

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年10月17日提出
【発行者名】	フィデリティ投信株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 デレック・ヤング
【本店の所在の場所】	東京都港区六本木七丁目7番7号
【事務連絡者氏名】	照沼 加奈子
【電話番号】	03 - 4560 - 6000
【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】	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)
【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】	各ファンドにつき2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出致しましたので、2019年4月17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。

第一部【証券情報】

（４）【発行（売出）価格】

<訂正前>

（略）

発行価格の基準となる基準価額につきましては、委託会社のホームページ（アドレス：<http://www.fidelity.co.jp/fij/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞に掲載されます。（日本経済新聞においては、ファンドは、「悠々債券A付」および「悠々債券B無」として略称で掲載されています。）

<訂正後>

（略）

発行価格の基準となる基準価額につきましては、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞に掲載されます。（日本経済新聞においては、ファンドは、「悠々債券A付」および「悠々債券B無」として略称で掲載されています。）

（５）【申込手数料】

<訂正前>

申込手数料率は3.24%^{*}（税抜 3.00%）を超えないものとします。なお、申込手数料率の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<http://www.fidelity.co.jp/fij/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

* 上記手数料率には、申込手数料に係る消費税等相当額が含まれております。消費税率が10%となった場合は、3.30%となります。

（略）

<訂正後>

申込手数料率は3.30%^{*}（税抜 3.00%）を超えないものとします。なお、申込手数料率の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

* 上記手数料率には、申込手数料に係る消費税等相当額が含まれております。

（略）

（６）【申込単位】

<訂正前>

（略）

販売会社の申込単位の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<http://www.fidelity.co.jp/fij/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

<訂正後>

（略）

販売会社の申込単位の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：
<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051
（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

（ 8 ）【申込取扱場所】

< 訂正前 >

（略）

販売会社の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：
<http://www.fidelity.co.jp/fij/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 -
8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））までお問い合わせください。（ただし、販売会
社によってはAコース・Bコースどちらか一方のみの取扱いを行なう場合があります。）

< 訂正後 >

（略）

販売会社の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：
<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051
（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））までお問い合わせください。（ただし、販売会社に
よってはAコース・Bコースどちらか一方のみの取扱いを行なう場合があります。）

（ 10 ）【払込取扱場所】

< 訂正前 >

（略）

販売会社の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：
<http://www.fidelity.co.jp/fij/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 -
8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））までお問い合わせください。

< 訂正後 >

（略）

販売会社の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：
<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051
（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））までお問い合わせください。

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）

（注）上記各表のうち、網掛け表示のない商品分類および属性区分の定義について、詳しくは一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス：<http://www.toushin.or.jp>）をご覧ください。

（略）

<訂正後>

（略）

ファンドの基本的性格

（略）

（注）上記各表のうち、網掛け表示のない商品分類および属性区分の定義について、詳しくは一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス：<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（略）

（3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（略）

委託会社およびファンドの関係法人

（略）

- ・ フィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニー（FMR Co）は、北米の投資家向けの資産運用サービス、およびFMR LLCが提供するミューチュアル・ファンド商品群の運用を行なう事を目的に1946年に設立されました。株式、ハイ・イールド債券、債券、マネー・マーケット、オルタナティブを含む全ての主要資産クラスを対象とした運用を行なっています。

（略）

委託会社の概況（2019年2月末日現在）

（略）

<訂正後>

（略）

委託会社およびファンドの関係法人

(略)

- ・ フィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニー（FMR Co）は、北米の投資家向けの資産運用サービス、およびFMR LLCが提供するミューチュアル・ファンド商品群の運用を行なう事を目的に1946年に設立されました。株式、ハイ・イールド債券、債券、マネー・マーケット、オルタナティブを含む全ての主要資産クラスを対象とした運用を行なっています。

運用担当者の変更等により、運用の指図に関する権限の委託^{*}について、委託会社または委託先のグループ会社間における運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等を変更する場合があります。なお、この場合においても、基本的にファンドに係る運用方針や運用スタイル等が変更されるものではありません。*再委託も含まれます。

(略)

委託会社の概況（2019年8月末日現在）

(略)

2【投資方針】

（１）【投資方針】

<訂正前>

（略）

運用方針

（略）

上記の文中で示された考え方は、2019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。

<訂正後>

（略）

運用方針

（略）

上記の文中で示された考え方は、2019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）【運用体制】

<訂正前>

（略）

上記「（３）運用体制」の内容は、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

（略）

上記「（３）運用体制」の内容は、今後変更となる場合があります。

運用担当者の変更等により、運用の指図に関する権限の委託^{*}について、委託会社または委託先のグループ会社間における運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等を変更する場合があります。なお、この場合においても、基本的にファンドに係る運用方針や運用スタイル等が変更されるものではありません。*再委託も含まれます。

3【投資リスク】

<訂正前>

（略）

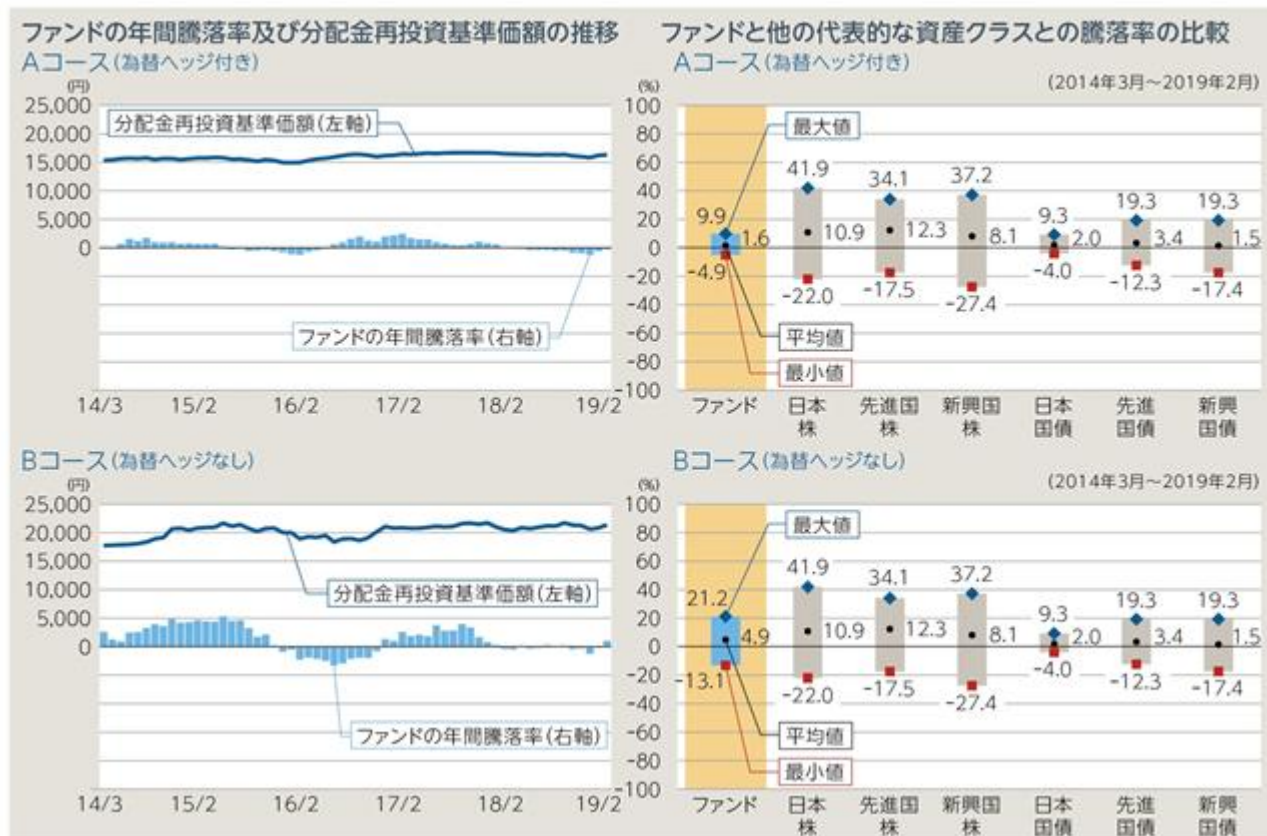
(2) 投資リスクの管理体制

（略）

インベストメント・リスク・オーバーサイト・コミッティは、商品開発部門、パフォーマンス分析部門、運用に関するコンプライアンス部門のメンバー等から構成されており、日本株式以外を主たる投資対象とするファンドや外部運用委託を行なっているファンド等の運用が、その投資目的や運用方針に準拠しているかを検証しています。同コミッティは、原則として月次で開催され、必要に応じて適宜開催されます。

（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」は、ファンドの2014年3月～2019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、当騰落率は目録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。

※2014年3月～2019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 (東東京証券取引所) 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東証東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東証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、東証東京証券取引所は、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）

(2) 投資リスクの管理体制

（略）

インベストメント・リスク・オーバーサイト・コミッティは、商品開発部門、パフォーマンス分析部門、運用に関するコンプライアンス部門のメンバー等から構成されており、日本株式以外を主たる投資対象とするファンドや外部運用委託を行なっているファンド等の運用が、その投資目的や運用方針に準拠しているかを検証しています。同コミッティは、原則として月次で開催され、必要に応じて適宜開催されます。

投資リスクの管理体制は変更となる場合がありますが、ファンドの基本的なリスクの管理体制が変更されるものではありません。

（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）



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2014年9月～2019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。

※2014年9月～2019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 (東東京証券取引所) 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東東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東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、東東京証券取引所は、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。

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

<訂正前>

申込手数料率は3.24%^{*}（税抜 3.00%）を超えないものとします。なお、申込手数料率の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<http://www.fidelity.co.jp/fij/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

（略）

* 上記手数料率には、申込手数料に係る消費税等相当額が含まれております。消費税率が10%となった場合は、3.30%となります。

（略）

<訂正後>

申込手数料率は3.30%^{*}（税抜 3.00%）を超えないものとします。なお、申込手数料率の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

（略）

* 上記手数料率には、申込手数料に係る消費税等相当額が含まれております。

（略）

（３）【信託報酬等】

<訂正前>

信託報酬（消費税等相当額を含みます。）の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.5444%^{*}（税抜 1.43%）の率を乗じて得た額とします。

* 消費税率が10%となった場合は、年率1.573%となります。

（略）

<訂正後>

信託報酬（消費税等相当額を含みます。）の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.573%（税抜 1.43%）の率を乗じて得た額とします。

（略）

（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、2019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）

2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記「(5)課税上の取扱い」の記載は、2019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）

（2019年8月30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	44,935,272,089	99.93
預金・その他の資産（負債控除後）	-	29,287,139	0.07
合計（純資産総額）		44,964,559,228	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

（2019年8月30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	43,675,702,720	97.13

（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）

（2019年8月30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	5,494,120,981	100.04
預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,457,053	0.04
合計（純資産総額）		5,491,663,928	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

（2019年8月30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	209,621,351	0.37
	ルクセンブルグ	31,336,285	0.06
	小計	240,957,636	0.43
新株予約権証券	カナダ	0	0.00
	小計	0	0.00
国債証券	アメリカ	15,314,486,495	27.32
	ドイツ	2,753,204,609	4.91
	日本	1,426,511,899	2.55
	イギリス	1,418,604,209	2.53
	カナダ	1,393,203,480	2.49
	イスラエル	1,226,968,300	2.19
	ウクライナ	735,273,979	1.31
	トルコ	535,070,377	0.95
	イタリア	508,041,970	0.91
	オランダ	356,042,484	0.64
	エジプト	338,269,395	0.60
	インドネシア	334,398,818	0.60
	ロシア	290,683,462	0.52
	アルゼンチン	254,404,801	0.45
	フランス	253,766,904	0.45
	ヨルダン	185,363,537	0.33
	スペイン	185,318,419	0.33
	ベトナム	174,306,384	0.31
	ポルトガル	168,538,500	0.30
	カタール	162,060,204	0.29
	メキシコ	160,536,165	0.29
	ブラジル	156,129,882	0.28
	エルサルバドル	151,454,898	0.27
	ドミニカ共和国	129,735,967	0.23
	レバノン	121,502,755	0.22
	サウジアラビア	110,965,164	0.20
	イラク	104,064,650	0.19
	スリランカ	76,921,060	0.14
	カメルーン	61,113,746	0.11
	コートジボアール	59,962,207	0.11
	ヴェネズエラ	55,880,854	0.10
	ナイジェリア	51,441,807	0.09
ガーナ	46,337,226	0.08	
エクアドル	44,733,151	0.08	

	オマーン	41,692,903	0.07
	ベラルーシ	36,791,511	0.07
	パキスタン	32,713,316	0.06
	ルーマニア	31,660,539	0.06
	グアテマラ	22,848,871	0.04
	バミューダ	19,397,012	0.03
	コスタリカ	17,463,491	0.03
	アンゴラ	12,603,533	0.02
	ルワンダ	11,820,940	0.02
	モンゴル	8,306,818	0.01
	パラグアイ	8,037,879	0.01
	カザフスタン	7,731,658	0.01
	モロッコ	6,489,056	0.01
	アゼルバイジャン	3,973,886	0.01
	ジャマイカ	2,478,517	0.00
	パプアニューギニア	1,678,230	0.00
	小計	29,610,985,918	52.83
地方債証券	アルゼンチン	149,267,225	0.27
	小計	149,267,225	0.27
特殊債券	メキシコ	485,783,287	0.87
	アメリカ	343,412,637	0.61
	イギリス領バージン諸島	101,835,378	0.18
	南アフリカ	42,584,000	0.08
	アルゼンチン	40,706,738	0.07
	ヴェネズエラ	33,069,138	0.06
	モンゴル	21,737,642	0.04
	チュニジア	20,886,121	0.04
	トルコ	15,709,504	0.03
	インドネシア	13,277,478	0.02
	ブラジル	4,076,577	0.01
	小計	1,123,078,500	2.00
社債券	アメリカ	15,122,066,925	26.98
	オランダ	1,049,187,077	1.87
	ルクセンブルグ	823,072,073	1.47
	カナダ	814,445,023	1.45
	ケイマン諸島	546,893,334	0.98
	マーシャル諸島	373,852,750	0.67
	フランス	271,936,383	0.49
	イギリス	255,786,353	0.46
	アイルランド	177,227,534	0.32
	サウジアラビア	126,330,706	0.23
	メキシコ	122,926,269	0.22
	トルコ	108,680,804	0.19

