

**【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>	2022年10月18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、2022年4月15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）

マザーファンドの先進国債券（除く米国）に関する運用にあたっては、FILインベストメンツ・インターナショナルに、運用の指図に関する権限を委託します。

（略）

（注）2022年9月1日付けで、マザーファンドの先進国債券（除く米国）に関する運用の指図に関する権限の委託先に、「FIL（ルクセンブルグ）・エスエイ」が追加となる予定です。なお、当該変更は、担当ポートフォリオ・マネージャーのルクセンブルグ拠点への異動によるもので、当該マザーファンドおよびファンドに係る運用方針や運用スタイル等に変更ありません。

<訂正後>

（略）

ファンドの特色

（略）

マザーファンドの先進国債券（除く米国）に関する運用にあたっては、FILインベストメンツ・インターナショナルおよびFIL（ルクセンブルグ）・エスエイ<sup>（注）</sup>に、運用の指図に関する権限を委託します。

（略）

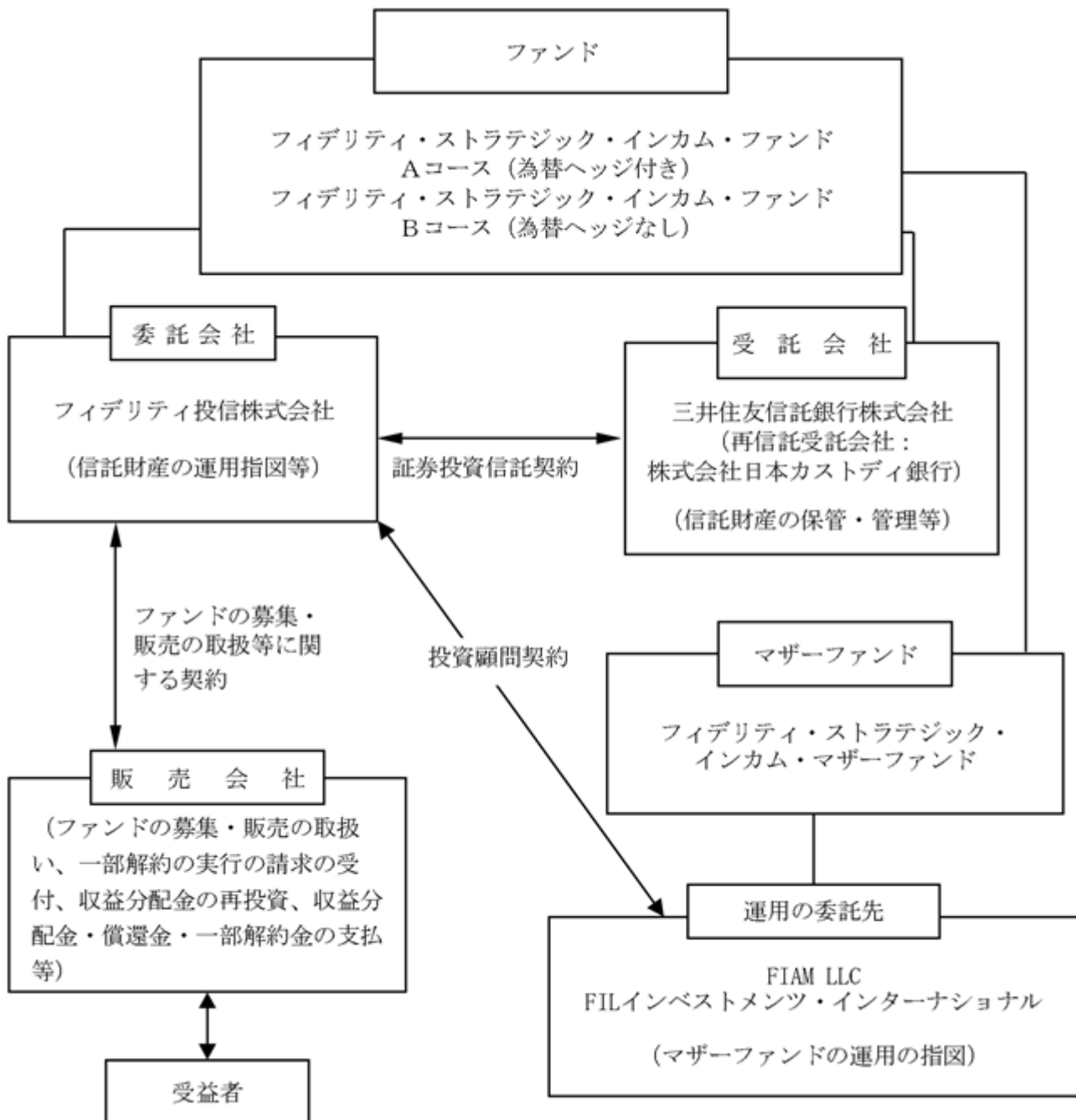
（注）2022年9月1日付けで、マザーファンドの先進国債券（除く米国）に関する運用の指図に関する権限の委託先に、「FIL（ルクセンブルグ）・エスエイ」が追加となりました。なお、当該変更は、担当ポートフォリオ・マネージャーのルクセンブルグ拠点への異動によるもので、当該マザーファンドおよびファンドに係る運用方針や運用スタイル等に変更ありません。

##### （3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

ファンドの仕組み

（略）



(注) 2022年9月1日付けで、マザーファンドの先進国債券（除く米国）に関する運用の指図に関する権限の委託先に、「FIL（ルクセンブルグ）・エスエイ」が追加となる予定です。なお、当該変更は、担当ポートフォリオ・マネージャーのルクセンブルグ拠点への異動によるもので、当該マザーファンドおよびファンドに係る運用方針や運用スタイル等に変更ありません。

委託会社およびファンドの関係法人

(略)

(d) 運用の委託先

名称	業務の内容
FILインベストメンツ・インターナショナル (所在地：英国)	委託会社より運用の指図に関する権限の委託を受け、マザーファンドの先進国債券（除く米国）に関する運用の指図を行ないます。
(略)	

