

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2020年10月16日提出
<b>【発行者名】</b>	フィデリティ投信株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 デレック・ヤング
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都港区六本木七丁目7番7号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	照沼 加奈子
<b>【電話番号】</b>	03 - 4560 - 6000
<b>【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券に係 るファンドの名称】</b>	フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き） フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）
<b>【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券の金 額】</b>	各ファンドにつき2兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出致しましたので、2020年4月16日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するとともに、その他の情報について訂正すべき事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

（略）

ファンドの特色

（略）

マザーファンドの資産・アロケーション、米国国債／政府機関債、米国高利回り社債（ハイ・イールド・ボンド）、エマージング諸国等に関する運用にあたっては、フィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニー・エルエルシー<sup>\*</sup>に、運用の指図に関する権限を委託します。

\* 当該運用の委託先は2020年1月1日付でフィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニーから名称を変更しています。

（略）

<訂正後>

（略）

ファンドの特色

（略）

マザーファンドの資産・アロケーション、米国国債／政府機関債、米国高利回り社債（ハイ・イールド・ボンド）、エマージング諸国等に関する運用にあたっては、フィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニー・エルエルシーに、運用の指図に関する権限を委託します。

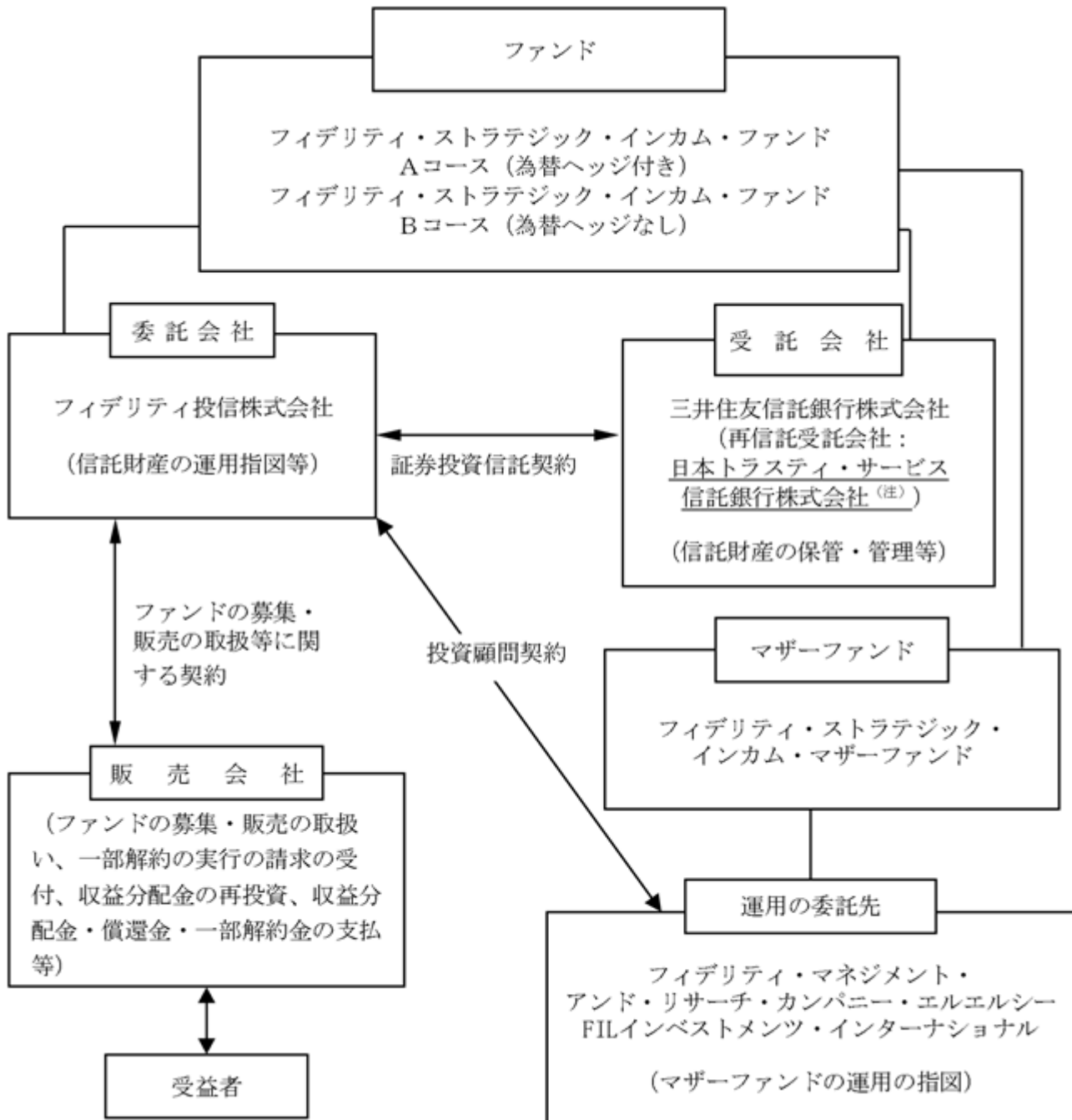
（略）

##### （3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

ファンドの仕組み

（略）



(注) 関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付けでJTCホールディングス株式会社、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社は合併し、商号が「株式会社日本カストディ銀行」となる予定です。

委託会社およびファンドの関係法人

(略)

(b) 受託会社：三井住友信託銀行株式会社

ファンドの受託者として、委託会社との信託契約の締結、信託財産の保管・管理、信託財産の計算（ファンドの基準価額の計算）、外国証券を保管・管理する外国の金融機関への指示および連絡等を行いません。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社<sup>(注)</sup>に委託することができます。

(注) 関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付けでJTCホールディングス株式会社、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社は合併し、商号が「株式会社日本カストディ銀行」となる予定です。

(略)

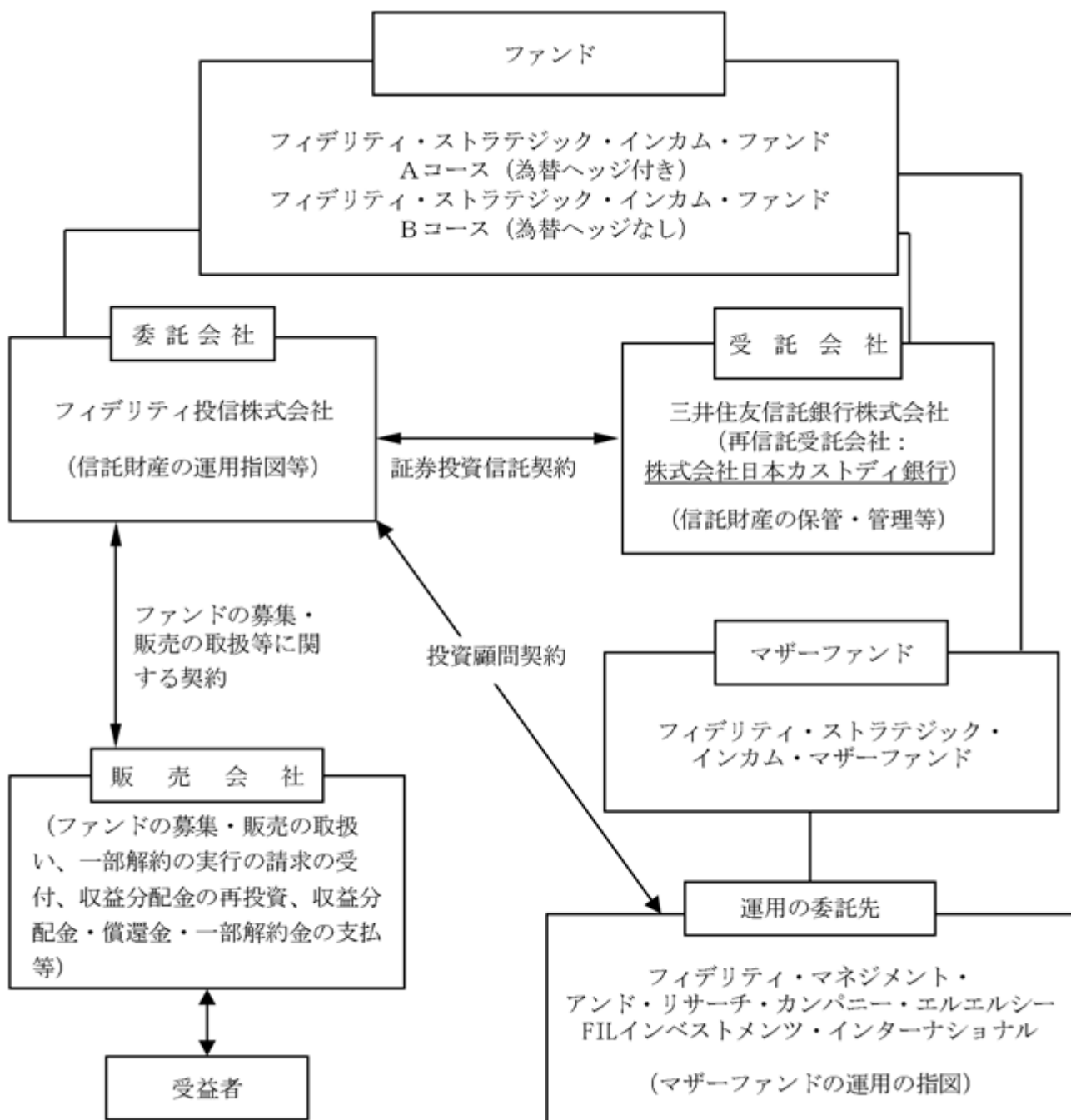
委託会社の概況(2020年2月末日現在)

(略)

<訂正後>

ファンドの仕組み

(略)



委託会社およびファンドの関係法人

(略)

## (b) 受託会社：三井住友信託銀行株式会社

ファンドの受託者として、委託会社との信託契約の締結、信託財産の保管・管理、信託財産の計算（ファンドの基準価額の計算）、外国証券を保管・管理する外国の金融機関への指示および連絡等を行いません。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。

（略）

委託会社の概況（2020年8月末日現在）

（略）

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

&lt;訂正前&gt;

(略)

ファンドのベンチマーク<sup>\*1</sup>

(略)

債券セクター	ベンチマーク	構成割合
(略)		
エマージング債券	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル	15%

\*3 同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。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。

運用方針

(略)

上記の文中で示された考え方は、2020年2月末日現在のものであり、今後、変更となる場合があります。

&lt;訂正後&gt;

(略)

ファンドのベンチマーク<sup>\*1</sup>

(略)

債券セクター	ベンチマーク	構成割合
(略)		
エマージング債券	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル <sup>*4</sup>	15%

\*3 同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。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。

\*4 指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利はJPMorgan Chase & Co.及び関係会社（「JPモルガン」）に帰属しております。JPモルガンは、指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。JPモルガンは、指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドを推奨するものでもなく、  
ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

運用方針

(略)

上記の文中で示された考え方は、2020年8月末日現在のものであり、今後、変更となる場合があります。

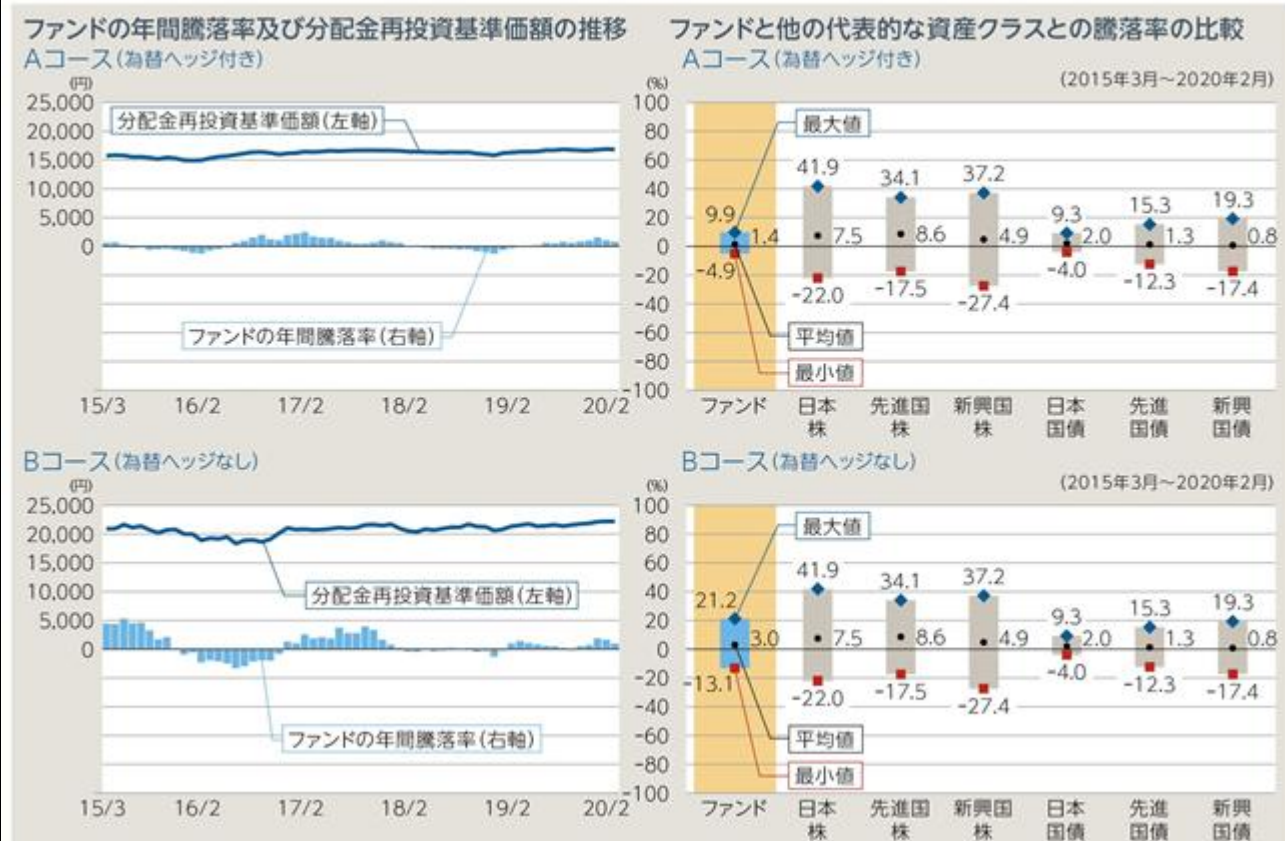


### 3【投資リスク】

<訂正前>

（略）

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2015年3月～2020年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

※「ファンドの年間騰落率」は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率であり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。なお、当騰落率は目盛最大値に比べ値が小さいためにグラフが見えない場合があります。

※「分配金再投資基準価額」は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額であり、実際の基準価額と異なる場合があります。

※2015年3月～2020年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドは税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## 代表的な資産クラスの指数

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

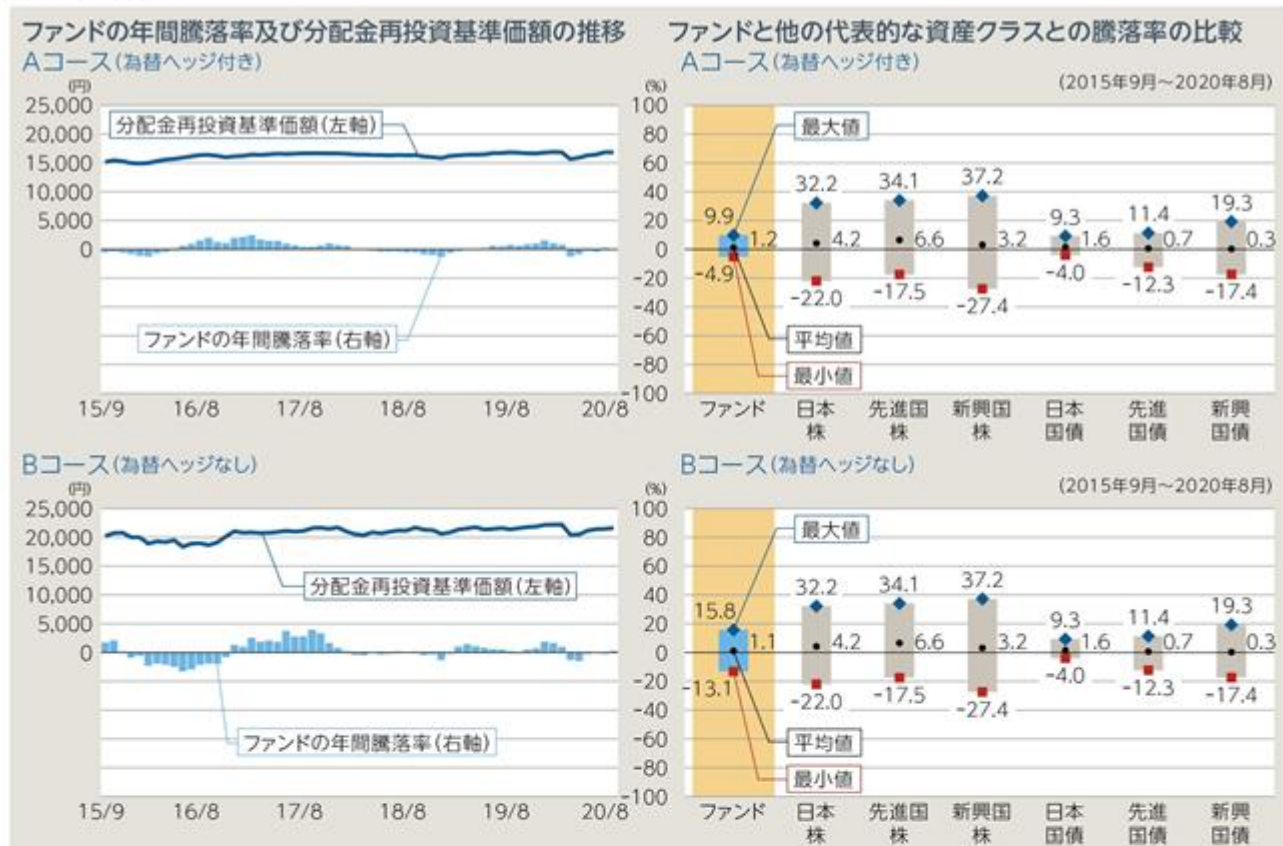
※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、指数提供元にて円換算しております。