ブラジル	104,020,794	0.19	
アルゼンチン	81,442,562	0.15	
南アフリカ	78,102,463	0.14	
ロシア	65,987,741	0.12	
バミューダ	61,507,265	0.11	
オーストラリア	57,365,173	0.10	
インドネシア	52,468,348	0.09	
グルジア	51,409,348	0.09	
オーストリア	47,486,483	0.08	
ウクライナ	45,502,864	0.08	
バーレーン	43,471,408	0.08	
モンゴル	33,464,541	0.06	
シンガポール	32,776,373	0.06	
アゼルバイジャン	32,607,953	0.06	
ナイジェリア	29,716,265	0.05	
イギリス領バージン諸島	21,549,910	0.04	
グアテマラ	21,450,583	0.04	
アラブ首長国連邦	20,939,192	0.04	
モーリシャス	17,664,354	0.03	
トーゴ	10,569,434	0.02	
カザフスタン	10,033,003	0.02	
小計	20,711,941,288	36.95	
預金・その他の資産（負債控除後）	-	4,212,776,346	7.52
合計（純資産総額）		56,049,006,913	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

（2019年8月30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（買建）	日本	676,772,369	1.21
為替予約取引（売建）	日本	20,074,336	0.04
貸付債権	アメリカ	1,089,210,873	1.94

（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)

(2019年8月30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	15,135,326,919	2.9522	44,682,600,581	2.9689	44,935,272,089	99.93

Bコース(為替ヘッジなし)

(2019年8月30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	1,850,557,776	2.9521	5,463,032,380	2.9689	5,494,120,981	100.04

種類別投資比率

Aコース(為替ヘッジ付き)

(2019年8月30日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.93

Bコース(為替ヘッジなし)

(2019年8月30日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.04

(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

(2019年8月30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	USTB 2.50% 02/15/45	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	13,926,000	10,507.92 1,463,333,131	11,814.08 1,645,228,658	2.500 2045/02/15	2.94
2	USTN 2.5% 01/31/21	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	14,853,000	10,743.30 1,595,703,008	10,767.36 1,599,276,634	2.500 2021/01/31	2.85
3	AID 5.5% 9/18/23	アメリカ・ドル イスラエル	国債証券	9,969,000	12,144.42 1,210,677,678	12,297.94 1,225,981,620	5.500 2023/09/18	2.19
4	GERMANY GOVT 0% 6/12/20 RGS	ユーロ ドイツ	国債証券	10,271,125	11,835.84 1,215,674,059	11,835.11 1,215,598,652	0.000 2020/06/12	2.17
5	UST NOTES 2.5% 01/15/2022	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	10,232,000	10,826.02 1,107,718,761	10,891.71 1,114,439,734	2.500 2022/01/15	1.99
6	USTN 2.25% 07/31/21	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	10,200,000	10,735.31 1,095,002,633	10,781.95 1,099,758,840	2.250 2021/07/31	1.96
7	323 10年国債	日本・円 日本	国債証券	998,500,000	103.23 1,030,756,072	103.43 1,032,728,580	0.900 2022/06/20	1.84
8	UST NOTES 2.875% 11/30/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	8,121,000	11,264.31 914,775,401	11,550.48 938,014,818	2.875 2025/11/30	1.67
9	USTN 2.75% 06/30/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	7,912,000	11,165.73 883,433,168	11,421.99 903,707,606	2.750 2025/06/30	1.61
10	USTB 3% 02/15/49	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	6,300,000	11,564.53 728,565,823	13,123.64 826,789,545	3.000 2049/02/15	1.48
11	GERMANY GVT .25% 02/15/29 REGS	ユーロ ドイツ	国債証券	6,150,000	12,628.07 776,626,725	12,893.78 792,967,297	0.250 2029/02/15	1.41
12	UK GILT 4.25% 12/07/27	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	4,580,000	16,813.24 770,046,447	17,178.06 786,755,202	4.250 2027/12/07	1.40
13	USTN 2.25% 12/31/24	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	6,923,000	10,868.39 752,418,981	11,095.90 768,169,154	2.250 2024/12/31	1.37
14	USTB 6.125%	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,622,000	14,589.91 674,345,971	15,192.59 702,201,381	6.125 2029/08/15	1.25
15	USTB 4.75% 2/15/37	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,128,000	14,485.16 597,947,426	15,588.83 643,506,957	4.750 2037/02/15	1.15
16	UST NOTES 2% 07/31/2024	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	5,738,000	10,798.98 619,645,645	10,996.89 631,001,672	2.125 2024/07/31	1.13
17	USTN 2.5% 12/31/20	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	5,039,000	10,734.57 540,915,220	10,756.19 542,004,217	2.500 2020/12/31	0.97
18	INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	アメリカ・ドル オランダ	社債券	5,535,000	9,687.86 536,223,051	9,687.86 536,223,051	7.000 2023/06/30	0.96
19	BTP 3.85% 09/01/49 144A RGS	ユーロ イタリア	国債証券	3,050,000	14,627.76 446,146,711	16,657.11 508,041,970	3.850 2049/09/01	0.91
20	UK GILT 2.5% 07/22/65 REGS	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	2,275,000	18,467.21 420,129,029	20,781.74 472,784,555	2.500 2065/07/22	0.84
21	USTN 1.75% 06/30/22	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,374,000	10,638.01 465,306,797	10,731.17 469,381,288	1.750 2022/06/30	0.84

22	ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	2,919,000	14,155.98 413,213,237	14,931.02 435,836,327	8.000 2031/11/01	0.78
23	CANADA GOVT 1.5% 09/01/24	カナダ・ドル カナダ	国債証券	5,200,000	8,140.53 423,307,969	8,133.89 422,962,214	1.500 2024/09/01	0.75
24	USTN 2.125% 12/31/22	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	3,529,000	10,765.76 379,923,935	10,882.55 384,045,334	2.125 2022/12/31	0.69
25	TENET HEALTHCAR 8.125% 4/22 WI	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	3,240,000	11,204.91 363,039,246	11,471.06 371,662,506	8.125 2022/04/01	0.66
26	NETHERLANDS GOVT .25% 7/29 RGS	ユーロ オランダ	国債証券	2,800,000	12,367.97 346,303,190	12,715.80 356,042,484	0.250 2029/07/15	0.64
27	GERMANY FEDERAL REPUBLIC OF 0%	ユーロ ドイツ	国債証券	2,900,000	12,174.62 353,064,092	12,275.63 355,993,314	0.000 2024/04/05	0.64
28	USTN 2.25% 04/15/22	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	3,000,000	10,773.64 323,209,366	10,855.09 325,652,623	2.250 2022/04/15	0.58
29	9 40年国債	日本・円 日本	国債証券	283,000,000	99.84 282,547,200	108.66 307,510,629	0.400 2056/03/20	0.55
30	CANADA GOVT 1.25% 11/01/19	カナダ・ドル カナダ	国債証券	3,770,000	8,001.58 301,659,676	8,004.27 301,761,007	1.250 2019/11/01	0.54

(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

(2019年8月30日現在)

種類	国内/外国	業種/種別	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	0.06
		素材	0.00
		運輸	0.07
		食品・生活必需品小売り	0.09
		公益事業	0.21
	小計		0.43
新株予約権証券	外国	-	0.00
	小計		0.00
公社債券	国内	国債証券	2.55
		小計	2.55
	外国	国債証券	50.29
		地方債証券	0.27
		特殊債券	2.00
		社債券	36.95
		小計	89.51
合計(対純資産総額比)			92.48

【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)

(2019年8月30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	8,466,000	1,103,234,938	1,096,770,300	2.44
	カナダ・ドル	売建	14,180,600	1,132,903,733	1,134,022,582	2.52
	ユーロ	売建	28,942,700	3,415,918,753	3,404,819,228	7.57
	アメリカ・ドル	売建	358,125,500	38,072,325,968	38,040,090,610	84.60

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

(2019年8月30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	買建	6,170,625	657,069,807	656,677,972	1.17
	カナダ・ドル	買建	250,897	20,000,769	20,094,397	0.04
	アメリカ・ドル	売建	188,633	20,000,769	20,074,336	0.04
貸付債権	アメリカ・ドル	-	10,544,177.74	1,100,945,523	1,089,210,873	1.94

(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】

2019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)
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

2019年1月21日 (第41特定期間)	48,511	48,671	0.6067	0.6087
2019年7月22日 (第42特定期間)	45,222	45,369	0.6141	0.6161
2018年8月末日	53,285	-	0.6232	-
2018年9月末日	52,315	-	0.6224	-
2018年10月末日	50,457	-	0.6109	-
2018年11月末日	49,221	-	0.6047	-
2018年12月末日	47,876	-	0.5960	-
2019年1月末日	48,433	-	0.6084	-
2019年2月末日	48,071	-	0.6104	-
2019年3月末日	47,639	-	0.6126	-
2019年4月末日	46,808	-	0.6118	-
2019年5月末日	46,235	-	0.6107	-
2019年6月末日	46,045	-	0.6173	-
2019年7月末日	45,148	-	0.6152	-
2019年8月末日	44,964	-	0.6183	-

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)
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
2019年1月21日 (第41特定期間)	6,567	6,621	0.6115	0.6165
2019年7月22日 (第42特定期間)	5,884	5,908	0.6141	0.6166
2018年8月末日	6,936	-	0.6456	-
2018年9月末日	7,002	-	0.6568	-

2018年10月末日	6,754	-	0.6401	-
2018年11月末日	6,811	-	0.6329	-
2018年12月末日	6,542	-	0.6091	-
2019年1月末日	6,564	-	0.6108	-
2019年2月末日	6,665	-	0.6237	-
2019年3月末日	6,486	-	0.6264	-
2019年4月末日	6,220	-	0.6302	-
2019年5月末日	5,994	-	0.6162	-
2019年6月末日	5,948	-	0.6162	-
2019年7月末日	5,879	-	0.6185	-
2019年8月末日	5,491	-	0.6093	-

【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
第41特定期間（236期～241期計算期間合計）	0.0120
第42特定期間（242期～247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
第41特定期間(236期~241期計算期間合計)	0.0300
第42特定期間(242期~247期計算期間合計)	0.0150

【収益率の推移】

Aコース（為替ヘッジ付き）

期	収益率(%)
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
第41特定期間（236期～241期計算期間合計）	1.4
第42特定期間（242期～247期計算期間合計）	3.2

Bコース（為替ヘッジなし）

期	収益率(%)
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
第41特定期間（236期～241期計算期間合計）	2.8
第42特定期間（242期～247期計算期間合計）	2.9

（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
第41特定期間 (2018年7月21日～2019年1月21日)	789,852,203	8,499,456,125	79,966,435,184
第42特定期間 (2019年1月22日～2019年7月22日)	1,332,638,391	7,657,553,042	73,641,520,533

（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
第41特定期間 (2018年7月21日～2019年1月21日)	993,886,135	1,079,069,207	10,739,923,429
第42特定期間 (2019年1月22日～2019年7月22日)	384,781,851	1,542,623,573	9,582,081,707

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

< 参考情報 >

(2019年8月30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



※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。

	Aコース (為替ヘッジ付き)	Bコース (為替ヘッジなし)
基準価額	6,183円	6,093円
純資産総額	449.6億円	54.9億円

分配の推移

(1万口当たり/税引前)

決算期	分配金	
	Aコース (為替ヘッジ付き)	Bコース (為替ヘッジなし)
2019年 4月	20円	25円
2019年 5月	20円	25円
2019年 6月	20円	25円
2019年 7月	20円	25円
2019年 8月	20円	25円
直近1年間累計	240円	425円
設定来累計	8,300円	9,815円

主要な資産の状況(マザーファンド)

資産別組入状況		組入上位10銘柄					
債券等	93.5%	銘柄	クーポン	償還日	格付	比率	
転換社債	0.5%	1 米国国債	2.5%	2045/2/15	AA/Aa	2.9%	
株式	0.4%	2 米国国債	2.5%	2021/1/31	AA/Aa	2.9%	
新株予約権証券(ワラント)	0.0%	3 米国政府保証債	5.5%	2023/9/18	AA/Aa	2.2%	
現金・その他	5.6%	4 ドイツ国債	0%	2020/6/12	AAA/Aaa	2.2%	
		5 米国国債	2.5%	2022/1/15	AA/Aa	2.0%	
		6 米国国債	2.25%	2021/7/31	AA/Aa	2.0%	
		7 第323回 10年国債	0.9%	2022/6/20	A	1.8%	
		8 米国国債	2.875%	2025/11/30	AA/Aa	1.7%	
		9 米国国債	2.75%	2025/6/30	AA/Aa	1.6%	
		10 米国国債	3%	2049/2/15	AA/Aa	1.5%	

国別組入状況		格付別組入状況(対投資債券比率)		通貨別組入状況(対投資資産比率)		組入債券種別内訳(対投資資産比率)	
アメリカ	57.1%	AAA/Aaa	8.7%	アメリカ・ドル	84.0%	米国国債・政府機関債	32.4%
ドイツ	4.9%	AA/Aa	35.7%	ユーロ	8.0%	ハイ・イールド・ボンド	38.2%
カナダ	3.9%	A	3.7%	日本・円	2.7%	先進国債券(除く米国)	16.0%
イギリス	3.0%	BBB/Baa	6.6%	イギリス・ポンド	2.7%	エマージング債券	13.4%
日本	2.5%	BB/Ba	17.0%	カナダ・ドル	2.6%		
オランダ	2.5%	B	20.7%				
イスラエル	2.2%	CCC/Caa	5.2%				
ルクセンブルグ	1.7%	CC/Ca以下	0.6%				
ウクライナ	1.4%	格付なし	1.8%				
その他	15.2%						

※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、同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)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。
 ※2019年は年初以降8月末までの実績となります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

（略）

ファンドの販売価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。なお、取得申込みには、手数料がかかります。手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、販売会社所定の申込手数料率を乗じて得た額となります。申込手数料率は3.24%^{*}（税抜 3.00%）を超えないものとします。

* 消費税率が10%となった場合は、3.30%となります。

（略）

販売会社の申込手数料率および申込単位の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<http://www.fidelity.co.jp/fij/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

（略）

<訂正後>

（略）

ファンドの販売価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。なお、取得申込みには、手数料がかかります。手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、販売会社所定の申込手数料率を乗じて得た額となります。申込手数料率は3.30%（税抜 3.00%）を超えないものとします。

（略）

販売会社の申込手数料率および申込単位の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

（略）

2【換金（解約）手続等】

<訂正前>

（略）

解約価額および販売会社の解約単位の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<http://www.fidelity.co.jp/fij/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

（略）

<訂正後>

（略）

解約価額および販売会社の解約単位の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

（略）

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<訂正前>

(略)

基準価額は毎営業日計算され、委託会社のホームページ（アドレス：<http://www.fidelity.co.jp/fij/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞に掲載されます。（日本経済新聞においては、ファンドは、「悠々債券A付」および「悠々債券B無」として略称で掲載されています。）

(略)

<訂正後>

(略)

基準価額は毎営業日計算され、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞に掲載されます。（日本経済新聞においては、ファンドは、「悠々債券A付」および「悠々債券B無」として略称で掲載されています。）

(略)

(5)【その他】

<訂正前>

(略)

(d) 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、原則として、電子公告の方法により行ない、委託会社のホームページ（<http://www.fidelity.co.jp/fij/>）に掲載します。

(略)

<訂正後>

(略)

(d) 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、原則として、電子公告の方法により行ない、委託会社のホームページ（<https://www.fidelity.co.jp/>）に掲載します。