（略）

（参考）

- ・ FILインベストメンツ・インターナショナルおよびフィデリティ投信株式会社は、独立系資産運用グループのフィデリティ・インターナショナルの一員です。

（略）

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

（注）2022年9月1日付けで、マザーファンドの先進国債券（除く米国）に関する運用の指図に関する権限の委託先に、「FIL（ルクセンブルグ）・エスエイ」が追加となる予定です。なお、当該変更は、担当ポートフォリオ・マネージャーのルクセンブルグ拠点への異動によるもので、当該マザーファンドおよびファンドに係る運用方針や運用スタイル等に変更ありません。

（略）

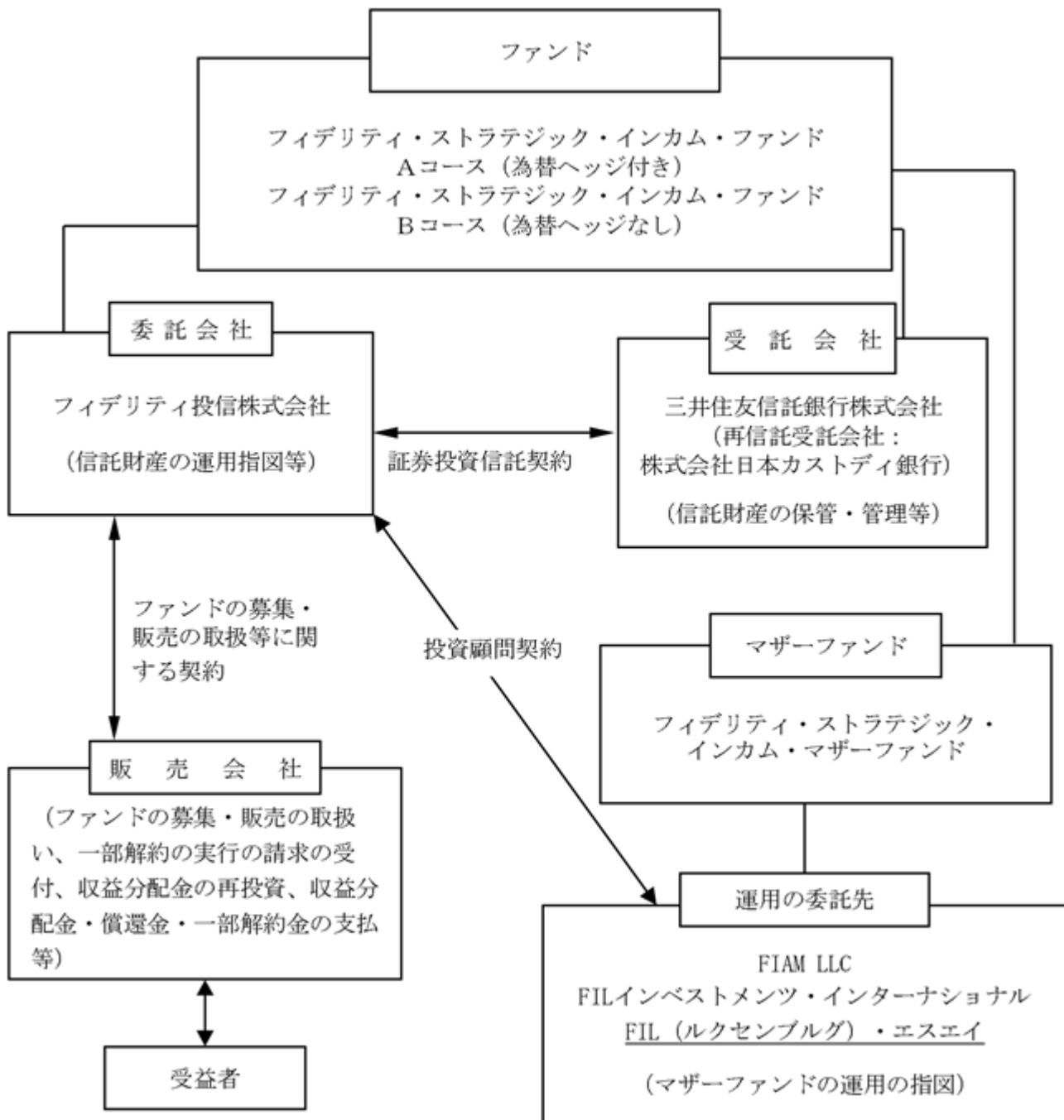
委託会社の概況（2022年2月末日現在）

（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)

(d) 運用の委託先

名称	業務の内容
FILインベストメンツ・インターナショナル (所在地: 英国)	委託会社より運用の指図に関する権限の委託を受け、マザーファンドの先進国債券(除く米国)に関する運用の指図を行ないます。
FIL(ルクセンブルグ)・エスエイ	
(略)	

(略)

（参考）

- ・ FILインベストメンツ・インターナショナル、FIL（ルクセンブルグ）・エスエイおよびフィデリティ投信株式会社は、独立系資産運用グループのフィデリティ・インターナショナルの一員です。

（略）

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

（略）

委託会社の概況（2022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
米国国債 / 政府機関債	ブルームバーグ米国政府債インデックス	30%
先進国債券 (除く米国)	FTSE G7インデックス(除く米国、ヘッジなし) <sup>*3</sup>	15%
米国高利回り社債 (ハイ・イールド・ボンド)	ICE BofA USハイ・イールド・コンストレインド・インデックス	40%
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

(a) ファンドの運用について

(略)

&lt;ファンドの投資対象債券セクター&gt;

(略)



## 好利回りの追求

債券セクター	概要	ベンチマーク	基本配分
(略)			
エマージング債券	南米・東欧・東南アジアなどを中心とするエマージング諸国の政府や政府系機関、企業等が発行する債券。エマージング諸国とは、成長の初期段階にある新興経済国で、先進国と比べ比較的早い経済成長が見られ、政治、経済、金融改革が進展している地域を指します。	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%