&lt; 訂正後 &gt;

(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2015年9月～2020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。

※2015年9月～2020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

<b>日本株</b> TOPIX (配当込)	東証株価指数 (TOPIX) は、株式会社東京証券取引所 (株東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、本商品の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
<b>先進国株</b> 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。
<b>新興国株</b> 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。
<b>日本国債</b> 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。
<b>先進国債</b> 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。
<b>新興国債</b> 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。指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利はJPMorgan Chase & Co. 及び関係会社 (「JPモルガン」) に帰属しております。JPモルガンは、指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。JPモルガンは、指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドを推奨するものでもなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### （５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、2020年2月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更となる場合があります。

（略）

<訂正後>

（略）

上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、2020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）

（2020年8月31日現在）

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	38,398,519,717	100.01
預金・その他の資産（負債控除後）	-	5,034,351	0.01
合計（純資産総額）		38,393,485,366	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

（2020年8月31日現在）

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引（売建）	日本	37,315,150,224	97.19

（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）

（2020年8月31日現在）

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	4,930,575,355	100.05
預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,507,519	0.05
合計（純資産総額）		4,928,067,836	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

(2020年8月31日現在)

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	293,312,072	0.60
	ルクセンブルグ	1,329,107	0.00
	小計	294,641,179	0.60
国債証券	アメリカ	12,183,777,636	24.88
	ドイツ	2,937,551,494	6.00
	イスラエル	1,294,730,771	2.64
	カナダ	1,248,403,989	2.55
	イギリス	1,243,834,739	2.54
	日本	1,241,557,483	2.54
	オランダ	450,423,498	0.92
	イタリア	338,432,590	0.69
	インドネシア	329,815,335	0.67
	ウクライナ	327,463,487	0.67
	ロシア	321,624,570	0.66
	トルコ	229,319,596	0.47
	カタール	223,159,376	0.46
	ナイジェリア	216,402,212	0.44
	エジプト	185,124,484	0.38
	ベトナム	162,681,147	0.33
	アルゼンチン	141,745,886	0.29
	コロンビア	114,066,381	0.23
	ガーナ	112,523,553	0.23
	エルサルバドル	108,417,147	0.22
	メキシコ	107,136,032	0.22
	ウルグアイ	100,824,252	0.21
	パラグアイ	83,551,765	0.17
	ブラジル	74,165,986	0.15
	コートジボアール	70,717,621	0.14
	アンゴラ	69,482,165	0.14
	カメルーン	65,697,576	0.13
	ドミニカ共和国	64,074,231	0.13
	エクアドル	61,526,268	0.13
	ルワンダ	47,778,832	0.10
	ヨルダン	46,918,051	0.10
	ケニア	46,107,011	0.09
	ルーマニア	44,465,882	0.09
アラブ首長国連邦	44,430,101	0.09	
ガボン	43,010,937	0.09	
スリランカ	36,930,924	0.08	

	レバノン	36,691,941	0.07
	オマーン	35,080,560	0.07
	ホンジュラス	34,660,068	0.07
	セルビア	31,270,848	0.06
	ヴェネズエラ	26,698,224	0.05
	バルバドス	26,545,713	0.05
	グアテマラ	26,089,665	0.05
	パナマ	22,876,185	0.05
	フィリピン	22,468,020	0.05
	ウズベキスタン	22,316,512	0.05
	パキスタン	21,835,860	0.04
	モンゴル	21,480,165	0.04
	ベラルーシ	19,702,320	0.04
	ジャマイカ	13,933,860	0.03
	小計	24,779,522,949	50.61
地方債証券	アルゼンチン	41,176,282	0.08
	小計	41,176,282	0.08
特殊債券	アメリカ	481,496,859	0.98
	メキシコ	409,339,702	0.84
	イギリス領バージン 諸島	105,623,400	0.22
	インドネシア	76,991,177	0.16
	アゼルバイジャン	67,000,505	0.14
	南アフリカ	61,714,620	0.13
	アルゼンチン	53,011,094	0.11
	チリ	34,803,959	0.07
	アラブ首長国連邦	24,673,837	0.05
	オランダ	22,665,465	0.05
	ヴェネズエラ	7,200,039	0.01
	小計	1,344,520,657	2.75
社債券	アメリカ	14,322,752,479	29.25
	オランダ	1,112,339,156	2.27
	カナダ	553,060,869	1.13
	ケイマン諸島	552,881,060	1.13
	ルクセンブルグ	479,099,614	0.98
	フランス	233,823,183	0.48
	マーシャル諸島	228,997,363	0.47
	サウジアラビア	207,254,130	0.42
	アイルランド	204,460,826	0.42
	バミューダ	190,591,815	0.39
	イギリス	163,348,021	0.33
	メキシコ	132,394,217	0.27
	ロシア	108,592,866	0.22
	チリ	103,700,612	0.21

グルジア	97,367,232	0.20	
インドネシア	94,499,280	0.19	
パナマ	92,670,705	0.19	
ブラジル	88,934,144	0.18	
ウクライナ	82,764,066	0.17	
イギリス領バージン諸島	81,108,973	0.17	
バーレーン	70,716,484	0.14	
リベリア	68,845,100	0.14	
シンガポール	58,563,819	0.12	
マレーシア	53,771,740	0.11	
オーストリア	47,326,974	0.10	
イスラエル	47,147,188	0.10	
南アフリカ	45,625,516	0.09	
コロンビア	43,396,204	0.09	
ドミニカ共和国	37,210,097	0.08	
パラグアイ	27,796,865	0.06	
タイ	22,036,465	0.05	
カザフスタン	21,875,971	0.04	
ペルー	21,677,820	0.04	
グアテマラ	20,962,473	0.04	
トルコ	19,563,877	0.04	
オーストラリア	17,516,100	0.04	
小計	19,754,673,304	40.35	
預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,746,098,057	5.61
合計（純資産総額）		48,960,632,428	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

（2020年8月31日現在）

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引（買建）	日本	437,596,559	0.89
為替予約取引（売建）	日本	51,172,209	0.10
貸付債権	アメリカ	1,022,939,167	2.08

（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）

（2020年8月31日現在）

順位	種類	銘柄名	国・地域	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	12,581,016,257	3.0664	38,579,605,326	3.0521	38,398,519,717	100.01

## Bコース（為替ヘッジなし）

（2020年8月31日現在）

順位	種類	銘柄名	国・地域	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	1,615,469,793	3.0664	4,953,837,639	3.0521	4,930,575,355	100.05

## 種類別投資比率

## Aコース（為替ヘッジ付き）

（2020年8月31日現在）

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.01

## Bコース（為替ヘッジなし）

（2020年8月31日現在）

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.05

## (参考) マザーファンドの投資有価証券の主要銘柄

## フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

(2020年8月31日現在)

順位	銘柄名	通貨 地域	種類	数量	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 時価金額(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率 (%)
1	USTB 2.50% 02/15/45	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	13,306,000	13,217.30 1,758,694,821	12,783.86 1,701,019,826	2.500 2045/02/15	3.47
2	GERMANY GVT .25% 02/15/29 REGS	ユーロ ドイツ	国債証券	11,580,000	13,430.81 1,555,287,876	13,377.36 1,549,098,341	0.250 2029/02/15	3.16
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	12,214.49 1,217,662,524	12,204.69 1,216,685,713	5.500 2023/09/18	2.49
4	GERMANY GOVT 0% 04/05/24	ユーロ ドイツ	国債証券	9,050,000	12,875.84 1,165,263,792	12,863.94 1,164,186,318	0.000 2024/04/05	2.38
5	UST NOTES 2.875% 11/30/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	7,161,000	11,965.73 856,866,297	11,940.24 855,040,448	2.875 2025/11/30	1.75
6	UST NOTES 2.5% 01/15/2022	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	7,492,000	10,898.12 816,487,324	10,880.00 815,129,629	2.500 2022/01/15	1.66
7	USTN 2.75% 06/30/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	6,712,000	11,810.11 792,695,152	11,787.15 791,153,508	2.750 2025/06/30	1.62
8	USTB 3% 02/15/49	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	5,440,000	14,811.71 805,757,541	14,232.98 774,273,950	3.000 2049/02/15	1.58
9	USTN 2.25% 07/31/21	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	6,800,000	10,762.31 731,837,303	10,741.77 730,440,229	2.250 2021/07/31	1.49
10	USTB 4.75% 2/15/37	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,128,000	16,902.37 697,730,163	16,496.22 680,963,763	4.750 2037/02/15	1.39
11	UST NOTES 2% 07/31/2024	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	5,738,000	11,337.68 650,556,321	11,319.98 649,540,668	2.125 2024/07/31	1.33
12	USTB 6.125%	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,002,000	15,733.93 629,672,102	15,592.86 624,026,199	6.125 2029/08/15	1.27
13	CANADA GOVT 2.25% 02/01/21	カナダ・ドル カナダ	国債証券	7,375,000	8,131.41 599,691,777	8,113.46 598,367,892	2.250 2021/02/01	1.22
14	323 10年国債	日本・円 日本	国債証券	582,950,000	102.01 594,700,030	101.86 593,781,211	0.900 2022/06/20	1.21
15	INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	アメリカ・ドル オランダ	社債券	5,535,000	10,233.09 566,401,531	10,219.92 565,672,572	7.000 2023/06/30	1.16
16	USTN 2.25% 12/31/24	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,703,000	11,466.11 539,251,533	11,445.47 538,280,337	2.250 2024/12/31	1.10
17	USTN .625% 08/15/30	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,871,000	10,473.02 510,141,084	10,427.27 507,912,247	0.625 2030/08/15	1.04
18	UK GOVT 1.5% 1/22/21 RGS	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	3,540,000	14,163.30 501,381,093	14,145.83 500,762,419	1.500 2021/01/22	1.02
19	356 10年国債	日本・円 日本	国債証券	468,000,000	101.14 473,372,640	100.72 471,378,960	0.100 2029/09/20	0.96
20	NETHERLANDS 0% 1/24 144A RGS	ユーロ オランダ	国債証券	3,000,000	12,824.28 384,728,661	12,806.72 384,201,687	0.000 2024/01/15	0.78
21	UK GILT 2.5% 07/22/65 REGS	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	1,645,000	24,329.52 400,220,752	22,804.98 375,141,965	2.500 2065/07/22	0.77

22	USTN 2.5% 01/31/21	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	3,403,000	10,666.01 362,964,464	10,640.94 362,111,139	2.500 2021/01/31	0.74
23	ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	2,499,000	13,873.38 346,695,850	14,289.34 357,090,722	8.000 2031/11/01	0.73
24	USTN .5% 08/31/27	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	3,282,000	10,541.58 345,974,810	10,531.05 345,628,997	0.500 2027/08/31	0.71
25	BTP 2.45% 09/01/50 144A RGS	ユーロ イタリア	国債証券	2,453,000	13,503.45 331,239,820	13,796.68 338,432,589	2.450 2050/09/01	0.69
26	UK GILT .875% 10/22/29 REGS	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	1,990,000	15,064.70 299,787,679	14,843.36 295,382,781	0.875 2029/10/22	0.60
27	TENET HEALTHCAR 8.125% 4/22 WI	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	2,490,000	11,152.35 277,693,664	11,405.22 283,989,978	8.125 2022/04/01	0.58
28	USTN 1.625% 05/31/23	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	2,565,000	10,973.03 281,458,303	10,960.71 281,142,113	1.625 2023/05/31	0.57
29	USTN 1.875% 07/31/22	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	2,560,000	10,902.23 279,097,122	10,886.22 278,687,145	1.875 2022/07/31	0.57
30	BANK OF AMERICA 5.86%/VAR PERP	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	2,285,000	10,770.63 246,109,049	11,484.24 262,414,884	5.875 2049/12/31	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

(2020年8月31日現在)

種類	国内/外国	業種/種別	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	0.15
		運輸	0.15
		食品・生活必需品小売り	0.10
		公益事業	0.19
		メディア・娯楽	0.01
	小計		0.60
公社債券	国内	国債証券	2.54
		小計	2.54
	外国	国債証券	48.08
		地方債証券	0.08
		特殊債券	2.75
		社債券	40.35
	小計	91.25	
合計(対純資産総額比)			94.39

## 【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)

(2020年8月31日現在)

種類	名称等	買建/売建	数量	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	イギリス・ポンド	売建	6,847,000	951,801,470	962,756,670	2.51
	カナダ・ドル	売建	12,971,600	1,040,711,468	1,043,176,072	2.72
	ユーロ	売建	24,036,800	3,021,425,760	3,016,137,664	7.86
	アメリカ・ドル	売建	306,647,800	32,516,932,712	32,293,079,818	84.11

## 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

（2020年8月31日現在）

種類	名称等	買建/売建	数量	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカ・ドル	買建	3,817,499	407,697,531	402,173,609	0.82
	イギリス・ポンド	買建	251,905	35,864,800	35,422,950	0.07
	アメリカ・ドル	売建	485,735	51,628,696	51,172,209	0.10
貸付債権	アメリカ・ドル	-	11,563,958.26	996,776,855	1,022,939,167	2.08

（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】

2020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)
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

2020年1月20日 (第43特定期間)	41,747	41,884	0.6083	0.6103
2020年7月20日 (第44特定期間)	38,536	38,667	0.5885	0.5905
2019年8月末日	44,964	-	0.6183	-
2019年9月末日	43,939	-	0.6131	-
2019年10月末日	43,037	-	0.6079	-
2019年11月末日	42,301	-	0.6049	-
2019年12月末日	41,911	-	0.6084	-
2020年1月末日	41,669	-	0.6099	-
2020年2月末日	40,979	-	0.6061	-
2020年3月末日	37,564	-	0.5610	-
2020年4月末日	37,992	-	0.5689	-
2020年5月末日	38,642	-	0.5811	-
2020年6月末日	38,541	-	0.5838	-
2020年7月末日	38,877	-	0.5963	-
2020年8月末日	38,393	-	0.5936	-

## 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)
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
2020年1月20日 (第43特定期間)	5,471	5,493	0.6246	0.6271
2020年7月20日 (第44特定期間)	5,052	5,073	0.5896	0.5921
2019年8月末日	5,491	-	0.6093	-
2019年9月末日	5,370	-	0.6128	-



2019年10月末日	5,246	-	0.6154	-
2019年11月末日	5,291	-	0.6155	-
2019年12月末日	5,426	-	0.6212	-
2020年1月末日	5,408	-	0.6200	-
2020年2月末日	5,390	-	0.6178	-
2020年3月末日	4,977	-	0.5662	-
2020年4月末日	4,934	-	0.5650	-
2020年5月末日	5,065	-	0.5811	-
2020年6月末日	5,045	-	0.5853	-
2020年7月末日	5,011	-	0.5841	-
2020年8月末日	4,928	-	0.5860	-

## 【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
第43特定期間（248期～253期計算期間合計）	0.0120
第44特定期間（254期～259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
第43特定期間(248期~253期計算期間合計)	0.0150
第44特定期間(254期~259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
第43特定期間（248期～253期計算期間合計）	1.0
第44特定期間（254期～259期計算期間合計）	1.3

## Bコース（為替ヘッジなし）

期	収益率(%)
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
第43特定期間（248期～253期計算期間合計）	4.2
第44特定期間（254期～259期計算期間合計）	3.2

（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
第43特定期間 (2019年7月23日～2020年1月20日)	1,097,240,529	6,110,360,440	68,628,400,622
第44特定期間 (2020年1月21日～2020年7月20日)	1,163,406,908	4,313,273,856	65,478,533,674

（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
第43特定期間 (2019年7月23日～2020年1月20日)	784,142,062	1,606,285,069	8,759,938,700
第44特定期間 (2020年1月21日～2020年7月20日)	648,314,837	838,162,736	8,570,090,801

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## &lt; 参考情報 &gt;

(2020年8月31日現在)

