(注4) 共通発生経費については、直課可能なものは実際発生額に基づき、直課不可能なものは各社の規模に応じた一定の比率により負担しております。

(注5) 代行手数料については、一般取引条件を基に、両社協議の上合理的に決定しております。

## (1株当たり情報)

	第31期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)	第32期 (自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	882,681円74銭	1,001,560円45銭
1株当たり当期純利益	177,457円33銭	118,878円71銭

(注1) 1. なお潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純損失金額又は1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第31期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)	第32期 (自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(千円)	3,549,146	2,377,574
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	3,549,146	2,377,574
期中平均株式数	20,000株	20,000株

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 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】

原届出書「第三部 委託会社等の情報 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」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

ファンドの運営における役割	名称	資本金の額 (2018年3月末日現在)	事業の内容
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。
<参考情報> 再信託受託会社	日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	51,000百万円	
販売会社	カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	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。
	大和証券株式会社	100,000百万円	
	野村証券株式会社	10,000百万円	
	岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	
	フィデリティ証券株式会社	8,557百万円	
	S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
	株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	
	ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
	楽天証券株式会社	7,495百万円	
	マネックス証券株式会社	12,200百万円	
	高木証券株式会社	11,069百万円	
	静銀ティーエム証券株式会社	3,000百万円	
	エース証券株式会社	8,831百万円	
西日本シティ T T 証券株式会社	3,000百万円		
松井証券株式会社	11,945百万円		

	三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。
	株式会社名古屋銀行	25,090百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
	株式会社京都銀行	42,103百万円	
	株式会社三重銀行	15,295百万円	
	株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958百万円	
	株式会社北越銀行	24,500百万円	
	株式会社イオン銀行	51,250百万円	
	株式会社新生銀行	512,204百万円	
	株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
	株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	
	株式会社大垣共立銀行	46,733百万円	
	ソニー銀行株式会社	31,000百万円	
	スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
	株式会社北陸銀行	140,409百万円	
	日本生命保険相互会社	1,350,000百万円 <sup>*</sup> * 相互会社であるため、「基金」の額です。	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
	明治安田生命保険相互会社	880,000百万円 <sup>*</sup> * 相互会社であるため、「基金」の額です。	
運用の委託先	FILインベストメンツ・インターナショナル	225,365英ポンド (約34百万円 <sup>*</sup> ) * 1英ポンド151.95円で換算 (2017年12月末日現在)	主として英国およびヨーロッパにおいて投資信託の販売および投資信託会社に対する投資運用業務を営んでいます。
	フィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニー	7,950米ドル (約0.89百万円 <sup>*</sup> ) * 1米ドル113.00円で換算 (2017年12月末日現在)	主として米国においてファンドに対する投資顧問業務を営んでいます。

# 独立監査人の監査報告書

平成30年9月12日

フィデリティ投信株式会社  
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているフィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）の平成30年1月23日から平成30年7月20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。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、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。

## 監査意見

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、フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）の平成30年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべ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。

## 利害関係

フィデリティ投信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

（注）1． 上記は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データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)



# 独立監査人の監査報告書

平成30年9月12日

フィデリティ投信株式会社  
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているフィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）の平成30年1月23日から平成30年7月20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。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、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。

## 監査意見

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、フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）の平成30年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべ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。

## 利害関係

フィデリティ投信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

（注）1． 上記は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データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成30年6月15日

フィデリティ投信株式会社  
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているフィデリティ投信株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、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監査を行った。

**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。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、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。

**監査意見**

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、フィデリティ投信株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべ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。

**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

(注) 1. 上記は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データは監査の対象には含まれていません。