(略)

上記の文中で示された考え方は、2022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
米国国債 / 政府機関債	ブルームバーグ米国政府債インデックス <sup>*3</sup>	30%
先進国債券 (除く米国)	FTSE G7インデックス(除く米国、ヘッジなし) <sup>*4</sup>	15%
米国高利回り社債 (ハイ・イールド・ボンド)	ICE BofA USハイ・イールド・コンストレインド・インデックス <sup>*5</sup>	40%
エマージング債券	J.P.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>*6(注)</sup>	15%

\*3 「Bloomberg<sup>®</sup>」およびブルームバーグ米国政府債インデックスは、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited (以下「BISL」)をはじめとする関連会社(以下、総称して「ブルームバーグ」)のサービスマークであり、フィデリティ投信株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはフィデリティ投信株式会社とは提携しておらず、また、当ファンドを承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、当ファンドに関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。

\*4 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。

\*5 ICE<sup>®</sup>はICE Data Indices, LLCまたはその関連会社の登録商標です。BofA<sup>®</sup>はバンク・オブ・アメリカ・コーポレーションおよびその関連会社(BofA)によってライセンス

供与されたバンク・オブ・アメリカ・コーポレーションの登録商標であり、BofAの事前の承認なしに使用することはできません。ICE BofAはICE BofA indexを現状有姿の状態ライセンス供与しており、同インデックスに関し保証したり、同インデックスおよびそこに反映され、関連している、あるいはそこから派生しているいかなるデータに関して、その適切性、品質、正確性、適時性、完全性を保証するものではありません。またICE BofAは、それらの利用に際し責任を負うものではなく、フィデリティ投信株式会社あるいは同社の商品やサービスにつき、スポンサー提供、支持、もしくは推奨するものではありません。

This Japanese translation of the disclaimer is for informational purposes only, and the English language disclaimer, which is available upon request, controls with respect to ICE Data Indices, LLC and the ICE BofA Indices.

\* 6 この情報は信頼性があると信じるに足る情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。このインデックスは使用許諾を得て使用しています。

J.P.モルガンによる書面による事前の承諾なくこのインデックスを複写、使用、頒布することは禁じられています。

Copyright © 2022 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複写・転載を禁じます。

(注) 2022年11月1日付で上記ベンチマークから、J.P.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・ディバースファイドへ変更となる予定です。

#### 運用方針

(a) ファンドの運用について

(略)

<ファンドの投資対象債券セクター>

(略)

#### 好利回りの追求

債券セクター	概要	ベンチマーク	基本配分
(略)			
エマージング債券	南米・東欧・東南アジアなどを中心とするエマージング諸国の政府や政府系機関、企業等が発行する債券。エマージング諸国とは、成長の初期段階にある新興経済国で、先進国と比べ比較的早い経済成長が見られ、政治、経済、金融改革が進展している地域を指します。	J.P.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%

(略)

上記の文中で示された考え方は、2022年8月末日現在のものであり、今後、変更となる場合があります。

## (3)【運用体制】

## &lt;訂正前&gt;

ファンドの主要投資対象であるマザーファンドの運用にあたっては、FILインベストメンツ・インターナショナルおよびFIAM LLCに運用の指図に関する権限を委託します。

(略)

ファンドの関係法人である受託会社の管理として、受託会社より原則として年1回、内部統制に関する報告書を入手しているほか、必要に応じて適宜ミーティング等を行なっています。

(注) 2022年9月1日付けで、マザーファンドの先進国債券(除く米国)に関する運用の指図に関する権限の委託先に、「FIL(ルクセンブルグ)・エスエイ」が追加となる予定です。なお、当該変更は、担当ポートフォリオ・マネージャーのルクセンブルグ拠点への異動によるもので、当該マザーファンドおよびファンドに係る運用方針や運用スタイル等に変更ありません。

(略)

## &lt;訂正後&gt;

ファンドの主要投資対象であるマザーファンドの運用にあたっては、FILインベストメンツ・インターナショナル、FIL(ルクセンブルグ)・エスエイおよびFIAM LLCに運用の指図に関する権限を委託します。

(略)

ファンドの関係法人である受託会社の管理として、受託会社より原則として年1回、内部統制に関する報告書を入手しているほか、必要に応じて適宜ミーティング等を行なっています。

(略)

### 3【投資リスク】

<訂正前>

（略）

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

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移  
Aコース(為替ヘッジ付き)



Bコース(為替ヘッジなし)



ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較  
Aコース(為替ヘッジ付き)



Bコース(為替ヘッジなし)



- ※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2017年3月～2022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。