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

※下記データは過去の実績であり、将来の成果を保證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	5,936円	5,860円
純資産総額	383.9億円	49.3億円

## 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)
2020年 4月	20円	25円
2020年 5月	20円	25円
2020年 6月	20円	25円
2020年 7月	20円	25円
2020年 8月	20円	25円
直近1年間累計	240円	300円
設定来累計	8,540円	10,115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	95.2%	銘柄	クーポン	償還日	格付	比率	
転換社債	0.6%	1 米国国債	2.5%	2045/2/15	AA/Aa	3.5%	
株式	0.6%	2 ドイツ国債	0.25%	2029/2/15	AAA/Aaa	3.2%	
現金・その他	3.5%	3 米国政府保証債	5.5%	2023/9/18	AA/Aa	2.5%	
		4 ドイツ国債	0%	2024/4/5	AAA/Aaa	2.4%	
		5 米国国債	2.875%	2025/11/30	AA/Aa	1.7%	
		6 米国国債	2.5%	2022/1/15	AA/Aa	1.7%	
		7 米国国債	2.75%	2025/6/30	AA/Aa	1.6%	
		8 米国国債	3%	2049/2/15	AA/Aa	1.6%	
		9 米国国債	2.25%	2021/7/31	AA/Aa	1.5%	
		10 米国国債	4.75%	2037/2/15	AA/Aa	1.4%	

国・地域別組入状況		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	57.8%	AAA/Aaa	10.3%	アメリカドル	84.2%	米国国債・政府機関債	30.0%
ドイツ	6.0%	AA/Aa	33.5%	ユーロ	7.9%	ハイ・イールド・ボンド	39.2%
カナダ	3.7%	A	3.7%	カナダドル	2.6%	先進国債券 (除く米国)	15.8%
オランダ	3.2%	BBB/Baa	10.0%	イギリス・ポンド	2.6%	エマージング債券	15.1%
イギリス	2.9%	BB/Ba	19.1%	日本・円	2.6%		
イスラエル	2.7%	B	14.5%				
日本	2.5%	CCC/Caa	5.9%				
メキシコ	1.3%	CC/Ca以下	0.7%				
ケイマン諸島 (英領)	1.1%	格付なし	2.3%				
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・地域は発行国・地域を表示しています。

## 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。

※2020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】

### 3【資産管理等の概要】

#### (5)【その他】

<訂正前>

(略)

#### (h) 信託事務処理の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行ないます。

<訂正後>

(略)

#### (h) 信託事務処理の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行ないます。

#### 4【受益者の権利等】

<訂正前>

(略)

(1) 収益分配金に対する請求権

(略)

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払を請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

(略)

<訂正後>

(略)

(1) 収益分配金に対する請求権

(略)

受益者が収益分配金について支払開始日から10年間その支払を請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

(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44特定期間（2020年1月21日から2020年7月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによ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43特定期間 2020年1月20日現在	第44特定期間 2020年7月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	3,191,327	2,751,223
親投資信託受益証券	42,072,969,186	38,837,279,084
派生商品評価勘定	9,835,995	-
未収入金	237,879,092	249,836,183
流動資産合計	42,323,875,600	39,089,866,490
資産合計	42,323,875,600	39,089,866,490
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	316,156,423
未払金	355,167,857	-
未払収益分配金	137,256,801	130,957,067
未払解約金	24,629,139	55,806,409
未払受託者報酬	1,953,109	1,630,407
未払委託者報酬	53,906,093	44,999,426
その他未払費用	3,769,600	3,383,069
流動負債合計	576,682,599	552,932,801
負債合計	576,682,599	552,932,801
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	68,628,400,622	65,478,533,674
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,881,207,621	26,941,599,985
（分配準備積立金）	50,113,766	-
元本等合計	41,747,193,001	38,536,933,689
純資産合計	41,747,193,001	38,536,933,689
負債純資産合計	42,323,875,600	39,089,866,490

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第43特定期間 自 2019年7月23日 至 2020年1月20日	第44特定期間 自 2020年1月21日 至 2020年7月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	64	45
有価証券売買等損益	2,117,129,845	997,986,764
為替差損益	1,339,384,368	760,034,095
<b>営業収益合計</b>	<b>777,745,541</b>	<b>237,952,624</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	11,795,226	10,725,241
委託者報酬	325,549,654	296,017,871
その他費用	3,780,400	3,383,069
<b>営業費用合計</b>	<b>341,125,280</b>	<b>310,126,181</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>436,620,261</b>	<b>548,078,805</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>436,620,261</b>	<b>548,078,805</b>
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>436,620,261</b>	<b>548,078,805</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	4,857,156	1,759,343
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>28,419,351,656</b>	<b>26,881,207,621</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>2,381,170,283</b>	<b>1,771,427,023</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,381,170,283	1,771,427,023
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>427,269,621</b>	<b>485,944,657</b>
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	427,269,621	485,944,657
<b>分配金</b>	<b>847,519,732</b>	<b>799,555,268</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>26,881,207,621</b>	<b>26,941,599,985</b>

## （３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第43特定期間 2020年1月20日現在	第44特定期間 2020年7月20日現在
1．元本の推移		
期首元本額	73,641,520,533 円	68,628,400,622 円
期中追加設定元本額	1,097,240,529 円	1,163,406,908 円
期中一部解約元本額	6,110,360,440 円	4,313,273,856 円
2．受益権の総数	68,628,400,622 口	65,478,533,674 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	26,881,207,621 円	26,941,599,985 円
4．1口当たり純資産額	0.6083 円	0.5885 円

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第43特定期間 自 2019年 7月23日 至 2020年 1月20日</p>	<p style="text-align: center;">第44特定期間 自 2020年 1月21日 至 2020年 7月20日</p>
<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.35%以内の額</p>	<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左</p>
<p>2．分配金の計算過程 （自2019年 7月23日 至2019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（117,322,050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（1,697,693,548円）及び分配準備積立金（229,920,843円）より分配対象収益は2,044,936,441円（1口当たり0.028020円）であり、うち145,962,287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 8月21日 至2019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（107,515,929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（1,674,449,077円）及び分配準備積立金（197,845,661円）より分配対象収益は1,979,810,667円（1口当たり0.027518円）であり、うち143,894,070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 9月21日 至2019年10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（101,524,341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（1,652,487,649円）及び分配準備積立金（159,021,822円）より分配対象収益は1,913,033,812円（1口当たり0.026950円）であり、うち141,970,375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2020年 1月21日 至2020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（125,894,408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（1,581,083,815円）及び分配準備積立金（49,439,366円）より分配対象収益は1,756,417,589円（1口当たり0.025886円）であり、うち135,701,665円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年 2月21日 至2020年 3月23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（96,372,797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（1,561,529,422円）及び分配準備積立金（39,049,439円）より分配対象収益は1,696,951,658円（1口当たり0.025327円）であり、うち134,000,870円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年 3月24日 至2020年 4月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（115,876,294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（1,555,943,619円）及び分配準備積立金（1,412,538円）より分配対象収益は1,673,232,451円（1口当たり0.025065円）であり、うち133,510,986円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p>

(自2019年10月22日 至2019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(99,167,991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(1,632,338,818円)及び分配準備積立金(116,734,130円)より分配対象収益は1,848,240,939円(1口当たり0.026368円)であり、うち140,189,218円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2019年11月21日 至2019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(132,008,700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(1,610,089,936円)及び分配準備積立金(74,468,829円)より分配対象収益は1,816,567,465円(1口当たり0.026280円)であり、うち138,246,981円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2019年12月21日 至2020年1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(119,807,216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(1,598,942,775円)及び分配準備積立金(67,563,351円)より分配対象収益は1,786,313,342円(1口当たり0.026029円)であり、うち137,256,801円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2020年4月21日 至2020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(87,595,082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(1,534,865,429円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は1,622,460,511円(1口当たり0.024384円)であり、うち133,077,766円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2020年5月21日 至2020年6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(133,235,170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(1,480,978,607円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は1,614,213,777円(1口当たり0.024401円)であり、うち132,306,914円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2020年6月23日 至2020年7月20日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(98,412,189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(1,466,133,576円)及び分配準備積立金(914,850円)より分配対象収益は1,565,460,615円(1口当たり0.023908円)であり、うち130,957,067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43特定期間 2020年1月20日現在	第44特定期間 2020年7月20日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	645,982,146	646,153,322
合 計	645,982,146	646,153,322

## （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43特定期間 2020年1月20日 現在			第44特定期間 2020年7月20日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 以外の取引								
為替予 約取引								
売建	41,169,614,883	-	41,159,778,888	9,835,995	37,612,233,053	-	37,928,389,476	316,156,423
アメリ カ・ド ル	35,853,354,701	-	35,845,041,390	8,313,311	32,751,763,597	-	32,964,638,500	212,874,903
イギリ ス・ポ ンド	1,046,397,565	-	1,046,046,690	350,875	966,156,793	-	985,959,312	19,802,519
カナ ダ・ド ル	1,121,740,951	-	1,121,534,370	206,581	1,018,807,105	-	1,026,312,992	7,505,887
ユーロ	3,148,121,666	-	3,147,156,438	965,228	2,875,505,558	-	2,951,478,672	75,973,114
合計	41,169,614,883	-	41,159,778,888	9,835,995	37,612,233,053	-	37,928,389,476	316,156,423

## （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	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	12,726,023,686	38,837,279,084	
親投資信託受益証券 合計		12,726,023,686	38,837,279,084	
合計		12,726,023,686	38,837,279,084	

(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43特定期間 2020年1月20日現在	第44特定期間 2020年7月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	168,078	141,812
親投資信託受益証券	5,469,236,812	5,050,042,183
未収入金	40,053,788	34,799,443
流動資産合計	5,509,458,678	5,084,983,438
資産合計	5,509,458,678	5,084,983,438
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	21,899,846	21,425,227
未払解約金	7,846,170	4,218,624
未払受託者報酬	253,570	212,798
未払委託者報酬	6,998,745	5,873,562
その他未払費用	771,313	740,953
流動負債合計	37,769,644	32,471,164
負債合計	37,769,644	32,471,164
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	8,759,938,700	8,570,090,801
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,288,249,666	3,517,578,527
(分配準備積立金)	311,182,361	244,341,133
元本等合計	5,471,689,034	5,052,512,274
純資産合計	5,471,689,034	5,052,512,274
負債純資産合計	5,509,458,678	5,084,983,438

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第43特定期間 自 2019年7月23日 至 2020年1月20日	第44特定期間 自 2020年1月21日 至 2020年7月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	11	7
有価証券売買等損益	262,273,363	133,627,680
営業収益合計	262,273,374	133,627,673
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,475,771	1,404,609
委託者報酬	40,732,506	38,768,553
その他費用	771,313	740,953
営業費用合計	42,979,590	40,914,115
営業利益又は営業損失( )	219,293,784	174,541,788
経常利益又は経常損失( )	219,293,784	174,541,788
当期純利益又は当期純損失( )	219,293,784	174,541,788
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	1,591,597	5,528,678
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,697,954,485	3,288,249,666
剰余金増加額又は欠損金減少額	622,474,840	334,371,388
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	622,474,840	334,371,388
剰余金減少額又は欠損金増加額	302,127,609	264,043,968
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	302,127,609	264,043,968
分配金	131,527,793	130,643,171
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,288,249,666	3,517,578,527

## （３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第43特定期間 2020年 1 月20日現在	第44特定期間 2020年 7 月20日現在
1．元本の推移 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	9,582,081,707 円 784,142,062 円 1,606,285,069 円	8,759,938,700 円 648,314,837 円 838,162,736 円
2．受益権の総数	8,759,938,700 口	8,570,090,801 口
3．元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っている場合におけるその差額	3,288,249,666 円	3,517,578,527 円
4．1口当たり純資産額	0.6246 円	0.5896 円

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第43特定期間 自 2019年 7月23日 至 2020年 1月20日</p>	<p style="text-align: center;">第44特定期間 自 2020年 1月21日 至 2020年 7月20日</p>
<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.35%以内の額</p>	<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左</p>
<p>2．分配金の計算過程 （自2019年 7月23日 至2019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（12,261,470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（156,086,889円）及び分配準備積立金（388,376,720円）より分配対象収益は556,725,079円（1口当たり0.061423円）であり、うち22,659,453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 8月21日 至2019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（18,542,901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（152,812,810円）及び分配準備積立金（365,673,598円）より分配対象収益は537,029,309円（1口当たり0.061034円）であり、うち21,997,273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 9月21日 至2019年10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（14,909,741円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（152,799,052円）及び分配準備積立金（351,949,755円）より分配対象収益は519,658,548円（1口当たり0.060275円）であり、うち21,553,728円（1口当たり0.002500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2020年 1月21日 至2020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（18,409,538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（185,505,088円）及び分配準備積立金（304,029,350円）より分配対象収益は507,943,976円（1口当たり0.058007円）であり、うち21,891,345円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年 2月21日 至2020年 3月23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（13,110,618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（196,098,669円）及び分配準備積立金（293,356,804円）より分配対象収益は502,566,091円（1口当たり0.057047円）であり、うち22,024,230円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年 3月24日 至2020年 4月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（15,345,033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（195,938,570円）及び分配準備積立金（282,247,820円）より分配対象収益は493,531,423円（1口当たり0.056300円）であり、うち21,915,411円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p>

(自2019年10月22日 至2019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(12,242,642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(160,327,003円)及び分配準備積立金(337,797,853円)より分配対象収益は510,367,498円(1口当たり0.059227円)であり、うち21,542,972円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2019年11月21日 至2019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(17,952,757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(173,503,365円)及び分配準備積立金(323,252,301円)より分配対象収益は514,708,423円(1口当たり0.058825円)であり、うち21,874,521円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2019年12月21日 至2020年1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(17,784,752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(178,278,515円)及び分配準備積立金(315,297,455円)より分配対象収益は511,360,722円(1口当たり0.058375円)であり、うち21,899,846円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2020年4月21日 至2020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(12,936,919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(195,215,511円)及び分配準備積立金(273,285,074円)より分配対象収益は481,437,504円(1口当たり0.055287円)であり、うち21,769,952円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2020年5月21日 至2020年6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(16,989,561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(195,002,118円)及び分配準備積立金(261,472,722円)より分配対象収益は473,464,401円(1口当たり0.054756円)であり、うち21,617,006円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2020年6月23日 至2020年7月20日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(14,229,442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(196,392,126円)及び分配準備積立金(251,536,918円)より分配対象収益は462,158,486円(1口当たり0.053927円)であり、うち21,425,227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43特定期間 2020年1月20日現在	第44特定期間 2020年7月20日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	83,816,268	83,916,272
合 計	83,816,268	83,916,272

## （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	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	1,654,774,947	5,050,042,183	
親投資信託受益証券	合計	1,654,774,947	5,050,042,183	
合計		1,654,774,947	5,050,042,183	

（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	2020年 1月20日現在	2020年 7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,798,286,407	1,609,428,143
株式	293,737,763	287,916,575
国債証券	27,510,649,796	25,292,373,813
地方債証券	145,505,422	57,253,044
特殊債券	984,850,232	1,303,498,564
社債券	21,576,668,444	19,831,779,475
貸付債権	1,203,762,307	1,063,401,580
派生商品評価勘定	689,073	75,502
未収入金	457,889,987	38,270,836
未収利息	548,464,543	524,357,113
前払費用	29,255,026	20,610,298
流動資産合計	54,549,759,000	50,028,964,943
資産合計	54,549,759,000	50,028,964,943
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,842,496	1,293,512
未払金	749,201,460	176,671,811
未払解約金	332,562,836	341,181,567
流動負債合計	1,083,606,792	519,146,890
負債合計	1,083,606,792	519,146,890
純資産の部		
元本等		
元本	17,103,302,296	16,222,992,057
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	36,362,849,912	33,286,825,996
元本等合計	53,466,152,208	49,509,818,053
純資産合計	53,466,152,208	49,509,818,053
負債純資産合計	54,549,759,000	50,028,964,943

## (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 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	2020年1月20日現在	2020年7月20日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	19,160,993,143 円	17,103,302,296 円
期中追加設定元本額	614,002,409 円	666,057,159 円
期中一部解約元本額	2,671,693,256 円	1,546,367,398 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）	13,458,612,708 円	12,726,023,686 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）	1,749,539,942 円	1,654,774,947 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）	962,262,262 円	926,222,488 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）	932,887,384 円	915,970,936 円
計	17,103,302,296 円	16,222,992,057 円
3. 受益権の総数	17,103,302,296 口	16,222,992,057 口
4. 1口当たり純資産額	3.1261 円	3.0518 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	2020年1月20日現在	2020年7月20日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	25,680,010	23,761,425
国債証券	54,959,429	990,727,639
地方債証券	48,403,827	32,830,777
特殊債券	26,418,210	12,162,842
社債券	399,261,692	729,988,985
合 計	406,555,494	191,983,610

(注1) 2020年1月20日現在の当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(2019年7月23日から2020年1月20日まで)に対応するものとなっております。

(注2) 2020年7月20日現在の当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(2019年7月23日から2020年7月20日まで)に対応するものとなっております。