(略)

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42特定期間（2019年1月22日から2019年7月22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41特定期間 2019年1月21日現在	第42特定期間 2019年7月22日現在
資産の部		
流動資産		
預金	3,107,405	3,255,014
親投資信託受益証券	47,382,978,652	45,528,421,489
派生商品評価勘定	1,106,414,327	16,561,204
未収入金	291,761,159	293,098,320
流動資産合計	48,784,261,543	45,841,336,027
資産合計		
	48,784,261,543	45,841,336,027
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	339,545,746
未払収益分配金	159,932,870	147,283,041
未払解約金	41,703,238	65,066,768
未払受託者報酬	2,285,540	2,164,741
未払委託者報酬	63,081,120	59,747,109
その他未払費用	5,445,473	5,359,745
流動負債合計	272,448,241	619,167,150
負債合計		
	272,448,241	619,167,150
純資産の部		
元本等		
元本	79,966,435,184	73,641,520,533
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	31,454,621,882	28,419,351,656
(分配準備積立金)	242,492,864	232,556,497
元本等合計	48,511,813,302	45,222,168,877
純資産合計		
	48,511,813,302	45,222,168,877
負債純資産合計		
	48,784,261,543	45,841,336,027

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第41特定期間 自 2018年7月21日 至 2019年1月21日	第42特定期間 自 2019年1月22日 至 2019年7月22日
営業収益		
受取利息	63	45
有価証券売買等損益	1,090,879,101	1,765,620,098
為替差損益	721,273,341	101,986,951
営業収益合計	369,605,697	1,867,607,094
営業費用		
受託者報酬	14,018,786	12,651,923
委託者報酬	386,919,858	349,194,310
その他費用	5,456,273	5,359,745
営業費用合計	406,394,917	367,205,978
営業利益又は営業損失()	776,000,614	1,500,401,116
経常利益又は経常損失()	776,000,614	1,500,401,116
当期純利益又は当期純損失()	776,000,614	1,500,401,116
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()	8,473,064	13,424,830
期首剰余金又は期首欠損金()	32,641,239,835	31,454,621,882
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,248,979,493	2,982,858,395
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,248,979,493	2,982,858,395
剰余金減少額又は欠損金増加額	303,962,524	518,055,451
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	303,962,524	518,055,451
分配金	990,871,466	916,509,004
期末剰余金又は期末欠損金()	31,454,621,882	28,419,351,656

(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、当期末日および翌日が休日のため、2019年1月22日から2019年7月22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41特定期間 2019年1月21日現在	第42特定期間 2019年7月22日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	87,676,039,106 円	79,966,435,184 円
期中追加設定元本額	789,852,203 円	1,332,638,391 円
期中一部解約元本額	8,499,456,125 円	7,657,553,042 円
2. 受益権の総数	79,966,435,184 口	73,641,520,533 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	31,454,621,882 円	28,419,351,656 円
4. 1口当たり純資産額	0.6067 円	0.6141 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第41特定期間 自 2018年 7月21日 至 2019年 1月21日</p>	<p style="text-align: center;">第42特定期間 自 2019年 1月22日 至 2019年 7月22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2018年 7月21日 至2018年 8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（141,428,616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（2,280,422,436円）及び分配準備積立金（247,551,934円）より分配対象収益は2,669,402,986円（1口当たり0.031056円）であり、うち171,908,580円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年 8月21日 至2018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（134,980,721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（2,211,289,565円）及び分配準備積立金（242,804,272円）より分配対象収益は2,589,074,558円（1口当たり0.030656円）であり、うち168,911,171円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年 9月21日 至2018年10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（137,887,781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（2,137,607,994円）及び分配準備積立金（237,915,132円）より分配対象収益は2,513,410,907円（1口当たり0.030321円）であり、うち165,784,682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2019年 1月22日 至2019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（156,852,173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（1,941,969,859円）及び分配準備積立金（238,992,339円）より分配対象収益は2,337,814,371円（1口当たり0.029580円）であり、うち158,065,890円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年 2月21日 至2019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（132,343,142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（1,918,589,514円）及び分配準備積立金（235,138,332円）より分配対象収益は2,286,070,988円（1口当たり0.029281円）であり、うち156,149,078円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年 3月21日 至2019年 4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（159,373,020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（1,861,111,372円）及び分配準備積立金（230,223,160円）より分配対象収益は2,250,707,552円（1口当たり0.029363円）であり、うち153,301,670円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p>

(自2018年10月23日 至2018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(123,610,619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(2,080,283,032円)及び分配準備積立金(234,244,100円)より分配対象収益は2,438,137,751円(1口当たり0.029835円)であり、うち163,440,630円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2018年11月21日 至2018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(126,964,106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(2,009,349,590円)及び分配準備積立金(230,098,671円)より分配対象収益は2,366,412,367円(1口当たり0.029416円)であり、うち160,893,533円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2018年12月21日 至2019年1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(173,997,219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(1,964,019,900円)及び分配準備積立金(228,428,515円)より分配対象収益は2,366,445,634円(1口当たり0.029593円)であり、うち159,932,870円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2019年4月23日 至2019年5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(106,844,665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(1,845,229,283円)及び分配準備積立金(233,819,687円)より分配対象収益は2,185,893,635円(1口当たり0.028771円)であり、うち151,953,180円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2019年5月21日 至2019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(157,177,257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(1,774,993,869円)及び分配準備積立金(229,754,581円)より分配対象収益は2,161,925,707円(1口当たり0.028873円)であり、うち149,756,145円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2019年6月21日 至2019年7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(113,026,931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(1,746,604,605円)及び分配準備積立金(232,556,497円)より分配対象収益は2,092,188,033円(1口当たり0.028410円)であり、うち147,283,041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41特定期間 2019年 1月21日現在	第42特定期間 2019年 7月22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	391,390,267	333,818,309
合 計	391,390,267	333,818,309

（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41特定期間 2019年 1月21日 現在			第42特定期間 2019年 7月22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	47,104,293,557	-	45,997,879,230	1,106,414,327	44,127,465,175	-	44,450,449,717	322,984,542
アメリ カ・ド ル	41,184,036,054	-	40,189,560,800	994,475,254	38,311,002,666	-	38,632,667,060	321,664,394
イギリ ス・ポ ンド	1,181,290,765	-	1,172,928,160	8,362,605	1,153,734,080	-	1,142,656,020	11,078,060
カナ ダ・ド ル	1,194,559,132	-	1,178,221,170	16,337,962	1,153,152,596	-	1,171,033,948	17,881,352
ユーロ	3,544,407,606	-	3,457,169,100	87,238,506	3,509,575,833	-	3,504,092,689	5,483,144
合計	47,104,293,557	-	45,997,879,230	1,106,414,327	44,127,465,175	-	44,450,449,717	322,984,542

（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	15,303,671,089	45,528,421,489	
親投資信託受益証券 合計		15,303,671,089	45,528,421,489	
合計		15,303,671,089	45,528,421,489	

(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41特定期間 2019年1月21日現在	第42特定期間 2019年7月22日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,182,609	1,117,719
親投資信託受益証券	6,561,748,788	5,881,540,820
未収入金	75,152,048	37,242,712
流動資産合計	6,638,083,445	5,919,901,251
資産合計	6,638,083,445	5,919,901,251
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	53,699,617	23,955,204
未払解約金	7,016,873	2,665,334
未払受託者報酬	309,792	280,424
未払委託者報酬	8,550,493	7,739,866
その他未払費用	888,727	1,133,201
流動負債合計	70,465,502	35,774,029
負債合計	70,465,502	35,774,029
純資産の部		
元本等		
元本	10,739,923,429	9,582,081,707
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,172,305,486	3,697,954,485
(分配準備積立金)	483,045,898	415,039,910
元本等合計	6,567,617,943	5,884,127,222
純資産合計	6,567,617,943	5,884,127,222
負債純資産合計	6,638,083,445	5,919,901,251

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第41特定期間 自 2018年7月21日 至 2019年1月21日	第42特定期間 自 2019年1月22日 至 2019年7月22日
営業収益		
受取利息	13	17
有価証券売買等損益	148,117,867	241,771,823
営業収益合計	148,117,854	241,771,840
営業費用		
受託者報酬	1,871,843	1,693,031
委託者報酬	51,663,918	46,728,807
その他費用	888,727	1,133,201
営業費用合計	54,424,488	49,555,039
営業利益又は営業損失()	202,542,342	192,216,801
経常利益又は経常損失()	202,542,342	192,216,801
当期純利益又は当期純損失()	202,542,342	192,216,801
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()	775,318	2,561,682
期首剰余金又は期首欠損金()	3,678,500,612	4,172,305,486
剰余金増加額又は欠損金減少額	387,093,860	580,932,249
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	387,093,860	580,932,249
剰余金減少額又は欠損金増加額	357,757,151	145,549,307
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	357,757,151	145,549,307
分配金	321,374,559	150,687,060
期末剰余金又は期末欠損金()	4,172,305,486	3,697,954,485

(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、当期末日および翌日が休日のため、2019年1月22日から2019年7月22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41特定期間 2019年1月21日現在	第42特定期間 2019年7月22日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	10,825,106,501 円	10,739,923,429 円
期中追加設定元本額	993,886,135 円	384,781,851 円
期中一部解約元本額	1,079,069,207 円	1,542,623,573 円
2. 受益権の総数	10,739,923,429 口	9,582,081,707 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	4,172,305,486 円	3,697,954,485 円
4. 1口当たり純資産額	0.6115 円	0.6141 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第41特定期間 自 2018年 7月21日 至 2019年 1月21日</p>	<p style="text-align: center;">第42特定期間 自 2019年 1月22日 至 2019年 7月22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2018年 7月21日 至2018年 8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（18,446,922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（367,747,702円）及び分配準備積立金（524,074,357円）より分配対象収益は910,268,981円（1口当たり0.084422円）であり、うち53,911,594円（1口当たり0.005000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年 8月21日 至2018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（24,793,073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（331,439,120円）及び分配準備積立金（510,632,283円）より分配対象収益は866,864,476円（1口当たり0.081772円）であり、うち53,004,912円（1口当たり0.005000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年 9月21日 至2018年10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（18,283,836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（308,458,950円）及び分配準備積立金（504,914,073円）より分配対象収益は831,656,859円（1口当たり0.078509円）であり、うち52,965,954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2019年 1月22日 至2019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（23,125,367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（200,085,992円）及び分配準備積立金（477,918,663円）より分配対象収益は701,130,022円（1口当たり0.065629円）であり、うち26,707,993円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年 2月21日 至2019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（22,028,811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（197,676,741円）及び分配準備積立金（462,776,675円）より分配対象収益は682,482,227円（1口当たり0.065248円）であり、うち26,149,596円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年 3月21日 至2019年 4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（23,414,759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（189,560,480円）及び分配準備積立金（442,674,124円）より分配対象収益は655,649,363円（1口当たり0.065084円）であり、うち25,184,710円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p>

(自2018年10月23日 至2018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(16,840,966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(296,543,810円)及び分配準備積立金(498,042,787円)より分配対象収益は811,427,563円(1口当たり0.075118円)であり、うち54,010,008円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自2018年11月21日 至2018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(17,595,405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(267,094,797円)及び分配準備積立金(487,352,600円)より分配対象収益は772,042,802円(1口当たり0.071775円)であり、うち53,782,474円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自2018年12月21日 至2019年1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(17,994,332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(234,208,740円)及び分配準備積立金(483,045,898円)より分配対象収益は735,248,970円(1口当たり0.068459円)であり、うち53,699,617円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自2019年4月23日 至2019年5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(14,267,619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(184,109,854円)及び分配準備積立金(430,630,097円)より分配対象収益は629,007,570円(1口当たり0.064039円)であり、うち24,555,493円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2019年5月21日 至2019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(15,068,109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(173,955,002円)及び分配準備積立金(420,189,323円)より分配対象収益は609,212,434円(1口当たり0.063107円)であり、うち24,134,064円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2019年6月21日 至2019年7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(18,594,578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(165,770,172円)及び分配準備積立金(415,039,910円)より分配対象収益は599,404,660円(1口当たり0.062555円)であり、うち23,955,204円(1口当たり0.002500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41特定期間 2019年1月21日現在	第42特定期間 2019年7月22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	53,806,406	43,314,705
合 計	53,806,406	43,314,705

（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	1,976,988,511	5,881,540,820	
親投資信託受益証券	合計	1,976,988,511	5,881,540,820	
合計		1,976,988,511	5,881,540,820	

（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	2019年 1月21日現在	2019年 7月22日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,229,090,565	2,901,998,872
株式	254,799,448	242,170,568
国債証券	30,199,823,985	29,583,967,005
地方債証券	398,552,427	281,903,337
特殊債券	1,501,074,299	1,689,702,820
社債券	23,868,067,309	21,645,951,171
貸付債権	736,276,767	1,091,637,573
派生商品評価勘定	1,286,102	2,419,837
未収入金	478,284,944	403,139,393
未収利息	636,111,975	610,499,463
前払費用	38,849,119	32,484,825
流動資産合計	60,342,216,940	58,485,874,864
資産合計	60,342,216,940	58,485,874,864
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,316,151	41,907
未払金	671,537,757	1,105,880,917
未払解約金	406,721,994	375,591,326
流動負債合計	1,083,575,902	1,481,514,150
負債合計	1,083,575,902	1,481,514,150
純資産の部		
元本等		
元本	20,653,690,286	19,160,993,143
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	38,604,950,752	37,843,367,571
元本等合計	59,258,641,038	57,004,360,714
純資産合計	59,258,641,038	57,004,360,714
負債純資産合計	60,342,216,940	58,485,874,864

(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	2019年 1月21日現在	2019年 7月22日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	23,601,987,627 円	20,653,690,286 円
期中追加設定元本額	302,060,549 円	1,293,729,534 円
期中一部解約元本額	3,250,357,890 円	2,786,426,677 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）	16,514,351,963 円	15,303,671,089 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）	2,286,961,100 円	1,976,988,511 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）	981,297,110 円	931,764,566 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）	871,080,113 円	948,568,977 円
計	20,653,690,286 円	19,160,993,143 円
3. 受益権の総数	20,653,690,286 口	19,160,993,143 口
4. 1口当たり純資産額	2.8692 円	2.9750 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	2019年1月21日現在	2019年7月22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	3,410,420	35,273,583
国債証券	57,299,323	8,846,933
地方債証券	9,868,589	5,689,843
特殊債券	49,968,966	22,223,336
社債券	607,389,991	143,527,237
合 計	721,116,449	100,567,094

（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	2019年1月21日 現在			2019年7月22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	533,663,182	-	538,979,333	5,316,151	380,868,289	-	378,557,279	2,311,010
アメリカ・ドル	528,264,266	-	533,548,127	5,283,861	364,443,329	-	362,136,404	2,306,925
カナダ・ドル	-	-	-	-	4,135,062	-	4,137,065	2,003
ユーロ	5,398,916	-	5,431,206	32,290	12,289,898	-	12,283,810	6,088
買建	127,448,369	-	128,734,471	1,286,102	16,424,960	-	16,491,880	66,920
アメリカ・ドル	5,398,916	-	5,438,078	39,162	16,424,960	-	16,491,880	66,920
ユーロ	122,049,453	-	123,296,393	1,246,940	-	-	-	-
合計	661,111,551	-	667,713,804	4,030,049	397,293,249	-	395,049,159	2,377,930