- ※2017年3月～2022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

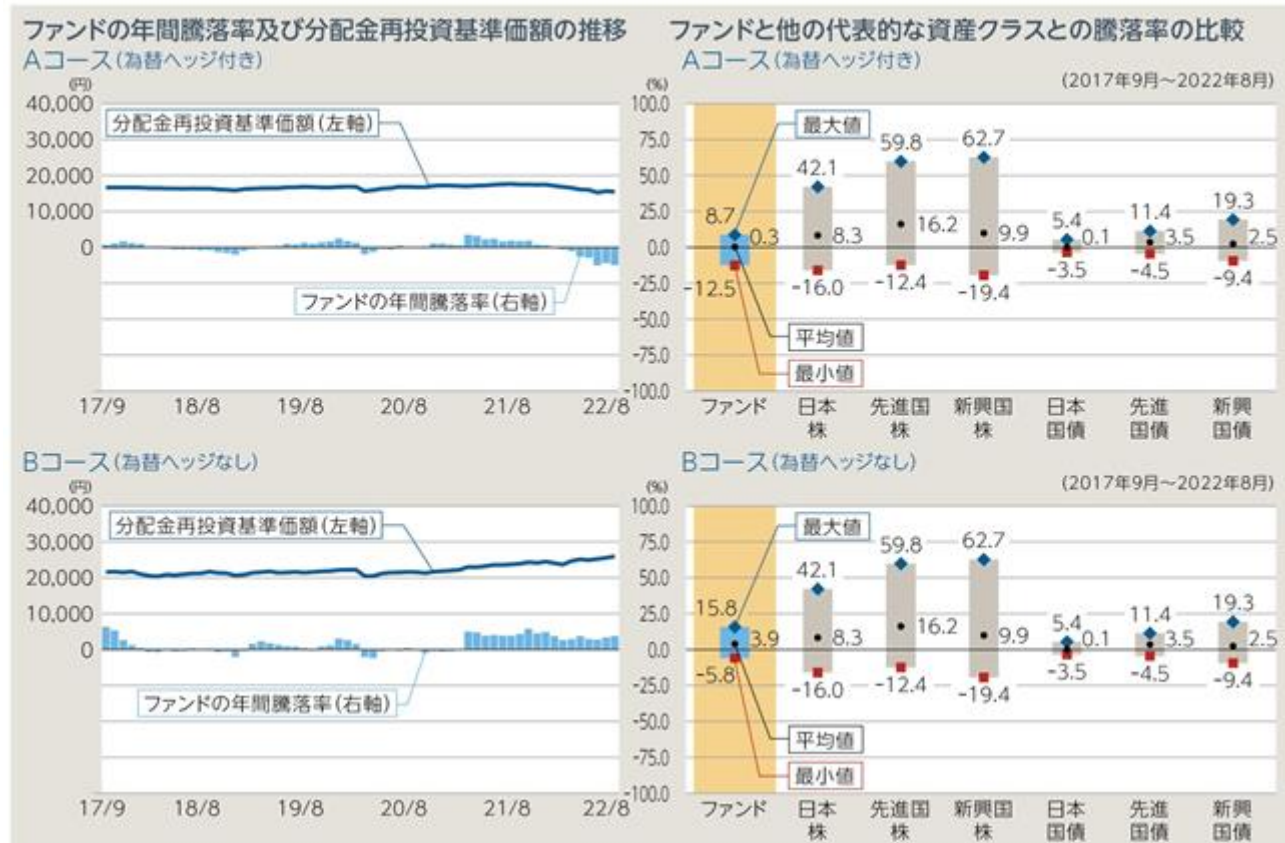
日本株 TOPIX(配当込)	東証株価指数(TOPIX)(以下「TOPIX」という。)の指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
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。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。

< 訂正後 >

（略）

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2017年9月～2022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。

※2017年9月～2022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) (以下「TOPIX」という。)の指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
<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、およびその他の知的所有権は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、およびその他の知的所有権は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> J.P.モルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円ベース)	この情報は信頼性があると信じるに足る情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。このインデックスは使用許諾を得て使用しています。J.P.モルガンによる書面による事前の承諾なくこのインデックスを複製、使用、頒布することは禁じられています。Copyright © 2022 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複製・転載を禁じます。

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### （５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、2022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、2022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）

（2022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	26,271,311,902	100.99
預金・その他の資産（負債控除後）	-	257,310,334	0.99
合計（純資産総額）		26,014,001,568	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

（2022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	25,833,595,162	99.31

（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）

（2022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	4,157,534,774	100.04
預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,809,985	0.04
合計（純資産総額）		4,155,724,789	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

(2022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	775,162,502	2.08
	ルクセンブルグ	36,518,726	0.10
	バミューダ	16,105,956	0.04
	ケイマン諸島	2,668,794	0.01
	小計	830,455,978	2.22
新株予約権証券	アメリカ	152,203,795	0.41
	ケイマン諸島	8,182,338	0.02
	小計	160,386,133	0.43
国債証券	アメリカ	9,339,259,747	25.02
	ドイツ	2,291,298,284	6.14
	イスラエル	1,344,089,849	3.60
	日本	839,064,040	2.25
	カナダ	836,505,874	2.24
	イギリス	822,872,732	2.20
	イタリア	220,525,910	0.59
	トルコ	206,652,275	0.55
	ベトナム	186,836,664	0.50
	カタール	167,875,731	0.45
	エジプト	149,110,428	0.40
	インドネシア	137,774,209	0.37
	メキシコ	113,077,386	0.30
	コロンビア	99,889,902	0.27
	ドミニカ共和国	97,264,922	0.26
	アラブ首長国連邦	91,550,975	0.25
	ブラジル	89,315,358	0.24
	アルゼンチン	88,698,389	0.24
	アンゴラ	84,817,300	0.23
	ペルー	71,123,602	0.19
	ナイジェリア	69,094,925	0.19
	オマーン	66,717,420	0.18
	ウクライナ	60,051,050	0.16
	チリ	57,829,962	0.15
	エクアドル	55,204,080	0.15
	パナマ	51,620,821	0.14
	ケニア	48,212,048	0.13
	ルーマニア	44,105,055	0.12
	ヴェネズエラ	42,716,235	0.11
	パキスタン	32,802,111	0.09
	コートジボアール	31,603,828	0.08