## （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	2020年1月20日 現在			2020年7月20日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	475,286,142	-	476,982,943	1,696,801	368,402,535	-	369,688,914	1,286,379
アメリカ・ドル	332,313,086	-	334,146,586	1,833,500	340,842,939	-	342,048,533	1,205,594
イギリス・ポンド	-	-	-	-	6,791,679	-	6,795,710	4,031
カナダ・ドル	12,861,418	-	12,862,943	1,525	8,072,686	-	8,081,879	9,193
ユーロ	130,111,638	-	129,973,414	138,224	12,695,231	-	12,762,792	67,561
買建	142,973,056	-	143,516,434	543,378	27,559,596	-	27,627,965	68,369
アメリカ・ドル	142,973,056	-	143,516,434	543,378	27,559,596	-	27,627,965	68,369
合計	618,259,198	-	620,499,377	1,153,423	395,962,131	-	397,316,879	1,218,010

## （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	DISH NETWORK CORP A	881	32.74	28,843.94	
	WARRIOR MET COAL INC	242	15.90	3,847.80	
	VISTRA CORP	46,118	19.62	904,835.16	
	PACIFIC DRILLING SA (US)	48,333	0.45	21,749.85	
	SOUTHEASTERN GROCERS INC	10,557	53.54	565,221.78	
	TOPS MARKETS CORP	1,325	351.56	465,817.00	
	LEGACY RESERVES INC NEW	9,287	10.00	92,870.00	
	LEGACY RESERVES INC 144A	59,461	10.00	594,610.00	
アメリカ・ドル	小計	176,204		2,677,795.53 (287,916,575)	
合計		176,204		287,916,575 (287,916,575)	



## (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
国債証券	日本円	323 10年国債	569,950,000	581,497,187	
		356 10年国債	468,000,000	473,372,640	
		9 40年国債	189,300,000	176,620,686	
	日本円 小計		1,227,250,000	1,231,490,513	
	アメリカ・ドル	AID 5.5% 9/18/23	9,969,000.00	11,557,161.39	
		AID UKRAINE 1.471% 09/29/21	1,959,000.00	1,986,621.90	
		ANGOLA GOVT 8% 11/26/29 144A	200,000.00	158,000.00	
		ANGOLA GOVT 8.25% 5/9/28 144A	285,000.00	227,643.75	
		ARAB RP EGYPT 5.875% 6/25 144A	200,000.00	202,186.00	
		ARGENTINA 1.33 12/31/38	395,000.00	160,219.90	
		ARGENTINA GOVT 6.875% 1/11/204	680,000.00	270,932.40	
		ARGENTINA GOVT 8.28% 12/31/33	504,733.68	249,050.72	
		ARGENTINA REP 5.625% 1/26/22	530,000.00	229,225.00	
		ARGENTINA REP 6.875% 4/22/21	880,000.00	378,945.60	
		ARGENTINA REP 7.5% 4/22/26	860,000.00	353,399.80	
		BANQUE CENTRL 5.75% 1/25 144A	215,000.00	190,812.50	
		BARBADOS 6.5% 10/01/29 144A	258,000.00	243,487.50	
		BRAZIL GLBL 8.25% 1/20/34	175,000.00	231,381.50	
		BRAZIL GOVT 3.875% 06/12/30	200,000.00	197,100.00	
		BRAZIL GOVT 5% 01/27/45	250,000.00	248,592.50	
		Belarus 5.875% 24/02/2026 144A	200,000.00	190,310.00	
		CAMEROON RP 9.5% 11/19/25 144A	655,000.00	662,774.85	
		COLOMBIA GOVT 3.125% 04/15/31	200,000.00	203,400.00	
		COLOMBIA GOVT 3.875% 4/25/27	150,000.00	161,325.00	
		COLOMBIA REP 7.375% 9/18/37	120,000.00	168,861.60	
		COLOMBIA REP OF 3% 01/30/30	300,000.00	304,218.00	

DOMIN REP 5.875% 01/30/60 144A	270,000.00	251,604.90	
DOMINICAN REP 6.4% 6/5/49 144A	125,000.00	123,085.00	
DOMINICAN REP 7.45% 04/44 144A	200,000.00	221,686.00	
ECUADOR GOVT 10.75% 03/22 144A	200,000.00	111,000.00	
ECUADOR GOVT 7.875% 3/25 144A	200,000.00	104,562.00	
ECUADOR GOVT 8.875% 10/27 144A	230,000.00	119,600.00	
ECUADOR RP 9.65% 12/13/26 144A	500,000.00	257,500.00	
EGYPT (ARAB) 5.75% 5/24 144A	200,000.00	201,312.00	
EGYPT 7.6003% 3/1/29 144A	330,000.00	337,837.50	
EGYPT GOVT 7.903% 2/21/48 144A	250,000.00	232,420.00	
EGYPT REP OF 7.5% 1/31/27 144A	460,000.00	481,127.80	
EGYPT REP OF 8.5% 1/31/47 144A	260,000.00	257,400.00	
EL SALVADOR 5.875 01/30/25 RGS	155,000.00	138,046.10	
EL SALVADOR 7.625 9/21/34 144A	150,000.00	132,327.00	
EL SALVADOR 7.75% 1/24/23 144A	200,000.00	190,624.00	
EL SALVADOR REP 7.65 6/35 REGS	275,000.00	249,837.50	
EL SALVADOR REPUBLIC OF 7.1246	340,000.00	275,185.80	
EMIRATE OF AB 3.125% 4/30 144A	200,000.00	223,812.00	
GABONESE GOVT 6.375 12/24 144A	211,351.00	200,451.62	
GABONESE REP 6.95 6/16/25 144A	200,000.00	188,874.00	
GHANA GOVT 8.125% 01/26 144A	930,000.00	937,551.60	
GHANA REP 7.625% 05/16/29 RGS	200,000.00	187,750.00	
GUATEMALA GOV 6.125% 6/50 144A	200,000.00	237,500.00	
HONDURAS 5.625% 06/24/30 144A	150,000.00	154,030.50	
HONDURAS RE 6.25% 1/19/27 RGS	150,000.00	159,937.50	

INDONESIA 7.75% 1/17/38 144A	505,000.00	770,125.00	
INDONESIA 8.5% 10/12/35 REGS	1,000,000.00	1,582,500.00	
INDONESIA GOVT 3.85% 10/15/30	200,000.00	223,562.00	
INDONESIA GOVT 4.2% 10/17/50	200,000.00	226,250.00	
INDONESIA REPUBLIC OF 4.45% 04	200,000.00	232,000.00	
ISRAEL GLBL 5.5% 12/4/23	8,000.00	9,359.20	
ISRAEL GOVT 3.8% 05/13/60 RGS	200,000.00	244,268.00	
ISRAEL STATE OF 2.75% 07/03/30	200,000.00	220,670.00	
ISRAEL STATE OF 4.5% 4/3/2120	200,000.00	283,236.00	
IVORY COAST 6.375% 3/3/28 144A	645,000.00	652,456.20	
JAMAICA 8% 3/14/39	100,000.00	129,375.00	
JORDAN GOVT 3% 6/30/25	1,629,000.00	1,814,038.11	
JORDAN GOVT 7.375% 10/47 144A	295,000.00	297,303.95	
JORDAN KINGD 4.95% 7/7/25 144A	200,000.00	196,498.00	
KENYA REP 6.875% 06/24/24 144A	425,000.00	427,125.00	
LEBANE 144A 5.8% 4/14/20 REGS	885,000.00	166,211.85	
LEBANESE REP 6.15% 6/20	180,000.00	33,917.40	
LEBANON REP 6.375% 3/09/20	840,000.00	159,860.40	
MEXICO GOVT 3.25% 04/16/30	200,000.00	202,300.00	
MEXICO UNITED MEX 3.75% 1/28	200,000.00	212,400.00	
MONGOLIA GOVT 5.125 12/22 144A	200,000.00	199,436.00	
NIGERIA GOVT 6.75 1/28/21 144A	200,000.00	202,186.00	
NIGERIA GOVT 7.696% 2/38 144A	200,000.00	179,624.00	
NIGERIA REP 6.375% 7/23 144A	285,000.00	291,144.60	
NIGERIA REP 7.625% 11/25 144A	400,000.00	406,500.00	

NIGERIA REP OF 5.625% 6/27/22	165,000.00	166,237.50	
NIGERIA REPUBL 6.5% 11/27 144A	605,000.00	562,268.85	
OMAN SULTAN 6.5% 3/8/47 144A	200,000.00	169,936.00	
OMAN SULTANATE 6.75% 1/48 144A	175,000.00	149,131.50	
PAKISTAN GOV 6.875% 12/27 144A	200,000.00	193,874.00	
PANAMA GOVT 3.16% 01/23/30	200,000.00	218,562.00	
PARAGUAY REP 4.95% 04/31 144A	465,000.00	521,730.00	
PHILIPPINE GOVT 2.457% 5/5/30	200,000.00	212,500.00	
QATAR GOVT 3.4% 4/16/2025 144A	200,000.00	219,500.00	
QATAR GOVT 3.75% 04/16/30 144A	200,000.00	233,062.00	
QATAR GOVT 4.4% 04/16/50 144A	150,000.00	193,875.00	
QATAR ST 4.817% 03/14/49 144A	435,000.00	595,810.80	
QATAR ST 5.103% 4/23/48 144A	320,000.00	451,699.20	
REP OF GHANA 7.875 8/7/23 144A	200,000.00	210,874.00	
ROMANIA GOVT 5.125% 06/48 144A	210,000.00	249,965.10	
ROMANIA REPUBLIC 3% 02/31 144A	172,000.00	171,783.28	
RUSSIA FEDN MINISTRY FINANCE 5	1,000,000.00	1,251,870.00	
RUSSIAN FED 5.875 9/16/43 144A	270,000.00	387,026.10	
RUSSIAN FEDN 5.25% 06/47 144A	800,000.00	1,089,744.00	
RUSSIAN FEDN 5.625 4/4/42 144A	250,000.00	344,842.50	
RWANDA INTL GOV6.625 5/23 144A	445,000.00	444,301.35	
SERBIA REP 7.25% 9/28/21 144A	280,000.00	297,850.00	
SRI LANKA GOVT 6.2% 05/27 144A	200,000.00	128,750.00	
SRI LANKA GOVT 6.75% 4/28 144A	230,000.00	147,342.60	
TURKEY GOVT 4.875% 4/16/2043	700,000.00	532,000.00	

TURKEY GOVT 5.25% 03/13/30	200,000.00	177,686.00	
TURKEY GOVT 5.75% 05/11/2047	775,000.00	623,627.00	
TURKEY REPUBLIC OF 4.25% 03/25	200,000.00	185,874.00	
UKRAINE 8.994% 02/24 144A	200,000.00	215,562.00	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/21 144A	150,000.00	153,796.50	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/22 144A	390,000.00	404,745.90	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/23 144A	105,000.00	110,020.05	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/24 144A	200,000.00	208,062.00	
UKRAINE CABINET VAR 0% 5/31/40	245,000.00	219,502.85	
UKRAINE GV 7.375% 9/25/32 144A	200,000.00	199,000.00	
UNITED MEXICAN 4.35% 1/15/47	200,000.00	207,500.00	
URUGUAY REP 4.375% 01/23/31	200,000.00	238,436.00	
URUGUAY REPUBLICA ORIENTAL DL	520,000.00	700,211.20	
UST NOTES 1.5% 08/15/2022	900,000.00	924,957.00	
UST NOTES 2% 07/31/2024	5,738,000.00	6,174,604.42	
UST NOTES 2.125% 05/31/21	80,000.00	81,336.80	
UST NOTES 2.125% 06/30/22	129,000.00	133,917.48	
UST NOTES 2.5% 01/15/2022	7,492,000.00	7,749,500.04	
UST NOTES 2.875% 11/30/25	7,161,000.00	8,132,747.70	
USTB 2.50% 02/15/45	13,306,000.00	16,692,243.94	
USTB 3% 02/15/49	5,910,000.00	8,308,396.20	
USTB 3.5% 2/15/39	400,000.00	571,124.00	
USTB 4.75% 2/15/37	4,128,000.00	6,622,344.00	
USTB 6.125%	4,002,000.00	5,976,386.70	
USTN .125% 05/31/22	741,000.00	740,533.17	
USTN .125% 06/30/22	57,000.00	56,970.93	
USTN .125% 07/15/23	3,060,000.00	3,055,440.60	
USTN .25% 06/30/25	197,000.00	196,698.59	
USTN .5% 06/30/27	3,689,000.00	3,697,632.26	
USTN .625% 05/15/30	4,181,000.00	4,181,000.00	

	USTN 1.5% 01/31/27	326,000.00	348,399.46	
	USTN 1.5% 08/31/21	800,000.00	811,872.00	
	USTN 1.625% 05/31/23	2,565,000.00	2,671,396.20	
	USTN 1.625% 09/30/26	1,060,000.00	1,139,160.80	
	USTN 1.75% 06/30/22	2,274,000.00	2,343,993.72	
	USTN 1.75% 07/15/22	1,938,000.00	1,999,008.24	
	USTN 1.875% 07/31/22	2,560,000.00	2,648,985.60	
	USTN 2% 05/31/24	1,620,000.00	1,731,051.00	
	USTN 2.25% 03/31/26	494,000.00	546,754.26	
	USTN 2.25% 04/15/22	1,350,000.00	1,398,775.50	
	USTN 2.25% 07/31/21	6,800,000.00	6,946,064.00	
	USTN 2.25% 12/31/24	4,703,000.00	5,118,180.84	
	USTN 2.375% 04/30/26	1,107,000.00	1,234,260.72	
	USTN 2.5% 01/31/21	4,403,000.00	4,457,333.02	
	USTN 2.5% 02/28/26	90,000.00	100,771.20	
	USTN 2.5% 12/31/20	1,809,000.00	1,827,506.07	
	USTN 2.625% 12/31/23	299,000.00	323,912.68	
	USTN 2.625% 12/31/25	750,000.00	842,722.50	
	USTN 2.75% 06/30/25	6,712,000.00	7,523,682.16	
	UZBEKISTAN 4.75% 2/20/24 144AL	200,000.00	211,750.00	
	VENEZUELA 11.95% 8/31 REGS	1,470,000.00	91,875.00	
	VENEZUELA REP 9.25% 9/15/27	1,805,000.00	112,812.50	
	VENEZUELA REPUB 12.75% 8/23/22	345,000.00	21,562.50	
	VIETNAM PAR 3/5.5% 3/12/28	1,496,250.00	1,483,157.81	
	VIETNAM SOCIALIST FRN 3/13/28	70,000.00	64,190.70	
アメリカ・ドル	小計	155,443,334.68	165,996,631.03 (17,847,957,768)	
イギリス・ポンド	UK GILT .875% 10/22/29 REGS	3,440,000.00	3,685,031.20	
	UK GILT 1.5% 07/22/47 REGS	450,000.00	541,219.50	
	UK GILT 2.5% 07/22/65 REGS	1,385,000.00	2,409,193.65	
	UK GOVT 1.5% 1/22/21 RGS	2,540,000.00	2,559,202.40	
イギリス・ポンド	小計	7,815,000.00	9,194,646.75 (1,240,265,900)	

カナダ・ドル	CANADA GOVT .5% 09/01/25	2,540,000.00	2,560,142.20	
	CANADA GOVT 1.25% 6/1/30	2,210,000.00	2,363,882.30	
	CANADA GOVT 2% 12/01/51	2,640,000.00	3,346,622.40	
	CANADA GOVT 2.25% 02/01/21	7,150,000.00	7,227,720.50	
カナダ・ドル 小計		14,540,000.00	15,498,367.40 (1,226,385,812)	
ユーロ	BTP 2.45% 09/01/50 144A RGS	2,453,000.00	2,639,992.19	
	GERMANY GOVT 0% 04/05/24	9,450,000.00	9,697,779.00	
	GERMANY GOVT 0% 08/15/50	1,100,000.00	1,101,991.00	
	GERMANY GVT .25% 02/15/29 REGS	11,580,000.00	12,395,695.20	
	GERMANY GVT 1.25% 8/15/48 RGS	530,000.00	721,027.90	
	NETHERLANDS 0% 1/24 144A RGS	3,350,000.00	3,424,035.00	
	NETHERLANDS GOVT .25% 7/29 RGS	500,000.00	529,080.00	
ユーロ 小計		28,963,000.00	30,509,600.29 (3,746,273,820)	
国債証券 合計			25,292,373,813 (24,060,883,300)	
地方債証券	アメリカ・ドル	BUENOS AIRES 10.875% 1/21 144A	426,666.63	204,799.89
		PROVINCE CRDB 7.125% 6/21 144A	490,000.00	327,687.50
	アメリカ・ドル 小計		916,666.63	532,487.39 (57,253,044)
地方債証券 合計			57,253,044 (57,253,044)	
特殊債券	アメリカ・ドル	1MDB GLB INV 4.4% 3/09/23 REGS	1,000,000.00	940,310.00
		ABU DHABI NA 4% 10/03/49 144A	200,000.00	237,312.00
		CODELCO INC 4.25% 7/17/42 144A	95,000.00	106,666.95
		CORPO NAC 4.375% 02/05/49 144A	100,000.00	117,218.00
		EMPRESA NAC 4.5% 9/14/47 144A	95,000.00	99,927.65
		ESKOM HOLDS MTN 5.75% 1/21 RGS	600,000.00	585,000.00
		FHLB 0.5% 04/14/25	145,000.00	145,327.70