（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	WARRIOR MET COAL INC	242	25.50	6,171.00	
	VISTRA ENERGY CORP	46,118	21.83	1,006,755.94	
	PACIFIC DRILLING SA (US)	48,333	8.28	400,197.24	
	SOUTHEASTERN GROCERS INC	10,557	34.46	363,794.22	
	TOPS MARKETS CORP	1,325	351.56	465,817.00	
アメリカ・ドル	小計	106,575		2,242,735.40 (242,170,568)	
合計		106,575		242,170,568 (242,170,568)	

(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	ULTRA PETROLEUM CRP WT 7/14/25	6,720.00	-	
	アメリカ・ドル	小計	6,720.00	- (-)	
新株予約権証券	合計			- (-)	
国債証券	日本円	323 10年国債	1,014,500,000	1,047,308,930	
		351 10年国債	101,000,000	103,606,810	
		9 40年国債	283,000,000	282,547,200	
	日本円	小計	1,398,500,000	1,433,462,940	
	アメリカ・ドル	AID 5.5% 9/18/23	9,969,000.00	11,372,136.75	
		AID UKRAINE 1.471% 09/29/21	1,959,000.00	1,940,977.20	
		ANGOLA 7% 8/16/19 REGS	25,000.00	25,000.00	
		ANGOLA REP 9.5% 11/12/25 144A	75,000.00	86,250.00	
		ARAB RP EGYPT 5.875% 6/25 144A	35,000.00	36,182.30	
		ARGENTINA REP 5.625% 1/26/22	1,030,000.00	888,045.40	
		ARGENTINA REP 6.875% 4/22/21	1,910,000.00	1,704,675.00	
		ARGENTINA REP 7.5% 4/22/26	2,305,000.00	1,992,372.85	
		ARGENTINA REP 7.625% 4/22/46	310,000.00	251,196.10	
		AZERBAIJAN REP 4.75% 3/24 144A	40,000.00	42,400.00	
		BELARUS REPUB 6.875% 2/23 144A	225,000.00	240,187.50	
		BELARUS REPUB 7.625% 6/27 144A	175,000.00	197,750.00	
		BERMUDA GOV 3.717% 1/27 144A	80,000.00	83,000.00	
		BERMUDA GOVT 4.75% 02/15/29 14	160,000.00	178,099.20	
		BRAZIL GLBL 8.25% 1/20/34	505,000.00	689,794.65	
		BRAZIL GOVT 5.625% 1/7/41	520,000.00	570,700.00	
BRAZIL REP 5.625% 02/21/2047		290,000.00	317,639.90		
CAMEROON RP 9.5% 11/19/25 144A	530,000.00	575,050.00			

COLOMBIA GLB 10.375% 1/28/33	50,000.00	78,406.00	
COLOMBIA REP 7.375% 9/18/37	30,000.00	41,165.40	
COSTA RICA 7% 4/4/2044 144A	90,000.00	92,700.00	
COSTA RICA GOVT 4.25 1/23 144A	50,000.00	50,046.50	
DOMINICAN REP 5.5% 01/25 144A	75,000.00	79,406.25	
DOMINICAN REP 5.95% 01/27 144A	155,000.00	167,254.30	
DOMINICAN REP 6.4% 6/5/49 144A	195,000.00	202,920.90	
DOMINICAN REP 6.6% 1/24 144A	15,000.00	16,650.00	
DOMINICAN REP 6.875% 1/26 144A	215,000.00	242,343.70	
DOMINICAN REP 7.45% 04/44 144A	465,000.00	536,493.75	
DOMINICAN REPUBLIC 6% 7/28 144A	150,000.00	162,046.50	
ECUADOR GOVT 8.875% 10/27 144A	630,000.00	650,790.00	
EGYPT (ARAB) 6.2004% 3/24 144A	200,000.00	210,750.00	
EGYPT 7.6003% 3/1/29 144A	250,000.00	267,187.50	
EGYPT GOVT 7.903% 2/21/48 144A	150,000.00	155,625.00	
EGYPT GOVT 8.7002% 3/1/49 144A	100,000.00	109,625.00	
EGYPT REP 6.125% 1/31/22 144A	985,000.00	1,025,631.25	
EGYPT REP OF 7.5% 1/31/27 144A	840,000.00	910,350.00	
EGYPT REP OF 8.5% 1/31/47 144A	620,000.00	674,250.00	
EL SALVADOR 5.875 01/30/25 RGS	160,000.00	163,200.00	

EL SALVADOR 7.375 12/1/19 144A	405,000.00	409,932.90	
EL SALVADOR 7.75% 1/24/23 144A	185,000.00	202,112.50	
EL SLVDR GOVT 6.375% 1/27 144A	205,000.00	210,059.40	
GHANA GOVT 8.125% 01/26 144A	75,000.00	81,163.50	
GHANA REP 7.875% 03/26/2027 14	115,000.00	121,468.75	
GOVT OF PAKITN 6.75% 12/19144A	230,000.00	231,867.60	
GUATEMALA GOVT 4.9% 6/30 144A	200,000.00	209,562.00	
INDONESIA 6.625% 2/17/37 144A	240,000.00	313,723.20	
INDONESIA 7.75% 1/17/38 144A	505,000.00	732,881.25	
INDONESIA 8.5% 10/12/35 REGS	1,000,000.00	1,513,750.00	
INDONESIA GOVT 5.25 1/42 144A	200,000.00	230,062.00	
IRAQ REP 5.8% 1/15/28 REGS	1,250,000.00	1,242,187.50	
ISRAEL GLBL 5.5% 12/4/23	8,000.00	9,160.40	
IVORY COAST GOV STEP 12/32 RGS	484,000.00	474,320.00	
JORDAN GOVT 3% 6/30/25	1,629,000.00	1,703,477.88	
LEBANE 144A 5.8% 4/14/20 REGS	145,000.00	139,925.00	
LEBANESE MTN 8.25 4/12/21 REGS	100,000.00	94,125.00	
LEBANESE REP 6.15% 6/20	140,000.00	134,836.80	
LEBANON REP 5.45% 11/28/19	1,600,000.00	1,582,992.00	
LEBANON REP 6% 1/27/23 REGS	200,000.00	168,374.00	
LEBANON REP 6.375% 3/09/20	655,000.00	641,284.30	
MEXICO GOV 6.05% 1/11/40	510,000.00	612,000.00	
MONGOLIA GOVT 8.75% 3/24 144A	195,000.00	220,531.35	

NIGERIA REP 6.375% 7/23 144A	70,000.00	74,571.70	
NIGERIA REP 7.625% 11/25 144A	80,000.00	88,574.40	
NIGERIA REPUB 6.5% 11/27 144A	80,000.00	81,649.60	
OMAN GOVT 4.125% 01/17/23 144A	90,000.00	88,987.50	
OMAN SULTAN 3.875% 3/8/22 144A	280,000.00	278,250.00	
OMAN SULTAN 5.375% 3/8/27 144A	75,000.00	73,218.75	
OMAN SULTANATE 6.75% 1/48 144A	175,000.00	164,500.00	
PAKISTAN GOVT 8.25% 04/24 144A	195,000.00	216,754.20	
PARAGUAY REP 5.4% 3/30/50 144A	70,000.00	77,787.50	
QATAR ST 4% 3/14/29 144A	395,000.00	426,844.90	
QATAR ST 4.5% 04/23/28 144A	360,000.00	401,400.00	
QATAR ST 4.817% 03/14/49 144A	265,000.00	302,762.50	
QATAR ST 5.103% 4/23/48 144A	285,000.00	341,107.95	
REP OF GHANA 7.875 8/7/23 144A	161,322.00	175,840.98	
ROMANIA GOVT 5.125% 06/48 144A	145,000.00	158,728.60	
RUSSIA MIN FIN 5.1% 03/28/35	600,000.00	652,500.00	
RUSSIAN FED 5.875 9/16/43 144A	270,000.00	329,940.00	
RUSSIAN FEDN 5.25% 06/47 144A	800,000.00	897,000.00	
RUSSIAN FEDN 5.625 4/4/42 144A	250,000.00	294,740.00	
RWANDA INTL GOV6.625 5/23 144A	105,000.00	111,036.45	

SAUDI ARA GT 4.5% 4/17/30 144A	145,000.00	160,442.50	
SAUDI ARAB 3.625% 3/4/28 144A	80,000.00	82,800.00	
SAUDI ARABIA 4.375% 4/29 144A	135,000.00	147,892.50	
SAUDI ARABIA 5.25% 01/50 144A	210,000.00	245,437.50	
SRI LANKA GOV 6.25 10/4/20 144	70,000.00	71,137.50	
SRI LANKA GOV 6.25 7/27/21 144	225,000.00	228,163.50	
SRI LANKA GOVT 5.75% 4/23 144A	310,000.00	307,963.30	
SRI LANKA GOVT 6.85% 3/24 144A	200,000.00	204,500.00	
TURKEY GLBL 7.375% 2/05/25	400,000.00	416,748.00	
TURKEY GOVT 5.75% 05/11/2047	200,000.00	167,624.00	
TURKEY REP 5.125% 3/25/22	1,015,000.00	1,004,210.55	
TURKEY REP 5.625% 3/30/21	880,000.00	892,100.00	
TURKEY REP 6.25% 9/26/22	1,755,000.00	1,773,094.05	
TURKEY REP 6.35% 08/10/24	200,000.00	198,624.00	
TURKEY REP 6.75% 5/30/40	270,000.00	253,125.00	
TURKEY REP 7.25% 3/05/38	205,000.00	204,614.60	
TURKEY REP GLB 6.875% 3/17/36	220,000.00	212,850.00	
TURKEY REPUBLIC OF 7.25% 12/23	275,000.00	284,795.50	
UKRAINE CAB 7.75% 09/01/21 RGS	337,000.00	350,058.75	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/19 144A	230,000.00	230,000.00	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/20 144A	890,000.00	920,037.50	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/21 144A	1,395,000.00	1,449,056.25	

UKRAINE CAB 7.75% 9/1/22 144A	815,000.00	858,806.25	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/24 144A	160,000.00	168,600.00	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/26 144A	235,000.00	243,225.00	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/27 144A	235,000.00	243,812.50	
UNITED MEX 5.75 10/12/2110	360,000.00	393,750.00	
UST NOTE 2% 8/15/25	319,000.00	320,993.75	
UST NOTES 2% 07/31/2024	5,838,000.00	5,921,892.06	
UST NOTES 2.125% 05/31/21	280,000.00	281,453.20	
UST NOTES 2.125% 05/31/26	2,231,000.00	2,260,270.72	
UST NOTES 2.125% 06/30/22	129,000.00	130,279.68	
UST NOTES 2.375% 05/15/2029	30,000.00	30,862.50	
UST NOTES 2.5% 01/15/2022	10,232,000.00	10,405,023.12	
UST NOTES 2.875% 11/30/25	8,121,000.00	8,592,667.68	
USTB 2.50% 02/15/45	13,926,000.00	13,745,379.78	
USTB 2.875% 05/15/49	680,000.00	721,915.20	
USTB 3% 02/15/49	6,600,000.00	7,169,448.00	
USTB 4.75% 2/15/37	4,378,000.00	5,956,794.36	
USTB 6.125%	4,622,000.00	6,334,266.12	
USTCOUP 2/15/34	1,130,000.00	799,927.00	
USTN 1.5% 7/15/20	1,938,000.00	1,929,065.82	
USTN 1.625% 05/31/23	2,565,000.00	2,548,968.75	
USTN 1.75% 06/30/22	4,374,000.00	4,370,719.50	
USTN 1.75% 07/15/22	1,938,000.00	1,936,178.28	
USTN 1.875% 06/30/26	1,200,000.00	1,196,340.00	

	USTN 1.875% 07/31/22	2,560,000.00	2,566,195.20	
	USTN 2% 05/31/24	1,620,000.00	1,634,985.00	
	USTN 2.125% 12/31/22	3,529,000.00	3,568,701.25	
	USTN 2.25% 03/31/26	494,000.00	504,398.70	
	USTN 2.25% 04/15/22	3,000,000.00	3,035,970.00	
	USTN 2.25% 04/30/21	1,600,000.00	1,611,120.00	
	USTN 2.25% 07/31/21	10,200,000.00	10,285,578.00	
	USTN 2.25% 12/31/24	6,923,000.00	7,067,621.47	
	USTN 2.375% 04/30/26	1,107,000.00	1,139,125.14	
	USTN 2.5% 01/31/21	15,053,000.00	15,190,584.42	
	USTN 2.5% 02/28/26	90,000.00	93,279.60	
	USTN 2.5% 12/31/20	5,039,000.00	5,080,924.48	
	USTN 2.625% 02/15/29	1,040,000.00	1,092,197.60	
	USTN 2.625% 12/31/23	299,000.00	309,345.40	
	USTN 2.625% 12/31/25	750,000.00	782,632.50	
	USTN 2.75% 06/30/25	7,912,000.00	8,298,263.84	
	VENEZUELA 11.95% 8/31 REGS	1,470,000.00	205,800.00	
	VENEZUELA REP 9.25% 9/15/27	1,805,000.00	252,700.00	
	VENEZUELA REPUB 12.75% 8/23/22	345,000.00	48,300.00	
	VIETNAM PAR 3/5.5% 3/12/28	1,562,749.98	1,576,908.45	
	VIETNAM SOCIALIST FRN 3/13/28	70,000.00	69,703.20	
	アメリカ・ドル 小計	189,047,071.98	194,324,539.78 (20,983,163,805)	
イギリス・ポンド	UK GILT 2.5% 07/22/65 REGS	2,275,000.00	3,239,736.50	
	UK GILT 4.25% 12/07/27	4,435,000.00	5,743,768.50	
	UK GILT 4.75% 3/07/20	1,600,000.00	1,641,936.00	