	エルサルバドル	31,094,480	0.08
	ウルグアイ	31,085,698	0.08
	グアテマラ	25,270,308	0.07
	グルジア	23,982,990	0.06
	ガボン	23,866,818	0.06
	サウジアラビア	23,844,360	0.06
	パラグアイ	23,165,073	0.06
	コスタリカ	21,488,288	0.06
	ウズベキスタン	21,328,226	0.06
	ガーナ	20,299,452	0.05
	セルビア	19,924,458	0.05
	レバノン	19,194,072	0.05
	スリランカ	17,987,589	0.05
	ジャマイカ	16,174,655	0.04
	バルバドス	14,242,153	0.04
	ルワンダ	14,057,082	0.04
	アルメニア	9,004,192	0.02
	ザンビア	6,666,661	0.02
	小計	18,200,237,667	48.76
地方債証券	アルゼンチン	47,459,057	0.13
	小計	47,459,057	0.13
特殊債券	アメリカ	902,762,610	2.42
	メキシコ	324,269,099	0.87
	南アフリカ	60,074,978	0.16
	カタール	50,040,023	0.13
	インドネシア	40,816,970	0.11
	アルゼンチン	35,386,724	0.09
	アゼルバイジャン	33,557,263	0.09
	チリ	32,064,440	0.09
	オランダ	25,972,331	0.07
	アラブ首長国連邦	25,928,801	0.07
	モロッコ	25,033,556	0.07
	ウズベキスタン	24,429,933	0.07
	ヴェネズエラ	11,034,948	0.03
	小計	1,591,371,676	4.26
社債券	アメリカ	10,046,140,744	26.91
	オランダ	1,028,868,156	2.76
	カナダ	474,231,000	1.27
	ケイマン諸島	451,575,142	1.21
	イギリス	362,009,260	0.97
	ルクセンブルグ	345,644,273	0.93
	パナマ	239,916,100	0.64
	リベリア	199,111,427	0.53
	バミューダ	179,074,221	0.48

オーストラリア	140,591,511	0.38	
アイルランド	131,897,309	0.35	
サウジアラビア	119,552,779	0.32	
マレーシア	102,298,959	0.27	
ブラジル	102,119,987	0.27	
インドネシア	99,375,647	0.27	
フランス	95,210,398	0.26	
マーシャル諸島	76,808,451	0.21	
イギリス領バージン 諸島	71,661,105	0.19	
バーレーン	68,592,363	0.18	
イスラエル	53,303,235	0.14	
メキシコ	51,147,261	0.14	
モーリシャス	50,253,375	0.13	
シンガポール	41,301,343	0.11	
チリ	40,670,576	0.11	
ペルー	39,304,003	0.11	
国際機関	36,387,187	0.10	
グルジア	33,964,350	0.09	
アラブ首長国連邦	25,331,028	0.07	
グアテマラ	24,014,043	0.06	
コロンビア	23,844,360	0.06	
ジャージー	23,255,183	0.06	
スペイン	22,957,447	0.06	
ナイジェリア	22,757,778	0.06	
香港	22,593,086	0.06	
カザフスタン	21,726,648	0.06	
ベトナム	21,154,938	0.06	
フィンランド	15,205,978	0.04	
ロシア	14,200,703	0.04	
ウクライナ	5,480,876	0.01	
小計	14,923,532,230	39.98	
預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,573,238,253	4.21
合計（純資産総額）		37,326,680,994	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

(2022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	169,959,521	0.46
貸付債権	アメリカ	716,292,329	1.91

(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）

(2022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	6,945,672,563	3.7913	26,333,373,300	3.7824	26,271,311,902	100.99

## Bコース（為替ヘッジなし）

(2022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	1,099,179,033	3.7913	4,167,331,801	3.7824	4,157,534,774	100.04

## 種類別投資比率

## Aコース（為替ヘッジ付き）

(2022年8月31日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.99

## Bコース（為替ヘッジなし）

(2022年8月31日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.04

## （参考）マザーファンドの投資有価証券の主要銘柄

## フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

（2022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	12,466,000.00	11,701.20 1,458,672,063	11,569.64 1,442,271,809	2.500 2045/02/15	3.86
2	GERMANY GOVT 0% 08/15/31 REGS	ユーロ ドイツ	国債証券	11,745,000.00	12,509.64 1,469,257,375	12,262.86 1,440,273,269	0.000 2031/08/15	3.86
3	AID 5.5% 9/18/23	アメリカ・ドル イスラエル	国債証券	9,504,000.00	14,203.75 1,349,924,641	14,130.42 1,342,954,857	5.500 2023/09/18	3.60
4	UST NOTES 2.875% 11/30/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	7,161,000.00	13,702.05 981,203,841	13,612.77 974,810,663	2.875 2025/11/30	2.61
5	422 2年国債	日本・円 日本	国債証券	838,050,000.00	100.16 839,412,105	100.12 839,064,040	0.100 2023/03/01	2.25
6	GERMANY GOVT 0% 02/15/31 REGS	ユーロ ドイツ	国債証券	6,610,000.00	12,614.65 833,828,838	12,375.06 817,991,485	0.000 2031/02/15	2.19
7	USTN 2.75% 06/30/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	5,512,000.00	13,675.01 753,766,976	13,593.23 749,258,618	2.750 2025/06/30	2.01
8	INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	アメリカ・ドル オランダ	社債券	5,535,000.00	13,239.16 732,787,782	13,169.85 728,951,197	7.000 2023/06/30	1.95
9	UK GILT .375% 10/22/26 RGS	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	4,775,000.00	15,118.80 721,923,001	14,676.88 700,820,924	0.375 2026/10/22	1.88
10	USTB 6.125%	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,002,000.00	16,510.41 660,746,892	16,358.34 654,660,766	6.125 2029/08/15	1.75
11	USTN 1% 08/31/28	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	5,154,000.00	12,291.49 633,503,411	12,237.84 630,738,299	1.125 2028/08/31	1.69
12	USTB 4.75% 2/15/37	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	3,628,000.00	16,742.20 607,407,250	16,506.12 598,842,018	4.750 2037/02/15	1.60
13	USTN .75% 03/31/26	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,597,000.00	12,675.35 582,686,151	12,609.78 579,671,807	0.750 2026/03/31	1.55
14	USTN 1.25% 12/31/26	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	3,677,000.00	12,759.78 469,177,201	12,688.39 466,552,027	1.250 2026/12/31	1.25
15	CANADA GOVT 2% 12/01/51	カナダ・ドル カナダ	国債証券	4,470,000.00	8,459.67 378,147,505	8,553.11 382,323,837	2.000 2051/12/01	1.02
16	USTN .375% 12/31/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	2,639,000.00	12,575.68 331,872,243	12,517.73 330,343,012	0.375 2025/12/31	0.89
17	USTN .875% 09/30/26	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	2,500,000.00	12,603.40 315,085,195	12,540.47 313,511,745	0.875 2026/09/30	0.84
18	USTN .25% 07/31/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	2,281,000.00	12,669.95 289,001,564	12,629.33 288,075,054	0.250 2025/07/31	0.77
19	USTB 3% 02/15/49	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	2,058,000.00	13,159.45 270,821,537	13,023.04 268,014,180	3.000 2049/02/15	0.72
20	CANADA GOVT 1.5% 06/01/31	カナダ・ドル カナダ	国債証券	2,700,000.00	9,282.43 250,625,719	9,319.09 251,615,317	1.500 2031/06/01	0.67
21	SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	1,435,000.00	17,224.77 247,175,557	16,738.74 240,200,929	8.750 2032/03/15	0.64