FHLG 15YR 2.5% 03/01/2033#G186	78,244.20	82,264.38	
FHLG 15YR 2.5% 03/01/2033#G186	28,352.75	29,809.51	
FHLG 15YR 2.5% 05/33#G18687	16,466.92	17,312.99	
FHLG 15YR 2.5% 08/32#G18654	15,069.72	15,848.67	
FHLG 15YR 2.5% 11/32#G18665	15,751.68	16,565.88	
FHLG 15YR 2.5% 12/01/2032#G186	77,977.41	82,008.06	
FHLG 20YR 3% 04/01/2033#K90336	37,137.68	39,486.26	
FHLG 20YR 3% 06/01/2033#K90632	90,520.30	96,244.80	
FHLG 20YR 3% 06/01/2033#K90684	48,532.51	51,601.70	
FHLG 20YR 3% 06/33#K90806	74,704.48	79,428.79	
FHLG 20YR 3% 07/01/2033#C91714	180,251.29	191,650.38	
FHLG 20YR 3.0% 06/01/2033#C917	39,868.91	42,390.21	
FHLM .375% 04/20/23	1,150,000.00	1,153,059.00	
FNMA 0.625% 04/22/25	110,000.00	110,925.10	
FNMA 20YR 3% 05/01/2033#AT3000	32,109.01	34,130.59	
FNMA 20YR 3% 06/33#AT6090	35,687.77	37,934.67	
FNMA 20YR 3% 07/01/2033#MA1490	174,874.21	185,884.29	
HUTAMA KARYA P 3.75% 5/30 144A	200,000.00	213,812.00	
MDC GMTN BV 2.875% 5/21/30 RGS	200,000.00	214,186.00	
PDVSA 12.75% 2/17/22 144A	400,000.00	10,000.00	
PDVSA PETR VENZ 5.375% 4/12/27	325,000.00	8,125.00	
PEMEX 0% 01/31/60 144A	460,000.00	364,941.00	
PEMEX PRO FDG 6.625% 6/15/35	915,000.00	760,877.40	
PETROL VENEZUELA 6% 11/26 144A	1,090,000.00	27,250.00	
PETROLEOS MEX 3.5% 1/30/23	345,000.00	329,820.00	



		PETROLEOS MEX 4.25% 01/25 WI	330,000.00	305,910.00	
		PETROLEOS MEX 4.875% 1/22	175,000.00	173,250.00	
		PETROLEOS MEXCNS 6.75% 9/21/47	495,000.00	390,060.00	
		PETROLEOS MEXI 4.625% 09/21/23	210,000.00	203,305.20	
		PETROLEOS MEXICANOS 6.49% 01/2	460,000.00	427,225.00	
		PETROLEOS MEXICANOS 7.69% 01/2	878,000.00	748,495.00	
		PETROLEOS MEXICANOS FRN 3ML+ 0	150,000.00	145,125.00	
		PETROLEOS MX 4.875% 1/24 WI	250,000.00	241,640.00	
		PETROLEOS VENZ 9.75 5/35 144A	670,000.00	16,750.00	
		PRIVATE EXPORT 1.75% 11/15/24	920,000.00	969,045.20	
		PT PERTA PR 4.15% 2/25/60 144A	140,000.00	139,518.40	
		PT PERTAMI 3.65% 07/30/29 144A	350,000.00	367,388.00	
		SOUTHERN GAS 6.875% 03/26 144A	325,000.00	375,677.25	
		STATE OIL CO OF 6.95% 3/30 RGS	200,000.00	236,312.00	
		TVA 5.25% 9/15/39	267,000.00	411,722.01	
		TVA 5.5% 6/15/38	4,000.00	6,188.20	
		YPF SOCIEDAD 8.5% 3/23/21 144A	205,000.00	185,844.80	
		YPF SOCIEDAD 8.75% 4/4/24 144A	395,000.00	352,537.50	
	アメリカ・ドル	小計	14,799,548.84	12,123,312.54 (1,303,498,564)	
特殊債券 合計				1,303,498,564 (1,303,498,564)	
社債券	アメリカ・ドル	1011778 ULC 3.875% 01/28 144A	160,000.00	160,000.00	
		ACRISURE LLC 7% 11/15/25 144A	425,000.00	414,914.75	
		ACRISURE LLC 8.125% 02/24 144A	170,000.00	180,625.00	
		ADARO INDO 4.25% 10/31/24 144A	250,000.00	233,280.00	
		ADVANCED DRAIN 5% 9/30/27 144A	40,000.00	40,815.20	

ALBERTS COM 3.5% 02/15/23 144A	215,000.00	218,225.00	
ALBERTSONS 4.625% 1/15/27 144A	250,000.00	256,875.00	
ALBERTSONS 4.875% 2/15/30 144A	245,000.00	255,385.55	
ALCOA INC GLB 5.95 2/1/37	115,000.00	119,887.50	
ALFA BANK 8%/VAR PERP RGS	400,000.00	401,872.00	
ALFA BD 5.95%/VAR 4/15/30 REGS	250,000.00	250,545.00	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 5.8	190,000.00	177,650.00	
ALLEN MEDIA 10.5% 02/28 144A	180,000.00	165,600.00	
ALLIANT HLDG 6.75% 10/27 144A	615,000.00	637,336.80	
ALLY 8% GLOBAL	470,000.00	604,612.70	
ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31	2,499,000.00	3,290,583.24	
ALLY FINL INC 5.75% 11/20/2025	1,394,000.00	1,512,503.94	
ALLY FINL INC 5.8% 05/01/2025	2,000.00	2,264.32	
ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18 Escrow	610,000.00	-	
ALROSA FINA 3.1% 06/25/27 144A	200,000.00	199,248.00	
ALTICE FINCO 7.625% 2/25 144A	815,000.00	846,230.80	
ALTICE FING 5% 01/15/28 144A	200,000.00	203,500.00	
ALTICE FING SA 7.5% 05/26 144A	1,040,000.00	1,103,700.00	
ALTICE FR HLDS 6% 2/15/28 144A	190,000.00	182,875.00	
ALTICE FRAN 10.5% 5/15/27 RGS	430,000.00	485,900.00	
ALTICE FRANCE 8.125% 2/27 144A	965,000.00	1,067,531.25	
ALTICE FRANCE SA 5.5% 01/15/20	385,000.00	400,061.20	
AMC NETWORKS INC 4.75% 12/15/2	40,000.00	40,337.20	
ANTERO LP/ FIN 5.375% 09/15/24	205,000.00	176,556.25	

ANTERO MIDS 5.75% 1/15/28 144A	185,000.00	149,850.00	
ARCHROCK PR 6.25% 4/1/28 144A	185,000.00	172,975.00	
ARCONIC ROLLED 6% 5/15/25 144A	110,000.00	115,775.00	
ARD FIN SA 6.5% 06/30/27 144A	185,000.00	187,312.50	
ASBURY AUTOM 4.5% 03/28 144A	54,000.00	53,730.00	
ASBURY AUTOM 4.75% 03/30 144A	52,000.00	51,870.00	
ASGN INC 4.625% 05/15/28 144A	445,000.00	442,383.40	
AVANTOR FUNDING 4.625% 07/15/28 144A	235,000.00	243,765.50	
AVOLON HLD 4.375% 5/01/26 144A	2,000.00	1,729.92	
AVOLON HLDGS 3.95% 7/24 144A	2,000.00	1,788.66	
AVOLON HLDGS 5.125% 10/23 144A	495,000.00	465,196.05	
AVOLON HLDS 5.25% 5/15/24 144A	400,000.00	370,080.00	
AZUL INVEST 5.875% 10/27 144A	305,000.00	149,450.00	
BAIDU INC 3.075% 04/07/2025	200,000.00	210,716.00	
BALL CORP 4.875% 3/15/26	625,000.00	699,993.75	
BANCO DE RESERVAS 7% 2/23 144A	350,000.00	342,013.00	
BANCO MERC 6.875/VAR PERP 144A	450,000.00	423,306.00	
BANFF MERGER 9.75% 9/26 144A	1,010,000.00	1,036,512.50	
BANK OF AMERICA 5.86%/VAR PERP	2,285,000.00	2,335,886.95	
BAUSCH HEALTH 5.25% 1/30 144A	155,000.00	152,287.50	
BAUSCH HEALTH COS 5% 1/28 144A	305,000.00	298,137.50	
BAUSCH HLTH 6.25% 2/15/29 144A	280,000.00	290,866.80	
BBA US HLDGS 4% 03/01/28 144A	155,000.00	141,050.00	
BBA US HLDGS 5.375% 5/26 144A	130,000.00	131,625.00	

BCPE CYCLE MERGER SUB II INC 1	320,000.00	336,000.00	
BERRY GBL ES 4.875% 7/26 144A	120,000.00	126,903.60	
BERRY GBL ES 5.625% 7/27 144A	100,000.00	106,000.00	
BGEO GROUP JSC 6% 7/26/23 144A	295,000.00	293,616.45	
BIZ FIN (UKRXB) 9.625% 4/22 144	211,666.66	216,494.77	
BK OF AMERCA CORP 4.3%/VAR PRP	420,000.00	379,050.00	
BOEING CO 5.15% 05/01/30	400,000.00	444,492.00	
BOMBARDIER 7.875% 04/27 144A	630,000.00	449,662.50	
BOMBARDIER INC 7.5% 12/24 144A	330,000.00	241,312.50	
BOYD GAMING CORP 4.75% 12/01/2	340,000.00	308,356.20	
BOYD GAMING CORP 6.375% 4/1/26	45,000.00	44,325.00	
BRAND ENERGY 8.5% 7/25 144A	680,000.00	622,200.00	
BRASKEM ID 7.45% 11/15/29 144A	425,000.00	379,852.25	
BRASKEM NETHER 4.5% 01/30 144A	200,000.00	180,204.00	
C&W SR FIN 6.875% 9/15/27 144A	1,455,000.00	1,491,375.00	
CABLE ONDA 4.5% 01/30/30 144A	200,000.00	203,562.00	
CALIF RES 8.0% 12/15/22 144A	1,975,000.00	54,312.50	
CAMELOT FIN SA 4.5% 11/26 144A	175,000.00	178,500.00	
CAMPOSOL SA 6% 02/03/2027 144A	200,000.00	196,600.00	
CARNIVAL CORP 0% 01/31/26 144A	205,000.00	209,100.00	
CATALENT PHARM 5% 6/30/27 144A	70,000.00	73,500.00	
CBOM FIN 5.55% 2/14/23 144A	200,000.00	204,062.00	
CBOM FIN PL 4.7% 01/29/25 144A	200,000.00	196,374.00	
CCO HLDGS 4.75% 03/01/30 144A	415,000.00	436,787.50	
CCO HLDGS LLC 5.875% 5/27 144A	85,000.00	89,037.50	

CCO HLDGS/CAP 4.5% 08/30 144A	390,000.00	404,640.60	
CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144	2,330,000.00	2,437,762.50	
CCO HLDGS/CAP C 4.5% 05/01/32 144A	145,000.00	150,769.55	
CDK GLOBAL INC 5.25% 5/29 144A	100,000.00	105,500.00	
CDK GLOBAL INC 5.875% 06/15/26	95,000.00	100,225.00	
CDW LLC / CDW F 4.25% 04/01/28	235,000.00	246,703.00	
CENTENE CORP 3.375% 2/15/30 WI	155,000.00	161,683.60	
CENTENE CORP 4.25%12/15/27	185,000.00	194,712.50	
CENTENE CORP 4.625% 12/15/29	290,000.00	317,187.50	
CENTENE CORP 5.25% 04/1/25 RGS	280,000.00	291,480.00	
CENTENE CORP 5.375% 08/15/26 R	155,000.00	164,687.50	
CENTENE ESCRO 5.375% 6/26 144A	690,000.00	731,400.00	
CENTURYLINK 5.125% 12/26 144A	500,000.00	513,750.00	
CENTURYLINK INC 4% 02/27 144A	310,000.00	309,513.30	
CF INDUS INC 5.375% 03/15/44	675,000.00	756,675.00	
CF INDUSTRI INC 5.15% 03/15/34	595,000.00	648,550.00	
CF INDUSTRIES INC 4.95% 6/43	835,000.00	919,335.00	
CHARLES RIV 4.25% 5/1/28 144A	55,000.00	56,100.00	
CHARLES RIVER 5.5% 4/26 144A	195,000.00	205,725.00	
CHEMOURS CO 5.375% 05/15/2027	165,000.00	155,100.00	
CHEMOURS CO 6.625% 5/15/23	215,000.00	214,462.50	
CHEMOURS CO 7% 05/15/2025	350,000.00	348,250.00	
CHENIERE ENERG 5.625% 10/01/26	275,000.00	287,375.00	
CHS/CMNTY HEALTH 8% 3/26 144A	1,150,000.00	1,124,355.00	
CHUKCHANSI EC 9.75 5/30/20 RGS	28,827.42	11,530.96	

CIT GROUP INC NEW 5.25% 3/7/25	250,000.00	263,072.50	
CITGO HLDG INC 9.25% 08/01/24 144A	395,000.00	393,025.00	
CITGO PETE COR 7% 6/15/25 144A	410,000.00	412,431.30	
CITGO PETR 6.25% 08/15/22 144A	315,000.00	314,874.00	
CITIGROUP 5.35% PERP	1,375,000.00	1,333,750.00	
CITIGROUP INC 4.7%/VAR PERP	235,000.00	213,556.25	
CITIGROUP INC 5%/VAR PERP	525,000.00	498,750.00	
CLEARWY ENR 4.75% 3/15/28 144A	110,000.00	114,950.00	
CLEARWY ERG LLC 5.75% 10/15/25	275,000.00	290,812.50	
COMCEL TRST 6.875% 2/6/24 144A	195,000.00	199,508.40	
COMPASS MINE 6.75% 12/27 144A	375,000.00	403,125.00	
COMSTOCK ESCROW 9.75% 08/15/2026	190,000.00	183,350.00	
COMSTOCK RESOUR 9.75% 08/15/26	115,000.00	110,975.00	
CONSOLID FRN 3ML+375 6/22 144A	395,000.00	359,493.45	
CONSOLIDATED 6.5% 5/26 144A	505,000.00	431,775.00	
CONTINENTAL RES 4.5% 4/23 WI	30,000.00	29,590.20	
CORPORACION NA 3.75% 1/31 144A	200,000.00	220,250.00	
CORPORACION NACIONAL DEL COBRE	310,000.00	328,113.30	
COSAN OVERSEAS 8.25% PERP	325,000.00	329,468.75	
COVEY PK 7.5% 5/15/25 144A	625,000.00	573,625.00	
CRC ESCROW 5.25% 10/15/25 144A	720,000.00	627,393.60	
CSC HLDGS 5.5% 04/15/27 144A	1,180,000.00	1,247,850.00	
CSC HLDGS LLC 4.125% 12/01/30 144A	170,000.00	172,550.00	
CSC HLDGS LLC 4.625% 12/01/30 144A	170,000.00	169,787.50	

CSC HLDGS LLC 5.375% 2/28 144A	630,000.00	670,950.00	
CSC HOLDINGS 5.75% 01/30 144A	305,000.00	325,965.70	
CSC HOLDINGS 6.5% 2/1/29 144A	490,000.00	547,065.40	
CSC HOLDINGS 7.5% 4/1/28 144A	690,000.00	771,075.00	
CSN ISLANDS XI 6.75% 1/28 144A	260,000.00	230,425.00	
CTR PARTNERSHIP 5.25% 6/1/25	515,000.00	522,833.15	
CVR ENERGY 5.25% 2/15/25 144A	370,000.00	336,700.00	
CVR ENERGY 5.75% 02/15/28 144A	370,000.00	321,900.00	
DANA INC 5.625% 6/15/28	160,000.00	163,200.00	
DAVITA HEALTHCARE PRTN 5% 5/25	1,125,000.00	1,156,837.50	
DAVITA INC 0% 05/31/30 144A	365,000.00	376,015.70	
DCP MIDSTR 5.85% 5/21/43 144A	185,000.00	129,500.00	
DCP MIDSTREAM 5.125% 05/15/29	320,000.00	312,800.00	
DCP MIDSTREAM 5.625% 07/15/27	145,000.00	147,298.25	
DCP MIDSTREAM OP 5.375% 07/25	400,000.00	405,508.00	
DEL MONTE 11.875% 5/15/25 144A	60,000.00	61,219.80	
DENBURY RESOUR 9.25% 3/22 144A	130,000.00	53,950.00	
DENBURY RESOURCE 7.75% 02/15/24 144A	1,265,000.00	518,903.00	
DENBURY RESOURCE CONV 6.375% 12/31/24	4,400,000.00	429,000.00	
DIAMOND SPORTS GROUP LLC / DIA	220,000.00	166,650.00	
DISH CORP 5% 03/15/23 WI	1,195,000.00	1,209,937.50	
DISH DBS CORP 5.875% 11/24	160,000.00	161,200.00	
DISH DBS CORP 5.875% 7/22	1,740,000.00	1,799,682.00	
DISH DBS CORP 7.75% 07/01/26	565,000.00	614,979.90	