イギリス・ポンド 小計		8,310,000.00	10,625,441.00 (1,434,540,789)		
カナダ・ドル	CANADA GOV 2% 9/01/23	4,800,000.00	4,907,664.00		
	CANADA GOVT 1.25% 11/01/19	4,800,000.00	4,793,616.00		
	CANADA GOVT 2% 06/01/28	4,050,000.00	4,218,804.00		
	CANADA GOVT 3.5% 12/01/45	2,525,000.00	3,460,941.75		
カナダ・ドル 小計		16,175,000.00	17,381,025.75 (1,436,194,158)		
ユーロ	BELGIUM GOVT 1.7% 06/22/50 RGS	1,131,783.00	1,348,225.18		
	BTP 3.85% 09/01/49 144A RGS	3,050,000.00	3,792,797.00		
	FRANCE GOVT 0% 02/25/2020 REGS	2,150,000.00	2,157,912.00		
	GERMANY FEDERAL REPUBLIC OF 0%	2,500,000.00	2,584,000.00		
	GERMANY GOVT 0% 6/12/20 RGS	15,696,125.00	15,793,127.04		
	GERMANY GOVT 0.25% 8/15/28 RGS	1,050,000.00	1,114,092.00		
	GERMANY GVT .25% 02/15/29 REGS	2,150,000.00	2,278,720.50		
	GERMANY GVT 1.25% 8/15/48 RGS	1,450,000.00	1,844,835.00		
	NETHERLANDS GOVT .25% 7/29 RGS	800,000.00	836,624.00		
	PORTUGAL GOVT 2.25% 04/34 144A	1,150,000.00	1,370,857.50		
	SPAIN KINGDOM OF 2.7% 10/31/2	1,800,000.00	2,367,414.00		
	ユーロ 小計		32,927,908.00	35,488,604.22 (4,296,605,313)	
国債証券 合計			29,583,967,005 (28,150,504,065)		
地方債証券	アメリカ・ドル	BUENOS AIRES 10.875% 1/21 144A	200,010.00	189,759.48	
		BUENOS AIRES 10.875% 1/21 REGS	653,333.36	619,850.00	
		BUENOS AIRES 8.95% 02/21 144A	90,450.00	90,110.77	

		BUENOS AIRES 9.95% 06/21 144A	180,000.00	163,575.00	
		PROV CORDOBA 7.45% 9/1/24 144A	260,000.00	208,566.80	
		PROV OF SANTA FE 7% 3/23 144A	560,000.00	481,600.00	
		PROVINCE CRDB 7.125% 6/21 144A	970,000.00	857,237.50	
	アメリカ・ドル	小計	2,913,793.36	2,610,699.55 (281,903,337)	
地方債証券		合計		281,903,337 (281,903,337)	
特殊債券	アメリカ・ドル	1MDB GLB INV 4.4% 3/09/23 REGS	1,000,000.00	966,870.00	
		BANCO DO BRASIL 9.0% PERP 144A	215,000.00	240,737.65	
		BANQUE CENTRL 5.75% 1/25 144A	215,000.00	201,562.50	
		DEV BK MONGOL 7.25% 10/23 144A	200,000.00	209,374.00	
		ESKOM HOLDS MTN 5.75% 1/21 RGS	400,000.00	404,080.00	
		EXPORT BNK TR 5.375% 2/21 144A	150,000.00	146,062.50	
		FHLG 15YR 2.5% 03/01/2033#G186	96,751.66	97,384.41	
		FHLG 15YR 2.5% 03/01/2033#G186	35,080.80	35,310.22	
		FHLG 15YR 2.5% 05/33#G18687	21,706.78	21,848.74	
		FHLG 15YR 2.5% 08/32#G18654	19,364.89	19,503.54	
		FHLG 15YR 2.5% 11/32#G18665	20,135.83	20,280.00	
		FHLG 15YR 2.5% 12/01/2032#G186	97,469.98	98,167.86	
		FHLG 20YR 3% 04/01/2033#K90336	45,342.56	46,492.44	
		FHLG 20YR 3% 06/01/2033#K90632	112,281.44	115,128.89	
		FHLG 20YR 3% 06/01/2033#K90684	65,115.66	66,766.99	
		FHLG 20YR 3% 06/33#K90806	95,622.48	98,047.46	
		FHLG 20YR 3% 07/01/2033#C91714	216,055.01	221,534.16	
FHLG 20YR 3.0% 06/01/2033#C917	47,347.32	48,548.04			

FNMA 0.875% 08/02/19	1,201,000.00	1,200,543.62	
FNMA 15YR 2.5% 08/34 #TBA	600,000.00	603,186.00	
FNMA 15YR 3% 08/34 #TBA	3,900,000.00	3,975,075.00	
FNMA 20YR 3% 05/01/2033#AT3000	38,656.58	39,612.94	
FNMA 20YR 3% 06/33#AT6090	42,555.99	43,608.82	
FNMA 20YR 3% 07/01/2033#MA1490	210,978.61	216,198.22	
PDVSA 12.75% 2/17/22 144A	400,000.00	56,000.00	
PDVSA PETR VENZ 5.375% 4/12/27	325,000.00	45,500.00	
PEMEX MASTER TR 6.625 6/15/38	200,000.00	172,968.00	
PEMEX PRO FDG 6.625% 6/15/35	915,000.00	825,787.50	
PERTAMINA PT 6% 5/3/42 144A	100,000.00	116,312.00	
PETROL VENEZUELA 6% 11/26 144A	1,090,000.00	152,600.00	
PETROLEOS MEX 3.5% 1/30/23	140,000.00	131,810.00	
PETROLEOS MEX 4.875% 1/22	745,000.00	745,931.25	
PETROLEOS MEX 6.5% 6/02/41	1,990,000.00	1,708,415.00	
PETROLEOS MEXCNS 6.75% 9/21/47	995,000.00	859,789.45	
PETROLEOS MX 4.875% 1/24 WI	640,000.00	619,200.00	
PETROLEOS MX 6.625% PERP 144A	90,000.00	76,023.00	
PETROLEOS VENZ 9.75 5/35 144A	670,000.00	93,800.00	
TVA 5.25% 9/15/39	267,000.00	354,482.55	
TVA 5.5% 6/15/38	4,000.00	5,414.96	
YPF SOCIEDAD 8.5% 3/23/21 144A	120,000.00	122,961.60	
YPF SOCIEDAD 8.75% 4/4/24 144A	415,000.00	425,375.00	
アメリカ・ドル 小計	18,151,465.59	15,648,294.31 (1,689,702,820)	
特殊債券 合計		1,689,702,820	

(1,689,702,820)

社債券	アメリカ・ドル	ACRISURE LLC 7% 11/15/25 144A	425,000.00	385,687.50	
		ACRISURE LLC 8.125% 02/24 144A	170,000.00	176,375.00	
		ADES INTERNAT 8.625% 4/24 144A	200,000.00	199,500.00	
		AEROPUERTOS 6.875% 2/1/27 144A	406,875.00	394,668.73	
		AES CORP 4% 03/15/21	600,000.00	607,494.00	
		AES CORP 5.125% 09/01/2027	245,000.00	256,025.00	
		ALFA BANK 8%/VAR PERP RGS	400,000.00	410,872.00	
		ALLISON TR 5.875% 6/1/29 144A	150,000.00	157,875.00	
		ALLY 8% GLOBAL	470,000.00	618,050.00	
		ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31	2,919,000.00	3,881,394.30	
		ALLY FINL INC 3.875% 05/21/24	335,000.00	342,504.00	
		ALLY FINL INC 5.75% 11/20/2025	1,531,000.00	1,701,323.75	
		ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18 Escrow	610,000.00	-	
		ALTICE FINCO 7.625% 2/25 144A	815,000.00	786,475.00	
		ALTICE FINCO 8.125% 01/24 144A	305,000.00	314,150.00	
		ALTICE FING SA 7.5% 05/26 144A	1,040,000.00	1,063,400.00	
		ALTICE FRANCE 8.125% 2/27 144A	965,000.00	1,022,900.00	
		ALTICE LUXEMB 10.5% 05/27 144A	490,000.00	505,092.00	
		ALTICE SA 7.625% 2/15/25 144A	660,000.00	631,125.00	
		ALTICE SA 7.75% 05/15/22 144A	841,000.00	853,085.17	
		AMC NETWORKS INC 4.75% 12/15/2	60,000.00	60,750.00	
		ANTERO LP 5.75% 03/01/27 144A	420,000.00	393,485.40	

ANTERO LP/ FIN 5.375% 09/15/24	205,000.00	196,287.50	
ANTERO MIDS 5.75% 1/15/28 144A	185,000.00	173,206.25	
APERGY CORP 6.375% 05/01/26	100,000.00	101,648.00	
APX GROUP INC 7.625% 09/01/23	325,000.00	258,375.00	
ARDAGH PKG FIN 7.25% 5/24 144	705,000.00	745,170.90	
AVOLON HLD 4.375% 5/01/26 144A	2,000.00	2,059.36	
AVOLON HLDGS 3.95% 7/24 144A	2,000.00	2,044.00	
AVOLON HLDGS 5.125% 10/23 144A	780,000.00	829,530.00	
AVOLON HLDS 5.25% 5/15/24 144A	400,000.00	429,320.00	
BALBOA MRGR 11.375% 12/21 144A	1,780,000.00	1,883,916.40	
BALL CORP 4.875% 3/15/26	625,000.00	662,812.50	
BANCO D BRASIL 6.25% PERP 144A	155,000.00	150,213.60	
BANCO HIPO 9.75% 11/30/20 144A	225,000.00	224,295.75	
BANCO MACRO 6.75% 11/4/26 144A	380,000.00	332,260.60	
BANFF MERGER 9.75% 9/26 144A	1,010,000.00	878,700.00	
BANK OF AMERICA 5.86%/VAR PERP	2,285,000.00	2,418,901.00	
BAUSCH HLTH 5.75% 8/15/27 144A	60,000.00	62,778.00	
BBA US HLDGS 5.375% 5/26 144A	100,000.00	104,000.00	
BCPE CYCLE MERGER SUB II INC 1	190,000.00	186,675.00	
BERRY GBL ES 4.875% 7/26 144A	120,000.00	123,900.00	
BERRY GBL ES 5.625% 7/27 144A	100,000.00	105,000.00	

BGEO GROUP JSC 6% 7/26/23 144A	295,000.00	297,581.25	
BIZ FIN (UKRXB) 9.625% 4/22 144	192,500.00	200,921.87	
BOMBARDIER 7.875% 04/27 144A	1,305,000.00	1,301,737.50	
BOMBARDIER INC 7.5% 03/25 144A	130,000.00	130,975.00	
BOMBARDIER INC 7.5% 12/24 144A	330,000.00	339,075.00	
BONITRON 8.75% 10/30/22 144A	205,000.00	215,633.35	
BORETS FIN 6.5% 04/07/22 144A	200,000.00	202,936.00	
BRAND ENERGY 8.5% 7/25 144A	680,000.00	601,602.80	
BROOKFIELD RES 6.125 7/22 144A	460,000.00	468,657.20	
C&W SR FIN 6.875% 9/15/27 144A	910,000.00	947,537.50	
CALIF RES 8.0% 12/15/22 144A	2,505,000.00	1,715,925.00	
CALLON PETROLEUM CO DEL 0% 07/	135,000.00	130,950.00	
CATALENT PHARM 5% 6/30/27 144A	70,000.00	71,487.50	
CCO HLDGS LLC 5.125% 2/15/23	270,000.00	274,387.50	
CCO HLDGS LLC 5.75% 01/15/24	1,865,000.00	1,902,300.00	
CCO HLDGS LLC 5.875% 5/27 144A	85,000.00	88,718.75	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5.125%	490,000.00	500,564.40	
CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144	2,330,000.00	2,391,162.50	
CCO HLDGS/CAP 5.25% 9/30/22	200,000.00	202,624.00	
CCO HLDGS/CAP 5.5% 05/26 144A	980,000.00	1,021,650.00	
CDK GLOBAL INC 5.25% 5/29 144A	100,000.00	103,522.00	
CDK GLOBAL INC 5.875% 06/15/26	95,000.00	101,056.25	
CENTENE ESCRO 5.375% 6/26 144A	690,000.00	722,775.00	

CENTENNIAL 6.875% 4/1/27 144A	195,000.00	192,318.75	
CF INDUS INC 5.375% 03/15/44	330,000.00	305,761.50	
CF INDUSTRI INC 5.15% 03/15/34	575,000.00	554,875.00	
CF INDUSTRIES INC 4.95% 6/43	825,000.00	738,375.00	
CHARLES RIVER 5.5% 4/26 144A	195,000.00	206,643.45	
CHENIERE CORPUS 5.125% 06/27	780,000.00	843,375.00	
CHENIERE CORPUS 5.875% 3/31/25	540,000.00	594,675.00	
CHENIERE ENR 5.625% 10/26 144A	275,000.00	289,437.50	
CHESAPEAKE ENERGY 4.875% 04/22	1,370,000.00	1,256,975.00	
CHESAPEAKE ENERGY 5.75 3/15/23	465,000.00	394,087.50	
CHESAPEAKE ENERGY 8% 06/15/27	645,000.00	511,162.50	
CHOBANI 7.5% 04/15/25 144A	260,000.00	245,050.00	
CHS/CMNTY HEA 8.625% 1/24 144A	195,000.00	194,941.50	
CHS/CMNTY HEALTH 6.25% 3/31/23	1,570,000.00	1,507,985.00	
CHS/CMNTY HEALTH 8% 3/26 144A	1,295,000.00	1,239,574.00	
CHS/CMNTY HLT 8.125% 6/24 144A	175,000.00	131,250.00	
CHUKCHANSI EC 9.75 5/30/20 RGS	28,827.42	15,855.08	
CIMPOR FIN OP 5.75% 07/24 144A	215,000.00	190,543.75	
CIT GROUP INC NEW 5.25% 3/7/25	250,000.00	273,125.00	
CITGO HLDG 10.75% 2/20 144A	335,000.00	347,981.25	
CITGO PETR 6.25% 08/15/22 144A	250,000.00	250,625.00	
CITIGROUP 5.35% PERP	1,375,000.00	1,406,625.00	

CLEARWAY ENER 5.75% 10/25 144A	275,000.00	281,968.50	
COMCEL TRST 6.875% 2/6/24 144A	195,000.00	201,275.10	
COMMSCOPE FIN LLC 6% 3/26 144A	260,000.00	263,900.00	
COMMUNITY HLTH 5.125 8/21	380,000.00	376,200.00	
COMSTOCK ESCROW 9.75% 08/15/2026	515,000.00	381,100.00	
CONSOLID FRN 3ML+375 6/22 144A	395,000.00	393,048.70	
CONSOLIDATED 6.5% 5/26 144A	505,000.00	499,950.00	
CORTES NP 9.25% 10/15/24 144A	160,000.00	151,200.00	
COSAN OVERSEAS 8.25% PERP	800,000.00	826,496.00	
COVANTA HLDG CORP 6% 01/01/27	195,000.00	204,262.50	
COVEY PK 7.5% 5/15/25 144A	100,000.00	68,250.00	
CRC ESCROW 5.25% 10/15/25 144A	1,120,000.00	1,112,675.20	
CREDITO REAL S 9.5% 02/26 144A	200,000.00	222,500.00	
CROWN AMER 4.25% 09/30/26	180,000.00	182,250.00	
CROWN AMERS VI 4.75% 02/01/26	310,000.00	318,525.00	
CSC HLDGS 5.5% 04/15/27 144A	1,470,000.00	1,534,312.50	
CSC HLDGS 7.75% 7/15/25 144A	390,000.00	417,787.50	
CSC HLDGS LLC 5.375% 2/28 144A	630,000.00	651,262.50	
CSC HOLDINGS 5.75% 01/30 144A	305,000.00	306,525.00	
CSC HOLDINGS 6.5% 2/1/29 144A	490,000.00	534,100.00	
CSC HOLDINGS 7.5% 4/1/28 144A	690,000.00	759,862.50	
CSN RESOURCES SA 7.625% 02/13/	340,000.00	356,150.00	
CTR PARTNERSHIP 5.25% 6/1/25	515,000.00	530,450.00	
CUMULUS MEDIA NEW HLDGS INC 6.	110,000.00	110,550.00	