22	BTP 1.7% 09/01/51 144A REGS	ユーロ イタリア	国債証券	2,500,000.00	9,555.39 238,884,821	8,821.04 220,525,910	1.700 2051/09/01	0.59
23	CANADA GOVT .5% 11/01/23	カナダ・ドル カナダ	国債証券	1,985,000.00	10,265.80 203,776,296	10,204.87 202,566,718	0.500 2023/11/01	0.54
24	VIETNAM PAR 3/5.5% 3/12/28	アメリカ・ドル ベトナム	国債証券	1,363,249.98	13,687.91 186,600,434	13,705.24 186,836,663	5.500 2028/03/12	0.50
25	USTN .25% 09/30/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	1,393,000.00	12,610.89 175,669,751	12,565.98 175,044,069	0.250 2025/09/30	0.47
26	FHLM .375% 04/20/23	アメリカ・ドル アメリカ	特殊債券	1,150,000.00	13,576.59 156,130,789	13,595.44 156,347,607	0.375 2023/04/20	0.42
27	USTN 3.25% 06/30/29	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	1,115,000.00	13,966.97 155,731,743	13,867.30 154,620,367	3.250 2029/06/30	0.41
28	USTN 1.125% 10/31/26	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	1,200,000.00	12,720.27 152,643,274	12,652.07 151,824,803	1.125 2026/10/31	0.41
29	DENBURY INC WT 09/18/25	アメリカ・ドル アメリカ	外国新株 予約権証 券	17,319.00	5,059.99 87,634,053	8,561.79 148,281,620	0.000 -	0.40
30	USTN 2.375% 04/30/26	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	1,107,000.00	13,456.25 148,960,793	13,379.87 148,115,210	2.375 2026/04/30	0.40

(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

(2022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	1.55
		小売	0.39
		食品・生活必需品小売り	0.02
		各種金融	0.00
		電気通信サービス	0.15
		公益事業	0.12
	小計		2.22
新株予約権証券	外国	-	0.43
	小計		0.43
公社債券	国内	国債証券	2.25
	小計		2.25
	外国	国債証券	46.51
		地方債証券	0.13
		特殊債券	4.26
		社債券	39.98
小計		90.88	
合計(対純資産総額比)			95.79

## 【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）

（2022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	3,702,800	598,792,377	598,039,228	2.30
	カナダ・ドル	売建	5,913,600	621,768,913	624,826,836	2.40
	ユーロ	売建	12,996,700	1,787,208,708	1,806,177,392	6.94
	アメリカ・ドル	売建	164,878,800	22,550,885,673	22,804,551,706	87.66

## 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

（2022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	1,226,096	169,904,868	169,959,521	0.46
貸付債権	アメリカ・ドル	-	5,696,631.08	705,343,380	716,292,329	1.91

（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】

2022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)
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
2021年1月20日 (第45特定期間)	36,723	36,846	0.5961	0.5981
2021年7月20日 (第46特定期間)	34,718	34,835	0.5956	0.5976

2022年1月20日 (第47特定期間)	31,681	31,792	0.5721	0.5741
2022年7月20日 (第48特定期間)	26,104	26,209	0.4968	0.4988
2021年8月末日	34,551	-	0.5967	-
2021年9月末日	33,899	-	0.5894	-
2021年10月末日	33,404	-	0.5880	-
2021年11月末日	32,749	-	0.5830	-
2021年12月末日	32,497	-	0.5829	-
2022年1月末日	31,392	-	0.5693	-
2022年2月末日	30,506	-	0.5569	-
2022年3月末日	29,689	-	0.5468	-
2022年4月末日	28,478	-	0.5293	-
2022年5月末日	27,874	-	0.5243	-
2022年6月末日	26,241	-	0.4973	-
2022年7月末日	26,629	-	0.5087	-
2022年8月末日	26,014	-	0.5006	-

## 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)
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
2021年1月20日 (第45特定期間)	4,406	4,425	0.5806	0.5831
2021年7月20日 (第46特定期間)	4,216	4,234	0.6080	0.6105
2022年1月20日 (第47特定期間)	4,050	4,067	0.6058	0.6083
2022年7月20日 (第48特定期間)	4,093	4,110	0.6298	0.6323
2021年8月末日	4,215	-	0.6109	-
2021年9月末日	4,222	-	0.6128	-

2021年10月末日	4,198	-	0.6216	-
2021年11月末日	4,141	-	0.6139	-
2021年12月末日	4,132	-	0.6209	-
2022年1月末日	4,047	-	0.6075	-
2022年2月末日	3,926	-	0.5947	-
2022年3月末日	4,107	-	0.6180	-
2022年4月末日	4,135	-	0.6260	-
2022年5月末日	4,049	-	0.6188	-
2022年6月末日	4,029	-	0.6239	-
2022年7月末日	4,099	-	0.6291	-
2022年8月末日	4,155	-	0.6369	-

## 【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
第45特定期間(260期～265期計算期間合計)	0.0120
第46特定期間(266期～271期計算期間合計)	0.0120
第47特定期間(272期～277期計算期間合計)	0.0120
第48特定期間(278期～283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
第45特定期間(260期~265期計算期間合計)	0.0150
第46特定期間(266期~271期計算期間合計)	0.0150
第47特定期間(272期~277期計算期間合計)	0.0150
第48特定期間(278期~283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
第45特定期間（260期～265期計算期間合計）	3.3
第46特定期間（266期～271期計算期間合計）	1.9
第47特定期間（272期～277期計算期間合計）	1.9
第48特定期間（278期～283期計算期間合計）	11.1