DISH NETWK CV 2.375% 3/15/24	1,259,000.00	1,134,598.21	
DISH NETWK CV 3.375% 8/26 144A	1,086,000.00	989,910.72	
DP WORLD CRESC 3.875% 7/29 RGS	600,000.00	591,000.00	
DP WORLD LTD GMT NTS BE 144A 4	200,000.00	198,562.00	
DPL INC 4.125% 07/01/25 144A	550,000.00	566,500.00	
DPL INC 4.35% 04/15/29	729,000.00	745,380.63	
ECOPETROL SA 5.875% 5/45	180,000.00	197,190.00	
EG GLOBAL 8.5% 10/30/25 144A	115,000.00	120,750.00	
EG GLOBAL FINANCE PLC 6.75% 02	670,000.00	678,375.00	
ELDORADO 6.25% 7/1/25 144A	340,000.00	342,550.00	
ELDORADO RESRT 6% 04/01/25	325,000.00	338,812.50	
ELDORADO RESRT 8.125% 07/01/27	845,000.00	825,987.50	
EMPRESA DE 3.65% 05/07/30 144A	200,000.00	216,000.00	
ENDEAVOR 6.625% 7/15/25 144A	165,000.00	170,775.00	
ENDEAVOR ENERGY 5.75 1/28 144A	375,000.00	373,125.00	
ENSCO PLC 5.2% 3/15/25	140,000.00	9,142.00	
ENSEMBLE S MRG 9% 9/30/23 144A	375,000.00	379,653.75	
ENTEGRIS INC 4.625% 02/26 144A	315,000.00	324,450.00	
ENTERCOM MED 6.5% 5/01/27 144A	120,000.00	107,400.00	
ENVIVA PT LP 6.5% 1/15/26 144A	250,000.00	262,812.50	
EP ENERGY LLC 7.75% 5/26 144A	1,760,000.00	492,800.00	
EQT MIDSTR 6.5% 07/01/27 144A	215,000.00	228,437.50	
EQT MIDSTREAM 6% 07/01/25 144A	150,000.00	157,107.00	
EQUINIX INC 5.375% 5/15/27	285,000.00	311,881.20	
ESKOM HLDGS 7.125% 2/25 144A	460,000.00	437,142.60	



EW SCRIPPS 5.125% 05/25 144A	45,000.00	43,875.00	
EXPEDIA INC 7% 05/01/25 144A	225,000.00	241,299.00	
EXPEDIA INC DEL 6.25% 05/01/20	135,000.00	146,314.35	
FFCB .375% 04/08/22	1,500,000.00	1,503,840.00	
FIRST QUANTUM 6.5% 3/24 144A	305,000.00	293,657.05	
FIRST QUANTUM 6.875% 3/26 144A	305,000.00	299,006.75	
FIRST QUANTUM 7.25% 4/23 144A	890,000.00	877,201.80	
FIRST QUANTUM 7.5% 4/25 144A	385,000.00	378,620.55	
FLY LEASING 5.25% 10/15/24	160,000.00	130,000.00	
FORD MOTOR 9% 04/22/25	360,000.00	403,945.20	
FORD MOTOR 9.625% 4/22/30	130,000.00	159,575.00	
FORD MTR CR 5.125% 6/16/25	515,000.00	523,214.25	
FORD MTR CR CO 3.087% 1/9/23	370,000.00	361,675.00	
FORD MTR CR CO 3.336% 3/18/21	185,000.00	184,544.90	
FORD MTR CR CO LLC 5.596% 1/22	490,000.00	500,309.60	
FORD MTR CR LLC 5.75% 2/01/21	105,000.00	105,525.00	
FORD MTR CR LLC 5.875% 8/2/21	450,000.00	458,307.00	
FREEPORT MCMOR 4.625% 08/01/30	175,000.00	179,702.25	
FREEPORT MCMORAN INC5.4% 11/34	80,000.00	84,900.00	
FRONT RANGE BID 4% 3/1/27 144A	300,000.00	297,750.00	
FRONT RANGE BIDCO INC 6.125% 0	165,000.00	164,795.40	
FRONTIER COMM 8% 04/01/27 144A	970,000.00	993,037.50	
FRONTIER COMM 8.5% 4/26 144A	685,000.00	654,175.00	
FRONTIER COMMS 11% 9/15/25	760,000.00	260,300.00	
GEMS MENAS 7.125% 7/31/26 144A	435,000.00	417,325.95	

GEO GROUP 5.125% 4/1/23 WI	125,000.00	108,750.00	
GEO GROUP INC 5.875% 10/15/24	50,000.00	39,125.00	
GEO GROUP INC 6% 04/15/26	445,000.00	341,497.45	
GEOPARK LTD 5.5% 01/17/27 144A	200,000.00	174,500.00	
GEOPARK LTD 6.5% 09/24 144A	200,000.00	183,750.00	
GEORGIA BK 11.125/VAR PERP RGS	250,000.00	240,077.50	
GEORGIAN OL&GS 6.75% 4/21 144A	175,000.00	170,241.75	
GEORGIAN RAIL 7.75 7/11/22 144	200,000.00	202,936.00	
GLP CAP LP / GLP 5.25% 6/25	265,000.00	284,954.50	
GLP CAP LP/ FIN II 5.375% 4/26	210,000.00	229,586.70	
GO DADDY OP 5.25% 12/1/27 144A	170,000.00	176,800.00	
GOLDEN NUGGET 8.75% 10/25 144A	235,000.00	120,731.25	
HAT HLDG I/II 5.25% 07/24 144A	440,000.00	450,450.00	
HCA INC 5.375% 9/01/26	260,000.00	287,357.20	
HCA INC 5.625% 09/01/28	450,000.00	516,375.00	
HCA INC 5.875% 02/01/2029	130,000.00	152,100.00	
HCA INC 5.875% 02/15/26	595,000.00	666,400.00	
HCA INC 5.875% 5/01/23	65,000.00	70,687.50	
HD SUPPLY IN 5.375% 10/26 144A	255,000.00	263,960.70	
HERTZ 5.5% 10/15/24 144A	165,000.00	64,556.25	
HERTZ CORP 6% 01/15/2028 144A	145,000.00	56,612.35	
HERTZ CORP 6.25% 10/15/22	120,000.00	47,100.00	
HERTZ CORP 7.125% 08/01/2026 1	265,000.00	103,350.00	
HESS MIDST 5.125% 6/15/28 144A	220,000.00	220,825.00	
HESS MIDSTREAM 5.625% 02/15/26	365,000.00	365,912.50	

HILCORP ENRGY 5.75% 10/25 144A	855,000.00	764,156.25	
HILTON DOMESTIC 5.125% 5/01/26	440,000.00	450,740.40	
HMAN FIN 6.375% 07/15/22 144A	460,000.00	430,100.00	
HOLOGIC 4.375% 10/15/25 144A	280,000.00	285,600.00	
HTA GROUP LTD/M 7% 12/18/25 14	200,000.00	203,812.00	
HUB INTEL LTD 7% 5/01/26 144A	260,000.00	270,740.60	
IAA SPINCO 5.5% 6/15/27 144A	85,000.00	90,355.00	
ICAHN LP/FN COR 4.75% 09/15/24	1,085,000.00	1,057,875.00	
ICAHN LP/FN COR 5.25% 05/15/27	245,000.00	241,631.25	
ICAHN LP/FN COR 6.25% 05/15/26	780,000.00	787,800.00	
ICAHN LP/FN COR 6.375% 12/15/2	770,000.00	785,169.00	
IHS MARKIT LTD 4% 3/1/26 144A	125,000.00	138,512.50	
IHS NETHERLAND 8% 9/18/27 144A	200,000.00	203,750.00	
IHS NTHLND 7.125% 3/18/25 144A	200,000.00	201,624.00	
IMS HEALTH 5% 10/15/26 144A	325,000.00	338,812.50	
INCEPTION/RCK 8.625 11/24 144A	350,000.00	370,051.50	
INDIKA ENRGY 5.875% 11/24 144A	200,000.00	177,186.00	
INDONESIA ASA 5.23% 11/21 144A	200,000.00	208,500.00	
INDONESIA ASA 5.45% 05/30 144A	200,000.00	225,750.00	
INFRABUILD AUST 12% 10/24 144A	175,000.00	159,250.00	
INTELSAT J H SA 5.5% 08/01/23	945,000.00	541,012.50	
INTELSAT JACKS 8.5% 10/24 144A	120,000.00	73,333.20	
INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	5,535,000.00	5,375,868.75	
INTNL GAME TCH 6.25% 1/27 144A	155,000.00	163,137.50	
ITAU UNIBA 6.125/VAR PERP 144A	520,000.00	487,760.00	

J2 CLOUD/GLOBL 6% 7/15/25 144A	220,000.00	228,203.80	
JBS INV II GMBH 7% 1/26 144A	220,000.00	237,714.40	
JBS INVEST 5.75% 1/15/28 144A	200,000.00	205,800.00	
JBS USA / FIN 5.75% 6/25 144A	505,000.00	517,625.00	
JBS USA LLC 6.5% 4/15/29 144A	295,000.00	320,836.10	
JBS USA/FIN 5.875% 07/24 144A	85,000.00	86,402.50	
JBS USA/FIN 6.75% 02/28 144A	595,000.00	648,550.00	
JBS USA/LUX/FI 5.5% 01/30 144A	355,000.00	379,850.00	
JONAH ENERGY 7.25% 10/25 144A	641,000.00	83,330.00	
JOSEPH T RYER 8.5% 8/1/28 144A	165,000.00	170,568.75	
JPMORGAN CHASE 4.6%/VAR PRP	360,000.00	329,760.00	
JPMORGAN CHASE 5.15% PERP	1,810,000.00	1,787,375.00	
JPMORGAN CHASE 5/VAR PERP	545,000.00	531,429.50	
KAZAKHSTAN TEMR 6.95 7/42 144A	100,000.00	135,906.00	
KAZMUNAIGAZ 6.375% 10/48 144A	75,000.00	96,189.75	
KAZMUNAIGAZ FI 5.75% 4/47 144A	85,000.00	102,158.95	
KEHE DISTRS LLC / KEHE FIN COR	170,000.00	181,900.00	
KFC CO/PIZZA 4.75% 6/1/27 144A	255,000.00	265,837.50	
KLX ENERGY 11.5% 11/1/25 144A	245,000.00	118,825.00	
KOSMOS ENERGY 7.125% 4/26 144A	335,000.00	287,262.50	
KRAFT HEINZ 4.25% 3/1/31 144A	300,000.00	319,509.00	
L BRANDS 9.375% 07/01/25 144A	120,000.00	124,200.00	
LAMAR MED 4.875% 01/15/29 144A	140,000.00	145,075.00	
LANDRYS 6.75% 10/15/24 144A	710,000.00	454,400.00	
LAUREATE EDU 8.25% 5/1/25 144A	825,000.00	870,375.00	

LBC TANK TRM 6.875 5/15/23 144	555,000.00	555,000.00	
LCPR SR 6.75% 10/15/27 144A	200,000.00	207,500.00	
LENNAR CORP 5.375% 10/01/2022	10,000.00	10,500.00	
LEVEL 3 FINANCI 4.25% 07/01/28	230,000.00	232,875.00	
LEVEL 3 FINANCING INC 3.875% 1	375,000.00	396,562.50	
LIVE NATIN 4.75% 10/15/27 144A	230,000.00	205,850.00	
MAGNOLIA OIL & GAS OPER LLC /	255,000.00	242,250.00	
MATCH GROUP INC 4.125% 08/01/2	180,000.00	179,166.60	
MATCH GROUP INC 5% 12/27 144A	225,000.00	237,262.50	
MATCH GRP 5.625% 02/15/29 144A	195,000.00	209,381.25	
MEDCO BELL PTE 6.375% 01/30/27	390,000.00	334,058.40	
MEG ENERGY 7% 3/31/24 144A	618,000.00	551,565.00	
MEG ENERGY 7.125% 2/01/27 144A	370,000.00	311,725.00	
MEGLBL CANADA 5% 5/18/25 144A	200,000.00	218,250.00	
MELCO RESOR FIN 5.75% 07/21/28 144A	115,000.00	115,586.50	
MGM GROWTH/MGP 4.625% 06/15/25 144A	345,000.00	351,037.50	
MGM GROWTH/MGP 5.75% 02/01/27	205,000.00	219,350.00	
MGM RESORTS INT 5.5% 04/15/27	170,000.00	168,500.60	
MGM RESORTS INTERNATIONAL 6.75	400,000.00	406,080.00	
MILEAGE PLUS 6.5% 6/20/27 144A	180,000.00	182,700.00	
MOLINA HEA 4.375% 6/15/28 144A	120,000.00	123,000.00	
MOOG INC 4.25% 12/15/2027 144A	55,000.00	54,312.50	
MPLX LP 6.375% 05/01/24	340,000.00	351,655.20	
MPT OPER PARTNER 5% 10/15/27	996,000.00	1,051,377.60	

MPT OPER PARTNERSHIP LP/CORP 4	535,000.00	555,062.50	
MPT OPER PARTNERSHP 5.25% 8/26	300,000.00	315,000.00	
MSCI INC 4% 11/15/29 144A	440,000.00	463,812.80	
MUMTALAKAT 4.1% 01/21/27 RGS	200,000.00	193,186.00	
MUMTALAKAT SUKUK HOLDING COMPA	200,000.00	206,562.00	
MURPHY OIL 5.875% 12/01/27	250,000.00	226,250.00	
MURPHY OIL USA INC 4.75% 09/15	120,000.00	125,708.40	
NAGACORP 7.95% 07/06/24 RGS	200,000.00	194,874.00	
NAK NAFTAO 7.625% 11/08/26 144A	200,000.00	191,000.00	
NAK NAFTAOG UK 7.375% 7/22 REGS	375,000.00	368,906.25	
NAVIENT CORP 5.875% 10/24	1,125,000.00	1,084,241.25	
NAVIOS 8.125% 11/15/21 144A	935,000.00	542,300.00	
NAVIOS LOG/FI 10.75% 7/25 144A	485,000.00	512,281.25	
NAVIOS MARIT 11.25% 8/22 144A	475,000.00	328,937.50	
NAVIOS MARITIM 7.375 1/22 144A	1,565,000.00	672,950.00	
NCL COR 10.25% 02/01/26 144A	365,000.00	365,000.00	
NCL CORP 12.25% 05/15/24 144A	385,000.00	415,800.00	
NCR CORP NEW 8.125% 04/15/25 144A	75,000.00	81,562.50	
NETFLIX 4.875% 04/15/28	315,000.00	351,851.85	
NETFLIX 5.875% 11/15/28	410,000.00	486,875.00	
NEW COTA I 10.625%PIK 5/19 144A	1,445,751.00	643,359.18	
NEXA RESOURCES 6.5% 01/18/28 1	200,000.00	205,350.00	
NEXSTAR 5.625% 7/15/27 144A	220,000.00	227,561.40	
NEXTERA ENERGY 4.25% 9/24 144A	205,000.00	215,250.00	

NEXTERA ENERGY 4.5% 9/27 144A	145,000.00	155,875.00	
NOBLE HLDG INTL 6.2% 8/01/40	295,000.00	7,375.00	
NOBLE HLDG INTL 7.75% 1/15/24	195,000.00	4,875.00	
NOBLE HLDG INTL VAR 04/01/25	155,000.00	3,875.00	
NORTHWEST FIN 10.75% 06/01/28 144A	95,000.00	100,937.50	
NOSTRUM OIL 8% 7/25/22 144A	805,000.00	221,375.00	
NRG ENERGY 5.25% 06/15/29 144A	185,000.00	202,343.75	
NRG ENERGY INC 5.75% 01/15/28	510,000.00	556,726.20	
NRG ENERGY INC 6.625% 01/15/27	1,175,000.00	1,252,843.75	
NUMERICABLE 7.375% 05/26 144A	695,000.00	738,437.50	
OCCIDENTAL PETE 4.5% 07/15/44	65,000.00	48,926.15	
OCCIDENTAL PETE 5.55% 03/15/26	212,000.00	207,115.52	
OCCIDENTAL PETE 6.2% 03/15/40	75,000.00	67,500.00	
OCCIDENTAL PETE 6.45% 09/15/36	130,000.00	122,200.00	
OCCIDENTAL PETE 6.6% 03/15/46	170,000.00	156,400.00	
OCCIDENTAL PETE 6.95% 07/01/24	195,000.00	200,421.00	
OCCIDENTAL PETE 7.5% 05/01/31	725,000.00	726,812.50	
OCCIDENTAL PETR 2.7% 08/15/22	190,000.00	181,450.00	
OCCIDENTAL PETRO 2.9% 08/15/24	115,000.00	104,650.00	
OCCIDENTAL PETRO 4.3% 08/15/39	70,000.00	52,500.00	
OCCIDENTAL PETROL 3% 02/15/27	125,000.00	106,250.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM 4.4% 4/46	137,000.00	102,967.83	
OCCIDENTL PETE 8.875% 07/15/30	450,000.00	480,375.00	
OCI NV 5.25% 11/01/24 144A	310,000.00	303,025.00	