CYRUSONE LP/FIN 5% 03/15/24	115,000.00	118,162.50	
CYRUSONE LP/FIN 5.375% 3/15/27	175,000.00	185,062.50	
DARLING ING 5.25% 4/15/27 144A	260,000.00	271,694.80	
DAVITA HEALTHCARE PRN 5% 5/25	1,125,000.00	1,097,718.75	
DAVITA HEALTHCR 5.125% 7/15/24	915,000.00	904,706.25	
DCP MIDSTR 5.85% 5/21/43 144A	185,000.00	175,287.50	
DCP MIDSTREAM 5.125% 05/15/29	320,000.00	328,400.00	
DCP MIDSTREAM OP 5.375% 07/25	400,000.00	421,120.00	
DELTA MER 8.625% 03/12/24 144A	200,000.00	70,000.00	
DENBURY RESOUR 9.25% 3/22 144A	130,000.00	116,675.00	
DENBURY RESOURCE 7.75% 02/15/24 144A	1,265,000.00	974,050.00	
DENBURY RESOURCE CONV 6.375% 12/31/24	4,400,000.00	2,706,000.00	
DIAMOND SPORTS GROUP LLC / DIA	415,000.00	424,856.25	
DISH CORP 5% 03/15/23 WI	1,100,000.00	1,057,705.00	
DISH DBS CORP 5.875% 7/22	1,740,000.00	1,768,275.00	
DTEK FINANCE PIK VAR 12/24	730,000.00	752,352.60	
DYNEGY INC 5.875% 6/1/23	405,000.00	414,112.50	
EAGLE INTER 7.5% 5/1/25 144A	105,000.00	99,356.25	
ECOBANK TRAN 9.5% 4/18/24 144A	155,000.00	174,616.80	
ELDORADO RESORTS 6% 9/15/26	110,000.00	119,075.00	
ELDORADO RESRT 6% 04/01/25	325,000.00	341,315.00	
ENDEAVOR ENERGY 5.5% 1/26 144A	120,000.00	124,200.00	

ENDEAVOR ENERGY 5.75 1/28 144A	125,000.00	132,500.00	
ENLINK MIDSTR 5.375% 06/01/29	195,000.00	198,529.50	
ENSCO PLC 5.2% 3/15/25	140,000.00	97,300.00	
ENSCO PLC 7.75% 02/01/2026	305,000.00	222,650.00	
ENSEMBLE S MRG 9% 9/30/23 144A	375,000.00	389,062.50	
ENTEGRIS INC 4.625% 02/26 144A	315,000.00	318,937.50	
ENTERCOM MED 6.5% 5/01/27 144A	120,000.00	126,600.00	
EP ENERGY LLC 7.75% 5/26 144A	1,760,000.00	1,566,400.00	
EP ENRGY/EVRST 8% 11/29/24 144	305,000.00	207,400.00	
EQUINIX INC 5.375% 5/15/27	285,000.00	306,318.00	
ESAL GMBH 6.25% 02/05/23 144A	725,000.00	734,968.75	
ESH HOSPITALTY 5.25% 5/25 144A	1,015,000.00	1,054,991.00	
ESKOM HLDGS 7.125% 2/25 144A	160,000.00	169,800.00	
ESKOM HLDGS LTD 5.75 1/21 144A	170,000.00	171,734.00	
EW SCRIPPS 5.125% 05/25 144A	45,000.00	44,606.25	
EXTERRAN PARTNER 6% 10/22 WI	1,030,000.00	1,042,875.00	
FIDELITY BANK 10.5% 10/22 144A	140,000.00	154,000.00	
FIRST QUANTUM 6.5% 3/24 144A	305,000.00	286,413.30	
FIRST QUANTUM 6.875% 3/26 144A	305,000.00	279,837.50	
FIRST QUANTUM 7.25% 4/23 144A	625,000.00	617,187.50	
FIRST QUANTUM 7.5% 4/25 144A	310,000.00	299,150.00	
FLY LEASING 5.25% 10/15/24	235,000.00	240,875.00	
FMG RES AUG 4.75% 5/15/22 144A	225,000.00	231,187.50	

FMG RES AUGUS 5.125% 3/23 144A	295,000.00	306,431.25	
FORD MTR CR LLC 5.75% 2/01/21	105,000.00	109,323.90	
FORD MTR CR LLC 5.875% 8/2/21	95,000.00	100,056.85	
FREEPORT MCMOR 6.875% 02/15/23	1,620,000.00	1,705,374.00	
FRONTERA ENERGY 9.7% 6/23 144A	150,000.00	159,702.00	
FRONTIER COMM 8% 04/01/27 144A	330,000.00	345,675.00	
FRONTIER COMM 8.5% 4/26 144A	685,000.00	667,018.75	
FRONTIER COMMS 11% 9/15/25	760,000.00	446,500.00	
GEORGIAN OL&GS 6.75% 4/21 144A	175,000.00	182,873.25	
GLP CAP LP / GLP 5.25% 6/25	265,000.00	285,696.50	
GLP CAP LP/ FIN II 5.375% 4/26	210,000.00	227,266.20	
GO DADDY OP 5.25% 12/1/27 144A	170,000.00	176,800.00	
GOLDEN NUGGET 8.75% 10/25 144A	265,000.00	276,925.00	
GRUBHUB HOLDINGS INC 5.5% 07/0	85,000.00	86,275.00	
GTH FINANCE 7.25% 4/26/23 144A	70,000.00	77,070.00	
HAT HLDG I/II 5.25% 07/24 144A	440,000.00	454,300.00	
HCA INC 5.375% 9/01/26	260,000.00	279,474.00	
HCA INC 5.625% 09/01/28	450,000.00	490,590.00	
HCA INC 5.875% 02/01/2029	130,000.00	143,689.00	
HCA INC 5.875% 02/15/26	595,000.00	658,962.50	
HCA INC 5.875% 5/01/23	65,000.00	71,337.50	
HD SUPPLY IN 5.375% 10/26 144A	370,000.00	387,575.00	
HERTZ CORP 7.125% 08/01/2026 1	460,000.00	464,600.00	

HESS INFRA 5.625% 02/26 144A	365,000.00	377,318.75	
HILCORP 6.25% 11/01/28 144A	225,000.00	218,812.50	
HILCORP ENRGY 5.75% 10/25 144A	1,460,000.00	1,412,550.00	
HILTON DOMESTIC 5.125% 5/01/26	700,000.00	726,250.00	
HILTON DOMESTIC OPERATING CO I	350,000.00	360,500.00	
HMAN FIN 6.375% 07/15/22 144A	460,000.00	408,825.00	
HOLOGIC 4.375% 10/15/25 144A	280,000.00	283,500.00	
HOLOGIC IN 4.625% 2/01/28 144A	95,000.00	96,662.50	
HTA GROUP 9.125% 3/8/22 144A	150,000.00	157,359.00	
HUB INTEL LTD 7% 5/01/26 144A	260,000.00	259,675.00	
IAA SPINCO 5.5% 6/15/27 144A	85,000.00	89,462.50	
ICAHN LP/FN 6.25% 5/31/26 144A	780,000.00	796,247.40	
ICAHN LP/FN COR 6.25% 02/01/22	580,000.00	597,400.00	
ICAHN LP/FN COR 6.375% 12/15/2	770,000.00	795,987.50	
IHS MARKIT LTD 4% 3/1/26 144A	125,000.00	129,623.75	
IMS HEALTH 5% 10/15/26 144A	325,000.00	334,750.00	
INDIGO NATURAL 6.875 2/26 144A	315,000.00	274,050.00	
INDIKA ENERGY 6.875% 4/22 144A	300,000.00	310,218.00	
INTELSAT CONNECT 9.5% 02/15/20	230,000.00	202,975.00	
INTELSAT JACKSON 8% 02/24 144A	965,000.00	1,004,565.00	
INTELSAT LUXMB 8.125% 06/01/23	145,000.00	112,737.50	
INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	5,535,000.00	5,036,850.00	
INTNL GAME TCH 6.25% 1/27 144A	155,000.00	168,175.00	

IRSA INVER Y 11.5 7/20/20 REGS	5,000.00	5,103.10	
J2 CLOUD/GLOBL 6% 7/15/25 144A	220,000.00	230,722.80	
JBS INV II GMBH 7% 1/26 144A	220,000.00	236,390.00	
JBS USA / FIN 5.75% 6/25 144A	505,000.00	523,311.30	
JBS USA LLC 6.5% 4/15/29 144A	550,000.00	600,105.00	
JBS USA/FIN 5.875% 07/24 144A	85,000.00	87,443.75	
JBS USA/FIN 6.75% 02/28 144A	595,000.00	647,062.50	
JONAH ENERGY 7.25% 10/25 144A	641,000.00	266,015.00	
JOSEPH T RYERSON 11% 5/22 144A	315,000.00	333,506.25	
JPMORGAN CHASE 5.15% PERP	1,810,000.00	1,861,711.70	
JURASSIC 6.875% 02/15/21 144A	1,095,000.00	1,086,787.50	
KAZMUNA IGAZ 6.375% 10/48 144A	110,000.00	131,508.30	
KFC CO/PIZZA 4.75% 6/1/27 144A	255,000.00	260,982.30	
KLX ENERGY 11.5% 11/1/25 144A	245,000.00	238,875.00	
KOSMOS ENERGY 7.125% 4/26 144A	295,000.00	299,793.75	
LANDRYS 6.75% 10/15/24 144A	680,000.00	698,829.20	
LAUREATE EDU 8.25% 5/1/25 144A	825,000.00	899,250.00	
LBC TANK TRM 6.875 5/15/23 144	655,000.00	656,637.50	
LEGACY RESVS 6.625% 12/21 WI	2,000,000.00	110,000.00	
LEGACY RSVS/FIN 8% 12/20 WI	750,000.00	41,250.00	
LENNAR CORP 5.375% 10/01/2022	10,000.00	10,600.00	

LEVEL 3 FIN INC 6.125% 1/15/21	1,370,000.00	1,372,561.90	
MAGNOLIA OIL & GAS OPER LLC /	255,000.00	257,550.00	
MATCH GROUP INC 5% 12/27 144A	225,000.00	234,607.50	
MATCH GRP 5.625% 02/15/29 144A	195,000.00	205,725.00	
MEG ENERGY 6.375% 1/30/23 144A	865,000.00	804,450.00	
MEG ENERGY 7% 3/31/24 144A	1,030,000.00	973,350.00	
MELCO RESOR FI 5.25% 4/26 144A	275,000.00	275,244.75	
METALSA SA DE CV 4.9% 04/24/20	150,000.00	150,772.50	
METINVEST 7.75% 4/23/23 144A	460,000.00	474,950.00	
MGM GROWTH 5.75% 02/01/27 144A	205,000.00	219,618.55	
MGM RESORTS INT 5.5% 04/15/27	260,000.00	273,000.00	
MPT OPER PARTNER 5% 10/15/27	996,000.00	1,028,370.00	
MPT OPER PARTNERSHIP LP/CORP 4	535,000.00	535,668.75	
MPT OPER PARTNERSHP 5.25% 8/26	300,000.00	312,375.00	
MSCI INC 5.75% 08/15/2025 144A	380,000.00	399,950.00	
NABORS IND 5.5% 01/15/23	110,000.00	97,350.00	
NAVIENT CORP 5.875% 10/24	1,125,000.00	1,133,437.50	
NAVIENT CORP 6.75% 06/25/25	290,000.00	298,700.00	
NAVIENT CORP 6.75% 6/15/26	895,000.00	923,953.25	
NAVIOS 8.125% 11/15/21 144A	935,000.00	738,650.00	
NAVIOS MARIT 11.25% 8/22 144A	475,000.00	366,937.50	
NAVIOS MARITIM 7.375 1/22 144A	3,365,000.00	2,456,450.00	
NAVIOS STH/FIN 7.25% 5/22 144A	130,000.00	127,562.50	

NEPTUNE 10.875% 10/15/25 144A	1,130,000.00	1,291,138.00	
NEPTUNE 6.625% 10/15/25 144A	560,000.00	593,600.00	
NETFLIX 4.875% 04/15/28	315,000.00	322,623.00	
NETFLIX 5.875% 11/15/28	410,000.00	446,900.00	
NETFLIX INC 4.375% 11/15/26	735,000.00	738,454.50	
NEW COTAI 10.625%PIK 5/19 144A	1,445,751.00	722,875.50	
NEXSTAR 5.625% 7/15/27 144A	220,000.00	227,150.00	
NEXTERA ENERGY 4.25% 9/24 144A	205,000.00	207,050.00	
NEXTERA ENERGY 4.5% 9/27 144A	145,000.00	145,000.00	
NOBLE HLDG 7.875% 2/01/26 144A	265,000.00	226,575.00	
NOBLE HLDG INTL 6.2% 8/01/40	295,000.00	157,825.00	
NOBLE HLDG INTL 7.75% 1/15/24	105,000.00	79,012.50	
NORTHERN OIL & G PIK STEP 05/23	261,301.00	266,527.02	
NOSTRUM OIL 8% 7/25/22 144A	805,000.00	475,956.25	
NRG ENERGY 5.25% 06/15/29 144A	185,000.00	192,862.50	
NRG ENERGY INC 5.75% 01/15/28	1,140,000.00	1,206,975.00	
NRG ENERGY INC 6.625% 01/15/27	1,175,000.00	1,258,718.75	
NUMERICABLE 7.375% 05/26 144A	1,395,000.00	1,447,731.00	
NVA HLDGS INC 6.875% 4/26 144A	145,000.00	153,881.25	
OASIS PETE INC 6.875% 3/15/22	322,000.00	317,170.00	
OCI NV 6.625% 4/15023 144A	855,000.00	882,787.50	
ODEBRECHT FIN 7.125 6/42 144A	850,000.00	45,687.50	
ODEBRECHT FIN 7.5% PERP 144A	750,000.00	40,912.50	