## Bコース（為替ヘッジなし）

期	収益率(%)
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
第45特定期間（260期～265期計算期間合計）	1.0
第46特定期間（266期～271期計算期間合計）	7.3
第47特定期間（272期～277期計算期間合計）	2.1
第48特定期間（278期～283期計算期間合計）	6.4

（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
第45特定期間 (2020年7月21日～2021年1月20日)	833,871,090	4,704,450,792	61,607,953,972
第46特定期間 (2021年1月21日～2021年7月20日)	1,288,274,199	4,600,098,344	58,296,129,827
第47特定期間 (2021年7月21日～2022年1月20日)	1,464,514,208	4,378,834,989	55,381,809,046
第48特定期間 (2022年1月21日～2022年7月20日)	1,165,448,834	4,002,142,330	52,545,115,550

（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
第45特定期間 (2020年7月21日～2021年1月20日)	199,208,176	1,181,015,738	7,588,283,239
第46特定期間 (2021年1月21日～2021年7月20日)	595,389,382	1,248,197,041	6,935,475,580
第47特定期間 (2021年7月21日～2022年1月20日)	343,456,461	592,738,820	6,686,193,221
第48特定期間 (2022年1月21日～2022年7月20日)	376,310,380	562,243,755	6,500,259,846

(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;

(2022年8月31日現在)

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

※下記データは過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。  
 ※各々のグラフ、表にある比率は、それぞれの項目を四捨五入して表示しています。

## 基準価額・純資産の推移



※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	5,006円	6,369円
純資産総額	260.1億円	41.6億円

## 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)
2022年 4月	20円	25円
2022年 5月	20円	25円
2022年 6月	20円	25円
2022年 7月	20円	25円
2022年 8月	20円	25円
直近1年間累計	240円	300円
設定来累計	9,020円	10,715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	94.1%	銘柄	クーポン	償還日	格付	比率		
転換社債	0.9%	1 米国国債	2.5%	2045/2/15	AA/Aa	3.9%		
株式	2.2%	2 ドイツ国債	0%	2031/8/15	AAA/Aaa	3.9%		
新株予約権証券(ワラント)	0.4%	3 米国政府保証債	5.5%	2023/9/18	AA/Aa	3.6%		
現金・その他	2.3%	4 米国国債	2.875%	2025/11/30	AA/Aa	2.6%		
		5 第422回 2年国債	0.1%	2023/3/1	A	2.2%		
		6 ドイツ国債	0%	2031/2/15	AAA/Aaa	2.2%		
		7 米国国債	2.75%	2025/6/30	AA/Aa	2.0%		
		8 インタージェン	7%	2023/6/30	B	2.0%		
		9 英国国債	0.375%	2026/10/22	AA/Aa	1.9%		
		10 米国国債	6.125%	2029/8/15	AA/Aa	1.8%		

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	58.6%	AAA/Aaa	9.7%	アメリカ・ドル	86.3%	米国国債・政府機関債	31.3%
ドイツ	6.1%	AA/Aa	35.0%	ユーロ	6.9%	ハイ・イールド・ボンド	39.2%
イスラエル	3.7%	A	3.6%	日本・円	2.3%	先進国債券 (除く米国)	13.7%
カナダ	3.5%	BBB/Baa	6.3%	カナダ・ドル	2.3%	エマージング債券	15.8%
イギリス	3.2%	BB/Ba	18.4%	イギリス・ポンド	2.3%		
オランダ	2.8%	B	17.8%				
日本	2.2%	CCC/Caa	6.3%				
メキシコ	1.3%	CC/Ca以下	0.4%				
ケイマン諸島(英領)	1.2%	格付なし	2.5%				
その他	14.9%						

※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。  
 ※2022年は年初以降8月末までの実績となります。

### 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48特定期間（2022年1月21日から2022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47特定期間 2022年1月20日現在	第48特定期間 2022年7月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	3,608,206	7,560,407
親投資信託受益証券	31,882,338,709	26,421,102,400
派生商品評価勘定	-	17,576,080
未収入金	216,463,501	248,237,717
流動資産合計	32,102,410,416	26,694,476,604
資産合計		
	32,102,410,416	26,694,476,604
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	38,161,303	27,395,831
未払金	175,596,393	382,453,009
未払収益分配金	110,763,618	105,090,231
未払解約金	49,858,914	37,339,427
未払受託者報酬	1,510,844	1,187,875
未払委託者報酬	41,699,638	32,785,421
その他未払費用	3,003,544	3,583,273
流動負債合計	420,594,254	589,835,067
負債合計		
	420,594,254	589,835,067
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	55,381,809,046	52,545,115,550
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	23,699,992,884	26,440,474,013
元本等合計	31,681,816,162	26,104,641,537
純資産合計		
	31,681,816,162	26,104,641,537
負債純資産合計		
	32,102,410,416	26,694,476,604