OCI NV 6.625% 4/15/023 144A	420,000.00	424,200.00	
ODEBRECHT FIN 7.125 6/42 144A	850,000.00	50,592.00	
ODEBRECHT FIN 7.5% PERP 144A	750,000.00	44,062.50	
OIL & GAS 7.625% 11/07/24 144A	200,000.00	216,312.00	
OIL & GAS HLDG 7.5% 10/27 144A	610,000.00	654,987.50	
OLEODUCTO CENT 4% 7/14/27 144A	200,000.00	203,000.00	
OPEN TEXT 4.125% 2/15/30 144A	245,000.00	249,900.00	
ORTHO-CLI 7.25% 02/01/28 144A	75,000.00	77,977.50	
ORTHO-CLI D 7.375% 6/1/25 144A	145,000.00	150,800.00	
PAC DRLL 2LN PIK VAR 4/24 144A	24,395.00	243.95	
PACIFIC GAS & ELEC 3.95% 12/47	165,000.00	176,550.00	
PACIFIC GAS & ELE 3.75% 8/15/42	30,000.00	31,003.80	
PAO TMK 4.3% 02/12/27 RGS	200,000.00	193,250.00	
PARK AERO 4.5% 03/15/23 144A	60,000.00	55,995.60	
PARK AEROSPACE 5.5% 2/24 144	286,000.00	265,162.04	
PARSLEY 5.625% 10/15/27 144A	145,000.00	147,950.75	
PATTRN ENER 4.5% 08/15/28 144A	135,000.00	139,725.00	
PBF HLD LL 9.25% 05/15/25 144A	270,000.00	292,728.60	
PBF HLD LLC 6% 2/15/28 144A	425,000.00	338,844.00	
PBF HLDG / FIN 7.25% 06/15/25	250,000.00	225,055.00	
PBF LOGISTICS 6.875% 05/23	515,000.00	496,501.20	
PETROBRAS GLO 5.093% 01/30 RGS	741,000.00	744,186.30	
PETROBRAS GLOBAL FIN 6.25 3/24	110,000.00	118,242.30	
PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.	320,000.00	337,600.00	
PETRONAS CAP 4.8% 4/21/60 144A	200,000.00	281,874.00	



PETRONAS CAP LTD 3.5% 04/21/20	200,000.00	224,466.00	
PG&E 4.55% 07/01/30	1,277,500.00	1,453,922.75	
PG&E 4.95% 07/01/50	1,277,500.00	1,545,775.00	
PG&E CORP 5% 07/01/28	225,000.00	225,562.50	
PG&E CORP 5.25% 07/01/30	135,000.00	136,518.75	
PILGRIMS PRIDE 5.75% 3/25 144A	100,000.00	102,250.00	
PLASTIPAK HLD 6.25% 10/25 144A	85,000.00	83,937.50	
POLYONE CO 5.75% 5/15/25 144A	140,000.00	147,700.00	
POST HLDGS 5% 08/15/26 144A	815,000.00	840,696.95	
POST HLDGS 5.625% 01/28 144A	405,000.00	428,571.00	
POST HLDGS IN 4.625% 4/30 144A	120,000.00	122,850.00	
PRIDE INTL INC 7.875% 8/15/40	685,000.00	44,525.00	
PT PERTAMINA 3.1% 01/21/30 RGS	200,000.00	203,520.00	
PTT TREASUR 3.7% 07/16/70 144A	200,000.00	203,000.00	
QNB FINANCE 2.75% 02/27 RGS	200,000.00	207,562.00	
QORVO INC 4.375% 10/15/29 144A	130,000.00	136,500.00	
RADIATE HOLD 6.875% 2/23 144A	100,000.00	102,000.00	
RADIATE HOLDCO 6.625% 2/25 144	140,000.00	142,100.00	
RADIOLOGY PAR 0% 01/31/28 144A	430,000.00	417,100.00	
RATTLER MIDST 5.625% 07/31/25 144A	160,000.00	163,400.00	
REALOGY G 7.625% 06/15/25 144A	80,000.00	81,349.60	
ROYAL CARI 11.5% 06/01/25 144A	330,000.00	358,020.30	
ROYAL CARI 9.125% 6/15/23 144A	260,000.00	263,250.00	
RURAL/METRO C 10.125 7/19 REGS	10,000.00	-	
RUSSIAN AGR BK 8.5% 10/23 144A	200,000.00	223,062.00	

SABLE INTL 5.75% 9/7/27 144A	445,000.00	460,575.00	
SABRA HLTH/CAP 3.9% 10/15/29	205,000.00	190,268.70	
SABRE GLBL 9.25% 04/15/25 144A	135,000.00	144,787.50	
SANCHEZ ENERGY CONV 15% 07/31/	70,400.00	70,400.00	
SAUDI ARABIA 3.5% 4/16/29 144A	200,000.00	220,000.00	
SAUDI ARABIAN OIL 4.25% 04/39	1,515,000.00	1,756,627.35	
SBA COMM 4.875% 9/1/24	135,000.00	138,627.45	
SBA COMMUNICA 3.875% 2/27 144A	650,000.00	654,062.50	
SCIENTIFIC 8.625% 7/1/25 144A	115,000.00	110,975.00	
SCRIPPS ESCRO 5.875% 7/27 144A	180,000.00	176,745.60	
SERVICE CO INTL 5.125% 6/1/29	105,000.00	113,832.60	
SERVICE PPTYS T 7.5% 09/15/25	290,000.00	307,434.80	
SESI LLC 7.75% 09/15/24	190,000.00	69,350.00	
SIBUR SECS D 2.95% 7/8/25 144A	200,000.00	199,748.00	
SINOPEC GRP 2.7% 5/13/30 144A	200,000.00	209,248.00	
SIRIUS XM 4.625% 7/15/24 144A	290,000.00	300,150.00	
SIRIUS XM R 4.125% 7/1/30 144A	230,000.00	234,404.50	
SLM CORP 5.5% 12/31/23	330,000.00	322,575.00	
SM ENERGY CO 5.0% 01/15/2024	50,000.00	28,000.00	
SM ENERGY CO 5.625% 06/01/25	675,000.00	361,125.00	
SM ENERGY CO 6.625% 1/15/27	190,000.00	95,000.00	
SM ENERGY CO 6.75% 09/15/26	210,000.00	106,050.00	
SOLERA LLC/FIN 10.5% 3/24 144A	1,275,000.00	1,333,968.75	
SOTHEBYS 7.375% 10/15/27 144A	245,000.00	239,487.50	
SPRINGLEAF CORP 8.875% 06/1/25	235,000.00	259,087.50	

SPRINGLEAF FIN 6.875% 3/15/25	240,000.00	254,788.80	
SPRINGLEAF FIN CRP 7.125% 3/26	535,000.00	581,807.15	
SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32	1,435,000.00	2,113,037.50	
SPRINT CAP CRP 6.875% 11/15/28	440,000.00	547,580.00	
SPRINT CORP 7.125% 06/15/24	355,000.00	407,806.25	
SPRINT CORP 7.625% 03/01/2026	230,000.00	278,300.00	
SPRINT CORP 7.875% 9/15/23	965,000.00	1,104,925.00	
STATION CAS 4.5% 02/15/28 144A	5,000.00	4,262.50	
STATION CASINOS 5.0% 10/25	335,000.00	303,175.00	
STUDIO CITY 6.5% 1/15/28 144A	355,000.00	355,443.75	
STUDIO CITY FIN 6% 07/25 144A	175,000.00	175,638.75	
SUNOCO LP /CORP 0% 02/15/26	265,000.00	268,975.00	
SUNOCO LP /CORP 6% 04/15/27	520,000.00	535,600.00	
SUNOCO LP/ SUNO 4.875% 1/15/23	310,000.00	314,650.00	
SURGERY CTR 10% 04/15/27 144A	260,000.00	257,400.00	
T-MOBILE 3.875% 4/15/30 144A	555,000.00	628,687.35	
T-MOBILE USA 4.5% 4/15/50 144A	2,000.00	2,458.14	
TARGA RES 6.5% 7/15/27	125,000.00	131,250.00	
TARGA RES 6.875% 1/15/29	220,000.00	239,800.00	
TARGA RES LP 5.375% 02/01/27	260,000.00	258,700.00	
TARGA RES LP/FI 4.25% 11/15/23	250,000.00	248,125.00	
TARGA RES P 5.875% 4/26	210,000.00	216,300.00	
TARGA RES P L 5.5% 3/1/30 144A	190,000.00	194,275.00	
TAYLOR MOR 5.875% 6/15/27 144A	165,000.00	174,075.00	
TAYLOR MORRISON CMNTY/ MONARCH	240,000.00	253,200.00	

TEGNA INC 0% 9/30/29 144A	445,000.00	438,325.00	
TEINE ENERGY 6.875% 09/22 144A	530,000.00	523,375.00	
TELEFONICA PY 5.875% 4/27 144A	250,000.00	260,427.50	
TELESAT CDA 6.5% 10/15/27 144A	135,000.00	133,193.70	
TEMPO ACQ 6.75% 06/25 144A	155,000.00	157,669.10	
TENCENT HLD 2.39% 6/3/30 144A	200,000.00	203,034.00	
TENET HEALTH 4.625% 06/15/28 144A	225,000.00	228,937.50	
TENET HEALTH 6.875% 11/15/31	25,000.00	22,500.00	
TENET HEALTHCA 6.25% 2/27 144A	585,000.00	603,532.80	
TENET HEALTHCAR 8.125% 4/22 WI	2,490,000.00	2,635,665.00	
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	856,800.00	
TENET HEALTHCRE 4.625% 7/15/24	410,000.00	415,740.00	
TENGIZCHEVR 3.25% 8/15/30 144A	200,000.00	198,540.00	
TERMOCANDELARIA POWER LTD 7.87	230,000.00	241,355.10	
TERRAFORM 4.75% 01/15/30 144A	405,000.00	425,250.00	
TERRAFORM POWE 4.25% 1/23 144A	145,000.00	148,987.50	
TERRAFORM POWER 5% 1/28 144A	175,000.00	186,812.50	
TERRIER M 8.875% 12/15/27 144A	245,000.00	249,900.00	
TINKOFF CRDT 9.25/VAR PERP RGS	200,000.00	201,562.00	
TOPS MARKETS CORP ESCROW	1,325,000.00	-	
TOPS MKTS LLC PIK VAR 11/19/24	270,730.00	262,608.10	
TRANSDIGM INC 5.5% 11/15/27	1,270,000.00	1,171,575.00	
TRANSDIGM INC 6.25% 3/26 144A	80,000.00	82,600.00	
TRANSDIGM INC 7.5% 03/15/27	855,000.00	855,000.00	

TRANSDIGM INC 8% 12/15/25 144A	355,000.00	382,512.50	
TRANSDIGM UK 6.875% 05/15/26	270,000.00	264,600.00	
TRANSOCEAN 5.375% 5/15/23 144A	245,000.00	209,475.00	
TRANSOCEAN 7.25% 11/25 144A	495,000.00	254,925.00	
TRI POINTE GROUP 5.7% 06/15/28	55,000.00	57,887.50	
TRIPADVISOR I 7% 07/15/25 144A	120,000.00	124,080.00	
TRIVIUM PACKING 5.5% 8/26 144A	125,000.00	130,275.00	
TTM TECH 5.625% 10/1/25 144A	105,000.00	105,787.50	
TULLOW OIL 7% 03/01/25 144A	395,000.00	245,761.10	
TURKIYE SINAI 6% 1/23/25 144A	200,000.00	190,312.00	
TV AZTECA SAB 8.25% 8/9/24 RGS	400,000.00	171,124.00	
TWIN RIVER WORLDWID 6.75% 6/27	130,000.00	123,500.00	
UBER TECH 7.5% 05/15/25 144A	350,000.00	358,750.00	
ULTRA RESCS PIK 11% 07/12/24	167,419.00	8,370.95	
UNIVISION 6.625% 06/01/27 144A	340,000.00	333,200.00	
US AWYS 12-2 A 4.625% 12/03/26	22,326.79	18,517.39	
USA COMPRESSION 6.875% 04/01/26	100,000.00	99,750.00	
USIMINAS INTL 5.875% 7/26 144A	200,000.00	186,580.00	
USIS MERGER 6.875% 05/25 144A	405,000.00	413,606.25	
VAIL RESORT 6.25% 05/15/2025 144A	100,000.00	105,625.00	
VALARIS PLC 7.75% 02/01/2026	305,000.00	19,825.00	
VALEANT PHARM 5.5% 11/25 144A	145,000.00	150,144.60	
VALEANT PHARM 5.5% 3/23 144A	229,000.00	228,713.75	
VALEANT PHARM 8.50% 1/27 144A	185,000.00	203,500.00	
VALEANT PHARMA 9.25% 4/26 144A	700,000.00	776,930.00	

VALVOLINE INC 4.25% 2/30 144A	125,000.00	127,651.25	
VERTICAL US 5.25% 7/15/27 144A	175,000.00	178,500.00	
VIACOM INC 5.875/VAR 02/28/57	114,000.00	117,648.00	
VIACOM INC 6.25/VAR 02/28/57	350,000.00	375,770.50	
VICI PROPE 4.125% 8/15/30 144A	190,000.00	183,768.00	
VICI PROPER 3.5% 02/15/25 144A	230,000.00	226,545.40	
VICI PROPERT 3.75% 02/27 144A	145,000.00	139,925.00	
VIKING CRUIS 13% 05/15/25 144A	150,000.00	162,000.00	
VIPER ENER 5.375% 11/1/27 144A	85,000.00	84,592.00	
VISTRA OP CO 5.625% 02/27 144A	190,000.00	202,350.00	
VIZIENT 6.25% 05/15/27 144A	50,000.00	53,000.00	
VOC CRUISE LTD 5% 2/15/28 144A	240,000.00	191,400.00	
VRX ESCROW 5.875% 5/23 144A	28,000.00	28,003.08	
VTR COMMUN 5.125% 1/15/28 144A	200,000.00	207,500.00	
W&T OFFSHORE 9.75% 11/23 144A	185,000.00	111,697.45	
WALTER ENERGY 9.5% 10/19 144A	735,000.00	-	
WINNEBAGO IND 6.25% 7/28 144A	145,000.00	149,531.25	
WOLVERINE 8.5% 11/24 144A	125,000.00	88,750.00	
WP ROCKET MRGR 10.125 7/19 REG	15,000.00	-	
WR GRACE & CO 4.875% 6/27 144A	215,000.00	222,998.00	
WYNN RESORTS LTD 7.75% 04/15/2	365,000.00	374,125.00	
XPO LOGISTICS INC 6.25% 05/01/	365,000.00	390,093.75	
YUM BRANDS 7.75% 4/1/25 144A	65,000.00	71,662.50	
ZIGGO BOND CO 5.125% 02/28/30 144A	90,000.00	92,025.00	

	ZIGGO BV 4.875% 01/15/2030 144	135,000.00	138,375.00	
	ZIGGO SEC 5.5% 1/15/27 144A	882,000.00	927,423.00	
	アメリカ・ドル 小計	201,001,515.87	184,447,353.75 (19,831,779,475)	
社債券 合計			19,831,779,475 (19,831,779,475)	
合計			46,484,904,896 (45,253,414,383)	

## 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	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 8銘柄	0.73%	-%	86.36%
	国債証券 152銘柄	-%	45.38%	
	地方債証券 2銘柄	-%	0.15%	
	特殊債券 50銘柄	-%	3.31%	
	社債券 524銘柄	-%	50.43%	
イギリス・ポンド	国債証券 4銘柄	-%	100%	2.72%
カナダ・ドル	国債証券 4銘柄	-%	100%	2.69%
ユーロ	国債証券 7銘柄	-%	100%	8.23%

## 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	ACPRODUCTS TERM 1LN 08/13/25 C1	69,562.50	102.00 70,953.75	98.62 68,606.01	2,347.74	-
	AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C1	23,279.82	99.49 23,163.42	98.79 22,998.59	164.83	-
	AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C2	11,720.18	99.50 11,661.58	98.79 11,578.60	82.98	-
	ALLIANT TERM B-2 1LN 05/10/25 C1	188,100.00	98.56 185,406.40	96.45 181,437.49	3,968.91	-
	BOYD GAMING TERM B-1 09/15/23 C1	49,795.22	80.99 40,334.12	95.18 47,399.07	7,064.95	-
	CAL RES TERM 1 1/2LN 12/31/21 C1	845,000.00	89.38 755,337.50	1.87 15,843.75	739,493.75	-