OIL & GAS 7.625% 11/07/24 144A	200,000.00	221,812.00	
OIL & GAS HLDG 7.5% 10/27 144A	160,000.00	175,499.20	
PAC DRLL 2LN PIK VAR 4/24 144A	21,713.00	21,170.17	
PACIFIC GAS & ELEC 3.95% 12/47	30,000.00	27,660.00	
PACIFIC GAS & ELEC 4% 12/1/46	15,000.00	13,912.50	
PACIFIC GAS &ELE 3.75% 8/15/42	30,000.00	27,675.00	
PARK AERO 4.5% 03/15/23 144A	60,000.00	62,257.20	
PARK AEROSPACE 5.5% 2/24 144	975,000.00	1,055,437.50	
PARSLEPARSLEY ENG 6.25% 6/24 1	95,000.00	98,325.00	
PARSLEY 5.625% 10/15/27 144A	145,000.00	149,683.50	
PBF HLDG / FIN 7.25% 06/15/25	250,000.00	260,000.00	
PBF LOGISTICS 6.875% 05/23	515,000.00	526,999.50	
PEABODY SEC 6% 3/31/22 144	115,000.00	117,300.00	
PEABODY SEC 6.375% 3/25 144A	145,000.00	148,443.75	
PEMEX PROJ GLBL 8.625%	80,000.00	86,520.00	
PENN NATL 5.625% 1/15/27 144A	80,000.00	80,300.00	
PETKIM 5.875% 1/26/23 144A	290,000.00	278,400.00	
PETROBRAS GLB FINA 8.75% 05/26	590,000.00	739,122.50	
PETROBRAS INTL 6.875% 1/20/40	100,000.00	111,900.00	
PG&E 6.05% 3/01/34	740,000.00	832,500.00	
PILGRIM PRIDE 5.875% 9/27 144A	175,000.00	182,864.50	
PILGRIMS PRIDE 5.75% 3/25 144A	100,000.00	103,000.00	
PLASTIPAK HLD 6.25% 10/25 144A	85,000.00	75,650.00	
PLATFORM 5.875% 12/1/25 144A	70,000.00	70,165.90	
POST HLDGS 5% 08/15/26 144A	815,000.00	824,168.75	

POST HLDGS 5.625% 01/28 144A	405,000.00	414,618.75	
POST HLDGS 5.75% 3/1/27 144	590,000.00	607,700.00	
PRIDE INTL INC 7.875% 8/15/40	685,000.00	457,237.50	
PT BUKIT MAK 7.75% 2/13/22 144	295,000.00	300,531.25	
PT PERTAMINA 6.5% 11/7/48 144A	100,000.00	124,687.00	
QORVO INC 5.5% 07/15/26	290,000.00	306,675.00	
RADIATE HOLD 6.875% 2/23 144A	100,000.00	101,000.00	
RADIATE HOLDCO 6.625% 2/25 144	140,000.00	136,085.60	
RITE AID 6.875% 12/15/28 144A	1,865,000.00	1,119,000.00	
RITE AID CORP 7.7% 2/15/27	510,000.00	321,300.00	
ROSE ROCK MIDSTRM 5.625% 07/22	560,000.00	550,037.60	
RUMO LUXEMBG 7.375% 2/9/24 144	115,000.00	123,625.00	
RURAL/METRO C 10.125 7/19 REGS	10,000.00	-	
SABLE INTL 5.75% 9/7/27 144A	385,000.00	394,625.00	
SABRA HLTH /CPTL 5.375% 6/1/23	360,000.00	366,318.00	
SANCHEZ ENERGY 6.125% 1/15/23	725,000.00	36,250.00	
SANCHEZ ENERGY 7.25% 2/23 144A	865,000.00	674,700.00	
SAUDI ARABIA 3.5% 4/16/29 144A	190,000.00	194,902.00	
SAUDI ARABIAN 4.375% 4/49 144A	195,000.00	202,068.75	
SAUDI ARABIAN OIL 4.25% 04/39	280,000.00	290,850.00	
SCIENTIFIC GAMES 10% 12/1/22	1,181,000.00	1,231,936.53	
SCIENTIFIC GAMES 6.25 9/20 WI	120,000.00	120,000.00	

SCRIPPS ESCRO 5.875% 7/27 144A	180,000.00	182,160.00	
SEMGROUP CORP 7.25% 03/15/26	700,000.00	682,500.00	
SERVICE CO INTL 5.125% 6/1/29	105,000.00	110,512.50	
SESI LLC 7.75% 09/15/24	190,000.00	102,125.00	
SIRIUS XM 4.625% 7/15/24 144A	290,000.00	297,250.00	
SLM CORP 5.5% 12/31/23	330,000.00	339,487.50	
SLM CORP 6.125% 03/25/2024	1,085,000.00	1,127,043.75	
SM ENERGY CO 5.0% 01/15/2024	450,000.00	401,625.00	
SM ENERGY CO 5.625% 06/01/25	725,000.00	623,500.00	
SM ENERGY CO 6.625% 1/15/27	190,000.00	165,300.00	
SM ENERGY CO 6.75% 09/15/26	210,000.00	186,112.50	
SOLERA LLC/FIN 10.5% 3/24 144A	2,015,000.00	2,168,643.75	
SOUTHERN GAS 6.875% 03/26 144A	345,000.00	402,442.50	
SOUTHWESTERN ENRGY 7.5% 4/1/26	280,000.00	249,200.00	
SOUTHWESTERN ENRGY 7.75% 10/27	210,000.00	186,375.00	
SPRINGLEAF FIN 6.875% 3/15/25	240,000.00	263,400.00	
SPRINGLEAF FIN CRP 7.125% 3/26	860,000.00	942,302.00	
SPRINGLEAF FINA 6.625% 1/15/28	135,000.00	143,775.00	
SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32	725,000.00	851,875.00	
SPRINT CAP CRP 6.875% 11/15/28	570,000.00	599,925.00	
SPRINT CORP 7.125% 06/15/24	895,000.00	950,937.50	
SPRINT CORP 7.62% 02/15/2025	210,000.00	226,800.00	
SPRINT CORP 7.625% 03/01/2026	230,000.00	247,825.00	

SPRINT CORP 7.875% 9/15/23	1,415,000.00	1,545,887.50	
SSB NO.1 PLC 9.375% 03/10/23	80,000.00	83,300.00	
STARFRUIT FI/LLC 8% 10/26 144A	155,000.00	151,125.00	
STILLWATER 6.125% 6/27/22 144A	495,000.00	499,331.25	
SUMMIT MIDSTREAM 5.75% 4/25	280,000.00	239,400.00	
SUNOCO LP /CORP 0% 02/15/26	265,000.00	273,612.50	
SUNOCO LP /CORP 6% 04/15/27	520,000.00	548,600.00	
SUNOCO LP/ SUNO 4.875% 1/15/23	310,000.00	315,425.00	
SURGERY CTR 10% 04/15/27 144A	260,000.00	258,700.00	
TARGA RES 6.5% 7/15/27 144A	125,000.00	135,156.25	
TARGA RES 6.875% 1/15/29 144A	220,000.00	240,856.00	
TARGA RES LP 5.375% 02/01/27	260,000.00	267,800.00	
TARGA RES LP/FI 4.25% 11/15/23	250,000.00	249,687.50	
TARGA RES P 5.875% 4/26	210,000.00	221,550.00	
TAYLOR MOR 5.875% 6/15/27 144A	165,000.00	169,537.50	
TAYLOR MORRISON CMNTY/ MONARCH	240,000.00	242,700.00	
TC ZIRAAT BANKASI AS 5.125% 05	75,000.00	70,031.25	
TC ZIRAAT BNK4.75%4/29/21 144A	125,000.00	119,531.25	
TEEKAY COR 9.25% 11/15/22 144A	185,000.00	191,012.50	
TEINE ENERGY 6.875% 09/22 144A	530,000.00	533,975.00	
TELECOM ARGEN 8% 07/18/26 144A	50,000.00	50,160.00	
TEMPO ACQ 6.75% 06/01/25 144A	155,000.00	157,129.70	

TENET HEALTHCA 6.25% 2/27 144A	585,000.00	602,216.55	
TENET HEALTHCAR 8.125% 4/22 WI	3,240,000.00	3,410,100.00	
TENET HEALTHCARE 5.125% 5/1/25	1,075,000.00	1,077,687.50	
TENET HEALTHCARE 6.75% 6/15/23	840,000.00	845,250.00	
TENET HEALTHCRE 4.625% 7/15/24	1,660,000.00	1,689,050.00	
TERRAFORM POWE 4.25% 1/23 144A	145,000.00	145,362.50	
TERRAFORM POWER 5% 1/28 144A	150,000.00	150,937.50	
TERRAFORM POWR 6.12% 6/25 144A	400,000.00	420,000.00	
TESORO LOG LP/FN 6.375% 5/24	340,000.00	356,150.00	
TINKOFF CRDT 9.25/VAR PERP RGS	200,000.00	209,186.00	
TOPS MARKETS CORP ESCROW	1,325,000.00	-	
TOPS MKTS LLC PIK VAR 11/19/24	254,207.00	256,749.07	
TPC GROUP 8.75% 12/15/20 144A	660,000.00	655,050.00	
TRADE BK MONG 9.375% 5/20 144A	305,000.00	315,101.60	
TRANSDIGM 7.5% 03/15/27 144A	855,000.00	899,631.00	
TRANSDIGM INC 6.25% 3/26 144A	240,000.00	252,201.60	
TRANSDIGM UK 6.875% 05/15/26	270,000.00	274,725.00	
TRANSOCEAN 5.375% 5/15/23 144A	245,000.00	246,531.25	
TRANSOCEAN 7.25% 11/25 144A	495,000.00	458,493.75	
TRIVIUM PACKAG 8.5% 08/27 144A	125,000.00	129,687.50	
TRIVIUM PACKING 5.5% 8/26 144A	125,000.00	128,750.00	
TTM TECH 5.625% 10/1/25 144A	105,000.00	102,243.75	
TURKIYE GRNTI 4.75% 10/19 144A	75,000.00	74,718.75	
TURKIYE IS BA AS 5% 04/20 144A	80,000.00	79,599.20	

TURKIYE VAKIFL 5.75% 1/23 144A	430,000.00	390,805.50	
TV AZTECA SAB 8.25% 8/9/24 RGS	800,000.00	798,744.00	
TWIN RIVER WORLDWID 6.75% 6/27	130,000.00	134,875.00	
UBER TECHNOLOGIE 8% 11/26 144A	285,000.00	303,525.00	
UKRAI RLWY 9.875% 9/15/21 144A	140,000.00	143,500.00	
ULTRA RESCS PIK 11% 07/12/24	335,762.00	94,013.36	
US AWYS 12-2 A 4.625% 12/03/26	24,881.12	26,808.16	
US AWYS 12-2 B 6.75% 12/3/22	20,950.41	22,168.67	
US AWYS 2013-1B 5.375% 5/15/23	141,641.42	147,462.88	
USA COMPRESSIO 6.875% 04/01/26	100,000.00	103,500.00	
USIS MERGER 6.875% 05/25 144A	405,000.00	401,456.25	
VALEANT PHARM 5.5% 11/25 144A	145,000.00	150,075.00	
VALEANT PHARM 5.5% 3/23 144A	305,000.00	306,906.25	
VALEANT PHARM 8.50% 1/27 144A	185,000.00	203,037.50	
VALEANT PHARMA 9.25% 4/26 144A	700,000.00	777,875.00	
VECTOR GROUP 6.125% 2/1/25 144	620,000.00	575,155.40	
VEDANTA RES 6.375% 7/22 144A	350,000.00	347,921.00	
VEDANTA RES PLC 8.25 6/21 144A	175,000.00	184,187.50	
VEDANTA RESOURCE 9.25% 4/23/26	200,000.00	203,000.00	
VERITAS /BERMU 10.5% 2/24 144A	1,640,000.00	1,439,100.00	
VERITAS US/BER 7.5% 02/23 144A	125,000.00	119,375.00	
VIACOM INC 5.875/VAR 02/28/57	260,000.00	267,930.00	

VIACOM INC 6.25/VAR 02/28/57	350,000.00	368,375.00	
VIRGIN MEDIA FI 4.875% 2/15/22	200,000.00	199,938.00	
VISTRA OP CO 5.625% 02/27 144A	555,000.00	577,893.75	
VISTRA OPERATI 5% 7/31/27 144A	405,000.00	410,819.85	
VISTRA OPERATIO 5.5% 9/26 144A	340,000.00	354,875.00	
VIZIENT 6.25% 05/15/27 144A	50,000.00	52,625.00	
VOC CRUISE LTD 5% 2/15/28 144A	240,000.00	243,600.00	
VRX ESCROW 5.875% 5/23 144A	212,000.00	213,986.44	
VRX ESCROW 6.125% 4/15/25 144A	610,000.00	620,675.00	
VTR FIN BV 6.875% 1/15/24 144A	185,000.00	191,069.85	
W&T OFFSHORE 9.75% 11/23 144A	185,000.00	174,362.50	
WALTER ENERGY 9.5% 10/19 144A	735,000.00	-	
WAYNE MERGER 8.25% 8/1/23 144A	15,000.00	15,337.50	
WEATHERFORD 9.875% 02/15/24	245,000.00	116,833.15	
WEATHRFRD 9.875% 03/01/25	1,265,000.00	594,550.00	
WELLCARE HEALTH 5.25% 4/1/25	280,000.00	289,450.00	
WELLCARE HLTH 5.375% 8/26 144A	155,000.00	163,583.90	
WHITING PETRO 6.625% 01/15/26	195,000.00	176,475.00	
WILLIAM LYON HOMES INC 6.625%	145,000.00	142,462.50	
WIND TRE SPA 5% 01/20/26 144A	495,000.00	482,199.30	
WP ROCKET MRGR 10.125 7/19 REG	15,000.00	-	
WYNDHAM HOTEL 5.375% 4/26 144A	420,000.00	439,950.00	

	WYNN LAS VEGAS 5.25% 5/27 144A	480,000.00	488,400.00	
	WYNN MACAU 4.875% 10/24 144A	225,000.00	224,295.75	
	WYNN MACAU 5.5% 10/27 144A	275,000.00	270,358.00	
	ZAYO GRP/CAP 5.75% 1/15/27 144	780,000.00	793,728.00	
	ZENITH BNK 7.375% 5/30/22 144A	455,000.00	483,437.50	
	ZIGGO SEC 5.5% 1/15/27 144A	980,000.00	998,375.00	
	アメリカ・ドル 小計	213,201,409.37	200,462,596.51 (21,645,951,171)	
社債券 合計			21,645,951,171 (21,645,951,171)	
合計			53,201,524,333 (51,768,061,393)	

（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 5銘柄	0.54%	-%	-%	86.22%
	新株予約権証 券 1銘柄	-%	-%	-%	
	国債証券 148銘柄	-%	-%	46.79%	
	地方債証券 7銘柄	-%	-%	0.63%	
	特殊債券 41銘柄	-%	-%	3.77%	
	社債券 436銘柄	-%	-%	48.27%	
イギリス・ポンド	国債証券 3銘柄	-%	-%	100%	2.76%
カナダ・ドル	国債証券 4銘柄	-%	-%	100%	2.76%
ユーロ	国債証券 11銘柄	-%	-%	100%	8.26%

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	AKZONOBEL TERM B 10/01/25 C1	23,546.96	96.99 22,840.31	98.19 23,122.17	281.86	-
	AKZONOBEL TERM B 10/01/25 C2	121,090.53	96.99 117,456.60	98.19 118,906.05	1,449.45	-
	ALLIANT TERM B-2 1LN 05/10/25 C1	190,000.00	98.57 187,292.50	98.57 187,284.90	7.60	-
	ATHENAHEALTH TERM B 1LN 02/26 C1	588,525.00	99.87 587,789.34	100.12 589,260.65	1,471.31	-
	CAL RES 1LN 2ND OUT TERM 12/31/21 C1	465,000.00	100.70 468,292.20	99.50 462,675.00	5,617.20	-
	CINEMARK TERM B 03/29/25 C8	1,237.50	99.34 1,229.44	99.34 1,229.38	0.06	-
	CINEWORLD TERM B 1LN 2/28/25 C1	743,988.32	98.22 730,804.84	99.12 737,478.42	6,673.58	-
	CITGO TERM LOAN B 1LN 03/27/24 C1	495,000.00	100.12 495,618.75	100.00 495,000.00	618.75	-
	HEXION TERM B-EXIT 1LN 6/27/26 C1	20,000.00	99.00 19,800.00	99.87 19,975.00	175.00	-
	INFO RES TERM B 1LN 11/30/25 C1	621,375.00	99.81 620,206.81	97.62 606,617.34	13,589.47	-
	KINDERCARE TERM B EXT 02/02/25 C1	25,944.60	99.56 25,833.03	99.77 25,885.18	52.15	-
	KINDERCARE TERM B EXT 02/02/25 C2	74,528.26	99.56 74,207.78	99.77 74,357.59	149.81	-
	KRONOS TERM B 1LN 11/01/23 C2	260,000.00	99.76 259,383.80	99.89 259,714.00	330.20	-
	PIKE TERM B 1LN 07/19/26	40,000.00	99.75 39,900.00	99.75 39,900.00	-	-
	PROJECT EPIC TRM B 1LN 3/1/26 C1	810,000.00	98.21 795,573.90	98.37 796,837.50	1,263.60	-
	REFINITIV TERM B 10/01/2025 C1	1,584,256.95	97.38 1,542,876.15	98.32 1,557,657.27	14,781.12	-
	SBA COMMUNICATIONS TERM B 4/25 C1	94,050.00	98.62 92,755.87	99.26 93,354.97	599.10	-
	SOUTHEASTERN GROC TERM B 5/24 C1	505,263.16	95.54 482,778.94	95.54 482,738.52	40.42	-
	SOUTHEASTERN GROC TERM B 5/24 C2	497,763.15	95.54 475,607.71	95.54 475,572.86	34.85	-
SOUTHEASTERN GROC TERM B 5/24 C3	481,973.69	95.54 460,525.86	95.54 460,487.30	38.56	-	

TRANSDIGM TERM E EXT 5/30/25 C1	329,166.67	97.72 321,664.96	98.68 324,841.41	3,176.45	-
TRANSDIGM TERM G 8/22/24 C1	284,278.48	97.83 278,118.16	98.65 280,457.77	2,339.61	-
TRAVELPORT TERM 1LN 03/18/26	255,000.00	96.11 245,100.00	95.87 244,481.25	618.75	-
TRAVELPORT TERM 1LN 03/18/26 C1	370,000.00	93.98 347,750.00	95.87 354,737.50	6,987.50	-
UFC TERM B 1LN 04/29/2026 C1	204,474.36	99.83 204,132.88	100.09 204,664.52	531.64	-
ULTIMATE SOFTWARE TERM 1LN 4/26 C1	70,000.00	100.18 70,131.60	100.57 70,402.50	270.90	-
US RENAL CARE TM B 1LN 6/13/26 C1	985,000.00	98.00 965,300.00	97.63 961,744.15	3,555.85	-
VIZIENT TERM B-5 05/06/26 C1	29,925.00	100.09 29,954.92	100.09 29,954.92	-	-
WEB COM GROUP TRM 2LN 10/11/26 C1	91,476.16	97.99 89,646.63	98.24 89,875.32	228.69	-
WEB COM GRP TM B 1LN 10/11/25 C1	40,890.40	99.04 40,498.66	98.83 40,414.02	84.64	-
貸付債権 / アメリカ・ドル 小計		10,093,071.64 (1,089,849,875)	10,109,627.46 (1,091,637,573)	16,555.82 (1,787,698)	
貸付債権 合計		1,089,849,875 (1,089,849,875)	1,091,637,573 (1,091,637,573)	1,787,698 (1,787,698)	
合計		1,089,849,875 (1,089,849,875)	1,091,637,573 (1,091,637,573)	1,787,698 (1,787,698)	

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）

（2019年8月30日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	45,068,703,214	円
負債総額	104,143,986	円
純資産総額（ - ）	44,964,559,228	円
発行済数量	72,728,626,912	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6183	円

Bコース（為替ヘッジなし）

（2019年8月30日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	5,508,134,616	円
負債総額	16,470,688	円
純資産総額（ - ）	5,491,663,928	円
発行済数量	9,013,622,502	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6093	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

（2019年8月30日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	56,614,801,226	円
負債総額	565,794,313	円
純資産総額（ - ）	56,049,006,913	円
発行済数量	18,878,807,348	口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.9689	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（2019年2月末日現在）

（略）

< 訂正後 >

(1) 資本金等（2019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）

2019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160本、親投資信託53本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,266,176,997,307円です。

< 訂正後 >

（略）

2019年8月30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159本、親投資信託52本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,135,811,520,055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33期事業年度（2018年4月1日から2019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32期 (2018年3月31日)	第33期 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	975,413	1,427,907
立替金	72,930	100,317
前払費用	28,800	13,866
未収委託者報酬	5,464,066	5,388,448
未収収益	1,921,861	741,116
未収入金	* 1 365,790	150,419
繰延税金資産	607,573	-
未収還付法人税等	-	50,510
未収還付消費税等	-	120,394
流動資産計	9,436,436	7,992,981
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 22,863,900	23,346,748
長期差入保証金	17,804	25,145
繰延税金資産	778,438	1,089,396
その他	230	430
投資その他の資産合計	23,660,373	24,461,720
固定資産計	23,667,860	24,469,207
資産合計	33,104,296	32,462,188
負債の部		
流動負債		
預り金	103,438	30,687
未払金	* 1	
未払手数料	2,425,583	2,369,952
その他未払金	2,622,149	1,653,290
未払費用	551,982	592,634
未払法人税等	193,363	-
未払消費税等	291,148	-
賞与引当金	1,858,394	1,469,810
その他流動負債	931	931
流動負債合計	8,046,992	6,117,307
固定負債		
長期賞与引当金	239,904	298,547
退職給付引当金	4,786,190	4,712,577
固定負債合計	5,026,094	5,011,125
負債合計	13,073,087	11,128,432
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	18,931,208	20,233,755
利益剰余金合計	19,031,208	20,333,755
株主資本合計	20,031,208	21,333,755
純資産合計	20,031,208	21,333,755
負債・純資産合計	33,104,296	32,462,188

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第32期 （自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）	第33期 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	47,015,140	38,212,229
その他営業収益	4,392,629	3,152,985
営業収益計	51,407,769	41,365,214
営業費用	* 1	
支払手数料	22,128,840	17,804,844
広告宣伝費	493,950	504,887
調査費		
調査費	487,993	606,194
委託調査費	10,160,657	7,658,693
営業雑経費		
通信費	50,195	35,533
印刷費	117,152	63,293
協会費	35,503	30,701
諸会費	1,555	2,487
営業費用計	33,475,849	26,706,635
一般管理費		
給料		
給料・手当	2,529,490	2,408,072
賞与	2,272,929	1,717,394
福利厚生費	593,981	580,285
交際費	27,478	22,538
旅費交通費	176,209	156,818
租税公課	129,039	96,478
弁護士報酬	15,719	9,625
不動産賃貸料・共益費	602,626	598,215
支払ロイヤリティ	1,033,326	305,883
退職給付費用	201,666	210,619
消耗器具備品費	5,733	8,177
事務委託費	6,503,327	6,249,198
諸経費	322,446	325,845
一般管理費計	14,413,974	12,689,151
営業利益	3,517,944	1,969,426
営業外収益		
受取利息	* 1	122,290
保険配当金	8,991	8,570
為替差益	86,339	-
雑益	4,534	6,818
営業外収益計	222,156	154,868
営業外費用		
寄付金	-	41
為替差損	-	90,627
営業外費用計	-	90,668
経常利益	3,740,101	2,033,626
特別損失		
特別退職金	285,710	49,075
事務過誤損失	596	-
特別損失計	286,306	49,075
税引前当期純利益	3,453,794	1,984,550
法人税、住民税及び事業税	1,212,425	385,388
法人税等調整額	(136,204)	296,615
法人税等合計	1,076,221	682,003
当期純利益	2,377,574	1,302,546

(3)【株主資本等変動計算書】

第32期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本				
	資本金	利益準備金	利益剰余金		株主資本合計
			その他利益剰余金	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

第33期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本				
	資本金	利益準備金	利益剰余金		株主資本合計
			その他利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	1,000,000	100,000	18,931,208	19,031,208	20,031,208
当期変動額					
当期純利益	-	-	1,302,546	1,302,546	1,302,546
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	1,302,546	1,302,546	1,302,546
当期末残高	1,000,000	100,000	20,233,755	20,333,755	21,333,755

	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	-	-	20,031,208
当期変動額			
当期純利益	-	-	1,302,546
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-
当期変動額合計	-	-	1,302,546
当期末残高	-	-	21,333,755

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）

「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

2022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。

表示方法の変更

1. 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用
 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）等を当会計期間から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

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32期 (2018年3月31日)	第33期 (2019年3月31日)
未収入金	75,889 千円	108,246 千円
その他未払金	2,274,334 千円	1,254,001 千円
長期貸付金	21,400,000 千円	21,850,000 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32期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第33期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
営業費用	13,524,345 千円	11,203,862 千円
受取利息	57,463 千円	61,374 千円

(株主資本等変動計算書関係)

第32期(自 2017年4月1日 至 2018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33期(自 2018年4月1日 至 2019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32期（2018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	-

第33期（2019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	1,427,907	1,427,907	-
(2) 未収委託者報酬	5,388,448	5,388,448	-
(3) 未収収益	741,116	741,116	-
(4) 未収入金	150,419	150,419	-
(5) 長期貸付金	23,346,748	23,346,748	-
資産計	31,054,638	31,054,638	-
(1) 未払手数料	2,369,952	2,369,952	-
(2) その他未払金	1,653,290	1,653,290	-
(3) 未払費用	592,634	592,634	-
負債計	4,615,876	4,615,876	-

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法に関する事項

第32期（2018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。

第33期(2019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、(3) 未払費用

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32期(2018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。

第33期(2019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	1,427,907	-	-	-
未収委託者報酬	5,388,448	-	-	-
未収収益	741,116	-	-	-
未収入金	150,419	-	-	-
合計	7,707,892	-	-	-

金銭債権のうち長期貸付金(23,346,748千円)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32期(2018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2017年4月1日 至2018年3月31日)
該当事項はありません。

第33期(2019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2018年4月1日 至2019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32期（自 2017年4月1日 至 2018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>

退職給付引当金	4,786,190
<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。

第33期（自 2018年4月1日 至 2019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	4,776,447
勤務費用	177,913
利息費用	7,651
数理計算上の差異の発生額	35,733
退職給付の支払額	341,816
制度改定による変動額	-
為替変動による影響額	120,471
その他	225
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>4,704,708</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	4,704,708
未認識過去勤務費用	7,869
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>4,712,577</u>
<u>退職給付引当金</u>	<u>4,712,577</u>
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>4,712,577</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	177,913
利息費用	7,651
数理計算上の差異の費用処理額	35,733
過去勤務債務の費用処理額	1,874
<u>確定給付型年金制度に係る退職給付費用</u>	<u>147,957</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86,210千円であります。

(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32期 (2018年3月31日)	第33期 (2019年3月31日)
(流動)	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払費用	186,465	101,830
賞与引当金	561,152	441,058
その他	62,704	20,196
繰延税金資産合計	810,321	563,084
繰延税金負債		
未払金	202,748	186,975
繰延税金資産又は繰延税金負債()の純額	607,573	376,109
(固定)	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,473,419	1,451,987
資産除去債務	2,685	2,685
その他	81,708	96,782
繰延税金資産小計	1,557,812	1,551,454
評価性引当額	765,291	803,096
繰延税金資産合計	792,521	748,358
繰延税金負債		
長期貸付金	14,084	35,073
繰延税金資産又は繰延税金負債()の純額	778,437	713,285

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32期 (2018年3月31日)	第33期 (2019年3月31日)
法定実効税率	30.62%	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.32%	1.81%
評価性引当額	1.47%	1.90%
過年度法人税等	0.27%	0.04%
税率変更差異	0.00%	0.00%
その他	0.42%	0.08%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.16%	34.38%

(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認められる金額を合理的に見積り、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32期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）及び 第33期（自 2018年4月1日 至 2019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32期（自2017年4月1日 至2018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

第33期（自2018年4月1日 至2019年3月31日）

1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 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ハイ・イールド・ファンド	10,579,865	投資信託の運用
フィデリティ・USリート・ファンドB（為替ヘッジなし）	9,025,455	投資信託の運用
フィデリティ・日本成長株・ファンド	5,447,177	投資信託の運用

関連当事者情報

第32期（自 2017年4月1日 至 2018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） 共通発生 経費負担額 （注4）	千円 41,611 9,313,596	未収入金 未払金	千円 55,710 565,117
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） 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	千円 1,370,000 57,463 525,884 -	長期 貸付金 未収入金 未払金 未払金	千円 21,400,000 20,178 100,806 926,608
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。

第33期(自 2018年4月1日 至 2019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 - 6,977,863	未収入金 未払金	千円 82,094 557,126
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	千円 450,000 61,374 429,152 -	長期 貸付金 未収入金 未払金 未払金	千円 21,850,000 20,309 81,239 294,863
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 3,796,845	未払金	千円 314,928

(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 9,257,500	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 600,501 877,675	未払金 未払金	千円 23,643 174,703
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 717,522	未払金	千円 71,425
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 305,883	未払金	千円 127,244

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32期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第33期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	1,001,560円45銭	1,066,687円79銭
1株当たり当期純利益	118,878円71銭	65,127円34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32期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第33期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(千円)	2,377,574	1,302,546
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)	2,377,574	1,302,546
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 (2019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	9,257百万円	
	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	
	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	
十六 T T 証券株式会社	3,000百万円 (2019年6月3日現在)		
O K B 証券株式会社	1,500百万円		

	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 [*] * 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	930,000百万円 [*] * 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31百万円 [*]) * 1英ポンド140.46円で換算 (2018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0.88百万円 [*]) * 1米ドル111.00円で換算 (2018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。

新規募集は行ないません。

独立監査人の監査報告書

2019年9月11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2019年1月22日から2019年7月22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2019年7月22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

2019年9月11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2019年1月22日から2019年7月22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2019年7月22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

2019年6月10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2018年4月1日から2019年3月31日までの第33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2019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。