CHESAPEAKE TERM FLLO 06/09/24 C1	705,000.00	99.03 698,212.50	49.50 348,975.00	349,237.50	-
CINERWORLD TERM B 1LN 2/28/25 C1	734,938.32	99.12 728,478.21	69.92 513,935.01	214,543.20	-
CITGO HOLDING TM B 1LN 8/1/23 C1	24,812.50	98.49 24,439.81	94.49 23,447.81	992.00	-
CITGO TERM LOAN B 1LN 03/28/24 C1	445,609.37	100.00 445,609.37	96.49 430,013.04	15,596.33	-
CORECIVIC TERM B 1LN 12/12/24 C1	160,875.00	94.99 152,829.64	98.00 157,657.50	4,827.86	-
FRST EAGLE TERM B 1LN 2/1/27 C1	84,575.00	99.87 84,469.28	96.39 81,524.37	2,944.91	-
INFO RES TERM B 1LN 11/30/25 C1	255,790.91	97.61 249,697.97	94.99 243,001.36	6,696.61	-
INFO RES TERM B 1LN 11/30/25 C2	46,055.02	97.61 44,957.98	94.99 43,752.26	1,205.72	-
LIBERTY LTN AM TM B 1LN 10/26 C1	35,000.00	99.00 34,650.00	99.70 34,897.80	247.80	-
PIKE TERM B 1LN 07/24/26 C1	37,607.85	99.74 37,512.70	98.32 36,976.41	536.29	-
PROJECT EPIC TRM B 1LN 3/1/26 C1	810,000.00	98.37 796,837.50	76.79 622,015.20	174,822.30	-
RED ROCK RE TERM B 1LN 2/7/27 C1	600,000.00	70.00 420,000.00	91.91 551,502.00	131,502.00	-
REFINITIV TERM B 10/01/2025 C1	1,936,466.07	98.61 1,909,607.28	98.62 1,909,839.66	232.38	-
SANCHEZ DIP ROLL UP TL 5/11/20 C1	89,000.00	78.00 69,420.00	35.00 31,150.00	38,270.00	-
SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C1	108,722.08	94.99 103,285.97	34.99 38,052.72	65,233.25	-
SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C2	98,160.45	100.00 98,160.45	34.99 34,356.15	63,804.30	-
SOTHEBYS TERM 1LN 01/23/2027 C1	251,283.40	97.99 246,255.21	94.16 236,626.03	9,629.18	-
SOTHEBYS TERM 1LN 01/23/2027 C2	64,430.00	98.00 63,141.40	94.16 60,671.79	2,469.61	-
SOUTHEASTERN GROC TERM B 5/24 C1	501,513.16	95.54 479,150.68	99.24 497,751.81	18,601.13	-
SOUTHEASTERN GROC TERM B 5/24 C2	486,513.15	95.53 464,809.79	99.24 482,864.30	18,054.51	-
SOUTHEASTERN GROC TERM B 5/24 C3	481,973.69	95.54 460,487.30	99.24 478,358.88	17,871.58	-
TRANSDIGM TERM E 1LN 5/30/25 C1	425,362.51	96.86 412,031.64	92.36 392,869.06	19,162.58	-
TRANSDIGM TERM G 1LN 08/22/24 C1	281,421.26	98.65 277,627.70	92.80 261,170.18	16,457.52	-



TRAVELPORT TERM 1LN 05/29/26 C1	207,890.20	96.15 199,890.58	62.49 129,931.37	69,959.21	-
ULTIMATE SOFTWARE TERM 1LN 5/26 C1	69,475.00	100.57 69,873.09	98.40 68,365.48	1,507.61	-
ULTIMATE SOFTWARE TL 1LN 05/26 C1	240,000.00	98.50 236,400.00	99.78 239,474.40	3,074.40	-
ULTIMATE SOFTWARE TL 2LN 05/27 C1	35,000.00	99.00 34,650.00	101.50 35,525.00	875.00	-
US RENAL CARE TM B 1LN 6/13/26 C1	977,612.50	97.63 954,511.51	97.35 951,744.87	2,766.64	-
VEEAM SOFTWARE TERM B 1LN 2/27 C1	34,912.50	100.00 34,912.50	97.62 34,083.32	829.18	-
VERTAFORE TRM B 2LN 7/2/26 C1	180,000.00	94.25 169,650.00	98.14 176,657.40	7,007.40	-
WEB COM GRP TM B 1LN 10/11/25 C1	40,890.40	98.83 40,414.02	94.92 38,813.98	1,600.04	-
ZIPLY FIBER TM B 1LN 05/01/27 C1	360,000.00	96.25 346,500.00	99.00 356,400.00	9,900.00	-
貸付債権 / アメリカ・ドル 小計		11,475,330.85 (1,233,827,572)	9,890,267.67 (1,063,401,580)	1,585,063.18 (170,425,992)	
貸付債権 合計		1,233,827,572 (1,233,827,572)	1,063,401,580 (1,063,401,580)	170,425,992 (170,425,992)	
合計		1,233,827,572 (1,233,827,572)	1,063,401,580 (1,063,401,580)	170,425,992 (170,425,992)	

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）

（2020年8月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	38,449,135,587	円
負債総額	55,650,221	円
純資産総額（ - ）	38,393,485,366	円
発行済数量	64,679,275,504	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.5936	円

## Bコース（為替ヘッジなし）

（2020年8月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	4,979,801,278	円
負債総額	51,733,442	円
純資産総額（ - ）	4,928,067,836	円
発行済数量	8,409,001,831	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.5860	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

（2020年8月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	49,618,717,096	円
負債総額	658,084,668	円
純資産総額（ - ）	48,960,632,428	円
発行済数量	16,041,793,041	口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.0521	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（2020年2月末日現在）

（略）

< 訂正後 >

(1) 資本金等（2020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）

2020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155本、親投資信託48本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,152,344,718,361円です。

< 訂正後 >

（略）

2020年8月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、追加型株式投資信託151本、親投資信託47本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,163,898,951,927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34期事業年度（2019年4月1日から2020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33期 (2019年3月31日)	第34期 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	1,427,907	1,814,655
立替金	100,317	77,706
前払費用	13,866	23,391
未収委託者報酬	5,388,448	5,452,894
未収収益	741,116	633,653
未収入金	* 1 150,419	558,652
未収還付法人税等	50,510	42,699
未収還付消費税等	120,394	-
流動資産計	7,992,981	8,603,652
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 23,346,748	2,420,123
長期差入保証金	25,145	14,570
繰延税金資産	1,089,396	227,879
その他	430	230
投資その他の資産合計	24,461,720	2,662,803
固定資産計	24,469,207	2,670,290
資産合計	32,462,188	11,273,943
負債の部		
流動負債		
預り金	30,687	37
未払金	* 1	
未払手数料	2,369,952	2,403,887
その他未払金	1,653,290	1,209,713
未払費用	592,634	518,188
未払消費税等	-	344,568
賞与引当金	1,469,810	750,040
その他流動負債	931	355
流動負債合計	6,117,307	5,226,791
固定負債		
長期賞与引当金	298,547	316,834
退職給付引当金	4,712,577	1,906,773
関係会社引当金	-	370,080
固定負債合計	5,011,125	2,593,688
負債合計	11,128,432	7,820,479
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	250,000
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	20,233,755	2,203,463
利益剰余金合計	20,333,755	2,453,463
株主資本合計	21,333,755	3,453,463
純資産合計	21,333,755	3,453,463
負債・純資産合計	32,462,188	11,273,943

## （２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第33期 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	第34期 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	38,212,229	36,061,978
その他営業収益	3,152,985	2,825,039
営業収益計	41,365,214	38,887,017
営業費用	* 1	
支払手数料	17,804,844	16,651,629
広告宣伝費	504,887	700,958
調査費		
調査費	606,194	393,179
委託調査費	7,658,693	6,973,949
営業雑経費		
通信費	35,533	31,784
印刷費	63,293	61,362
協会費	30,701	24,701
諸会費	2,487	282
営業費用計	26,706,635	24,837,847
一般管理費		
給料		
給料・手当	2,408,072	2,507,196
賞与	1,717,394	2,193,019
福利厚生費	580,285	612,591
交際費	22,538	24,462
旅費交通費	156,818	154,257
租税公課	96,478	110,239
弁護士報酬	9,625	9,913
不動産賃貸料・共益費	598,215	610,202
支払ロイヤリティ	305,883	-
退職給付費用	210,619	212,987
消耗器具備品費	8,177	8,261
事務委託費	6,249,198	4,925,533
諸経費	325,845	330,336
一般管理費計	12,689,151	11,698,999
営業利益	1,969,426	2,350,170
営業外収益		
受取利息	* 1	
受取利息	139,478	104,125
保険配当金	8,570	7,305
雑益	6,818	3,555
営業外収益計	154,868	114,986
営業外費用		
寄付金	41	-
為替差損	90,627	11,668
営業外費用計	90,668	11,668
経常利益	2,033,626	2,453,488
特別利益		
賞与引当金戻入益	* 2	
賞与引当金戻入益	-	797,838
特別利益計	-	797,838
特別損失		
特別退職金	49,075	29,218
事務過誤損失	-	16
特別損失計	49,075	29,235
税引前当期純利益	1,984,550	3,222,091
法人税、住民税及び事業税	385,388	240,866
法人税等調整額	296,615	861,516
法人税等合計	682,003	1,102,382
当期純利益	1,302,546	2,119,707

## (3)【株主資本等変動計算書】

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				株主資本合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		
			その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	100,000	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

第34期(自2019年4月1日至2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本				株主資本合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		
			その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	100,000	20,233,755	20,333,755	21,333,755
当期変動額					
準備金の積立	-	150,000	(150,000)	-	-
剰余金の配当	-	-	(20,000,000)	(20,000,000)	(20,000,000)
当期純利益	-	-	2,119,707	2,119,707	2,119,707
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	150,000	(18,030,293)	(17,880,293)	(17,880,293)
当期末残高	1,000,000	250,000	2,203,463	2,453,463	3,453,463

	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	-	-	21,333,755
当期変動額			
準備金の積立	-	-	-
剰余金の配当	-	-	(20,000,000)
当期純利益	-	-	2,119,707
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-
当期変動額合計	-	-	(17,880,293)
当期末残高	-	-	3,453,463



## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

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)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。

#### (2)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)関係会社引当金

親会社により負担された当社のインセンティブ・シェア・プランによる業績連動型特別賞与について、将来親会社に対し支払いを行う可能性を勘案し、親会社との契約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。

### 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)グループ通算制度への移行に係る税効果会計

「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」

(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項により、繰延税金資産及び繰延税金負債の額については、改正前の税法の規定に基づいております。

#### (未適用の会計基準等)

##### 1. 「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31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 2020年3月31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。

##### 2. 「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 令和元年7月4日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 令和元年7月4日)

「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 令和元年7月4日)

##### (1)概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

##### (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。

## 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33期 (2019年3月31日)	第34期 (2020年3月31日)
未収入金	108,246 千円	481,355 千円
その他未払金	1,254,001 千円	909,606 千円
長期貸付金	21,850,000 千円	1,880,000 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33期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第34期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業費用	11,203,862 千円	9,335,190 千円
受取利息	61,374 千円	43,406 千円

\*2 特別利益に計上されている賞与引当金戻入益

当社グループは当会計期間において賞与引当金の見積期間（7月1日から6月30日を1月1日から12月31日に）の改定を行いました。これに伴い、2019年6月30日時点で計上されていた賞与引当金のうち797,838千円を取り崩し、当会計期間において賞与引当金戻入益として認識しております。

## (株主資本等変動計算書関係)

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

第34期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. 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

## 2. 配当に関する事項

## 金銭による配当

該当事項はありません。

## 金銭以外による配当

2019年11月29日の取締役会において、次のとおり決議しております。

- |               |               |
|---------------|---------------|
| (1) 配当財産の種類   | 長期貸付金         |
| (2) 配当財産の帳簿価格 | 20,000,000 千円 |
| (3) 1株当たりの配当額 | 1,000 千円      |
| (4) 効力発生日     | 2019年11月29日   |

## (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おりません。

## (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	-

## 第34期（2020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	1,814,655	1,814,655	-
(2) 未収委託者報酬	5,452,894	5,452,894	-
(3) 未収収益	633,653	633,653	-
(4) 未収入金	558,652	558,652	-
(5) 長期貸付金	2,420,123	2,420,123	-
資産計	10,879,977	10,879,977	-
(1) 未払手数料	2,403,887	2,403,887	-
(2) その他未払金	1,209,713	1,209,713	-
(3) 未払費用	518,188	518,188	-
(4) 未払消費税等	344,568	344,568	-
負債計	4,476,356	4,476,356	-

## (注) 1. 金融商品の時価の算定方法に関する事項

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。

第34期 (2020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、(4) 未払消費税等

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。

第34期 (2020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	1,814,655	-	-	-
未収委託者報酬	5,452,894	-	-	-
未収収益	633,653	-	-	-
未収入金	558,652	-	-	-
合計	8,459,855	-	-	-

金銭債権のうち長期貸付金(2,420,123千円)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。

第34期 (2020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 2019年4月1日 至 2020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
退職給付債務の期末残高	4,704,708

## (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
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	4,712,577
退職給付引当金	4,712,577
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	4,712,577

## (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
確定給付型年金制度に係る退職給付費用	147,957

## (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。

第34期（自 2019年4月1日 至 2020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	4,704,708
勤務費用	168,372
利息費用	7,558
数理計算上の差異の発生額	31,353
退職給付の支払額	2,920,688
制度改定による変動額	-
為替変動による影響額	11,362
その他	16,455
退職給付債務の期末残高	1,900,779

## (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	1,900,779
未認識過去勤務費用	5,994
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,906,773
退職給付引当金	1,906,773
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,906,773

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	168,372
利息費用	7,558
数理計算上の差異の費用処理額	31,353
過去勤務債務の費用処理額	1,874
確定給付型年金制度に係る退職給付費用	142,702

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎  
割引率 0.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は87,966千円であります。

(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33期 (2019年3月31日)	第34期 (2020年3月31日)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払費用	101,830	140,844
賞与引当金	441,058	217,927
退職給付引当金	1,451,987	583,853
資産除去債務	2,685	2,685
その他	116,978	242,912
繰延税金資産小計	2,114,538	1,188,221
評価性引当額	803,096	812,395
繰延税金資産合計	1,311,444	375,826
繰延税金負債		
未払金	186,975	147,947
長期貸付金	35,073	0
繰延税金負債合計	222,048	147,947
繰延税金資産又は繰延税金負債( )の純額	1,089,396	227,879

## 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33期 (2019年3月31日)	第34期 (2020年3月31日)
法定実効税率 (調整)	30.62%	30.62%
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.81%	3.34%
評価性引当額	1.90%	0.28%
過年度法人税等	0.04%	0.49%
その他	0.08%	0.04%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.38%	34.21%

(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33期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）及び 第34期（自 2019年4月1日 至 2020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

第34期（自 2019年4月1日 至 2020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	8,974,384	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）	8,352,497	投資信託の運用
フィデリティ・日本成長株・ファンド	5,276,573	投資信託の運用

## 関連当事者情報

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、ペンブローック市	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。

第34期（自 2019年4月1日 至 2020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、ペンブローック市	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）	千円 -	未収入金	千円 477,134
							共通発生経費負担額（注4）	6,299,993	未払金	495,523
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	貸付金の回収（注1）	千円 19,970,000	長期貸付金	千円 1,880,000
							利息の受取（注1）	43,406	未収入金	4,221
							共通発生経費負担額（注4）	406,439	未払金	81,434
							連結法人税の個別帰属額	-	未払金	66,142
							剰余金の配当	20,000,000	未払金	-
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 2,628,757	未払金	千円 266,506

## (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	10,007,500	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)	637,950	未払金	4,469
							投資信託販売に係る代行手数料(注5)	801,519	未払金	174,463
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	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)	784,703	未払金	108,258

## 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33期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第34期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,066,687円79銭	172,673円19銭
1株当たり当期純利益	65,127円34銭	105,985円40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33期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第34期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益(千円)	1,302,546	2,119,707
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)	1,302,546	2,119,707
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 (2020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	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円 (2020年7月27日現在)	
販売会社	auカブコム証券株式会社	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	10,007百万円	
	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	
	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		
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		
株式会社福岡銀行	82,329百万円		
日本生命保険相互会社	1,400,000百万円* *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	980,000百万円* *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32百万円*) * 1英ポンド143.48円で換算 (2019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・エルエルシー	7,950米ドル (約0.87百万円*) * 1米ドル109.56円で換算 (2020年1月1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

2020年9月15日

フィデリティ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているフィデリティ・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2020年1月21日から2020年7月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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2020年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

2020年9月15日

フィデリティ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているフィデリティ・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2020年1月21日から2020年7月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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2020年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

2020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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2019年4月1日から2020年3月31日までの第34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。

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2020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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

## 財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
- ・ 財務諸表に対する意見を表明するために、財務諸表に含まれる構成単位の財務情報に関する十分かつ適切な監査証拠を入手する。監査人は、構成単位の財務情報に関する監査の指示、監督及び実施に関して責任がある。監査人は、単独で監査意見に対して責任を負う。

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

#### 利害関係

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。