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第47特定期間 自 2021年7月21日 至 2022年1月20日	第48特定期間 自 2022年1月21日 至 2022年7月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	4	4
有価証券売買等損益	1,021,784,363	2,087,354,774
為替差損益	1,394,934,508	5,276,933,811
<b>営業収益合計</b>	<b>373,150,141</b>	<b>3,189,579,033</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	9,307,427	7,852,497
委託者報酬	256,886,246	216,729,978
その他費用	3,009,484	3,583,273
<b>営業費用合計</b>	<b>269,203,157</b>	<b>228,165,748</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>642,353,298</b>	<b>3,417,744,781</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>	<b>642,353,298</b>	<b>3,417,744,781</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>642,353,298</b>	<b>3,417,744,781</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（ ）	4,111,955	14,595,013
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>23,577,357,243</b>	<b>23,699,992,884</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>1,794,892,994</b>	<b>1,850,440,006</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,794,892,994	1,850,440,006
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>599,928,024</b>	<b>544,020,985</b>
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	599,928,024	544,020,985
<b>分配金</b>	<b>679,359,268</b>	<b>643,750,382</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>23,699,992,884</b>	<b>26,440,474,013</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47特定期間 2022年1月20日現在	第48特定期間 2022年7月20日現在
1．元本の推移		
期首元本額	58,296,129,827 円	55,381,809,046 円
期中追加設定元本額	1,464,514,208 円	1,165,448,834 円
期中一部解約元本額	4,378,834,989 円	4,002,142,330 円
2．受益権の総数	55,381,809,046 口	52,545,115,550 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	23,699,992,884 円	26,440,474,013 円
4．1口当たり純資産額	0.5721 円	0.4968 円

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第47特定期間 自 2021年 7月21日 至 2022年 1月20日</p>	<p style="text-align: center;">第48特定期間 自 2022年 1月21日 至 2022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0.33%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2021年 7月21日 至2021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（76,376,982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、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（826,846,323円）及び分配準備積立金（35,760円）より分配対象収益は903,259,065円（1口当たり0.015613円）であり、うち115,703,089円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2021年 8月21日 至2021年 9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（84,461,360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、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（780,562,382円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は865,023,742円（1口当たり0.015091円）であり、うち114,644,274円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2021年 9月22日 至2021年10月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（55,215,525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、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（745,871,046円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は801,086,571円（1口当たり0.014066円）であり、うち113,906,614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2022年 1月21日 至2022年 2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（62,672,489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、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（517,810,003円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は580,482,492円（1口当たり0.010594円）であり、うち109,584,837円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2022年 2月22日 至2022年 3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（60,783,135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、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（469,086,289円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は529,869,424円（1口当たり0.009711円）であり、うち109,132,011円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2022年 3月23日 至2022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（63,185,423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、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（416,013,092円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は479,198,515円（1口当たり0.008884円）であり、うち107,874,368円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p>



(自2021年10月21日 至2021年11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(83,471,385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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(679,375,609円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は762,846,994円(1口当たり0.013551円)であり、うち112,590,613円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2021年11月23日 至2021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(49,742,154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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(645,529,724円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は695,271,878円(1口当たり0.012443円)であり、うち111,751,060円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2021年12月21日 至2022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(55,476,197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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(578,515,286円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は633,991,483円(1口当たり0.011448円)であり、うち110,763,618円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2022年4月21日 至2022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(61,306,589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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(366,453,147円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は427,759,736円(1口当たり0.008039円)であり、うち106,425,852円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2022年5月21日 至2022年6月20日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(67,712,500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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(319,263,781円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は386,976,281円(1口当たり0.007326円)であり、うち105,643,083円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2022年6月21日 至2022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(59,519,089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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(280,013,256円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は339,532,345円(1口当たり0.006462円)であり、うち105,090,231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ならびに運用リスク管理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47特定期間 2022年 1月20日現在	第48特定期間 2022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	274,960,005	569,063,136
合 計	274,960,005	569,063,136

## （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47特定期間 2022年 1月20日 現在			第48特定期間 2022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	31,182,166,967	-	31,220,328,270	38,161,303	25,789,766,716	-	25,799,586,467	9,819,751
アメリ カ・ド ル	27,329,028,419	-	27,362,625,021	33,596,602	22,734,115,483	-	22,716,539,403	17,576,080
イギリ ス・ポ ンド	772,608,276	-	773,745,560	1,137,284	610,041,262	-	613,537,297	3,496,035
カナ ダ・ド ル	760,647,268	-	762,440,033	1,792,765	624,102,971	-	629,213,438	5,110,467
ユーロ	2,319,883,004	-	2,321,517,656	1,634,652	1,821,507,000	-	1,840,296,329	18,789,329
合計	31,182,166,967	-	31,220,328,270	38,161,303	25,789,766,716	-	25,799,586,467	9,819,751

## （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	7,104,738,733	26,421,102,400	
親投資信託受益証券 合計		7,104,738,733	26,421,102,400	
合計		7,104,738,733	26,421,102,400	

(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47特定期間 2022年1月20日現在	第48特定期間 2022年7月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	594,543	1,221,987
親投資信託受益証券	4,048,932,730	4,091,848,023
未収入金	24,715,237	32,795,933
流動資産合計	4,074,242,510	4,125,865,943
資産合計	4,074,242,510	4,125,865,943
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	16,715,483	16,250,649
未払解約金	594,543	9,806,079
未払受託者報酬	192,727	182,610
未払委託者報酬	5,319,588	5,040,236
その他未払費用	669,046	775,804
流動負債合計	23,491,387	32,055,378
負債合計	23,491,387	32,055,378
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,686,193,221	6,500,259,846
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,635,442,098	2,406,449,281
(分配準備積立金)	37,781,248	7,545,306
元本等合計	4,050,751,123	4,093,810,565
純資産合計	4,050,751,123	4,093,810,565
負債純資産合計	4,074,242,510	4,125,865,943

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第47特定期間 自 2021年7月21日 至 2022年1月20日	第48特定期間 自 2022年1月21日 至 2022年7月20日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	121,334,821	287,860,859
<b>営業収益合計</b>	<b>121,334,821</b>	<b>287,860,859</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,159,327	1,100,780
委託者報酬	31,998,797	30,382,674
その他費用	669,046	775,804
<b>営業費用合計</b>	<b>33,827,170</b>	<b>32,259,258</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>87,507,651</b>	<b>255,601,601</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>	<b>87,507,651</b>	<b>255,601,601</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>87,507,651</b>	<b>255,601,601</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（ ）	1,594,616	2,741,181
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>2,718,728,134</b>	<b>2,635,442,098</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>230,083,377</b>	<b>219,224,933</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	230,083,377	219,224,933
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>130,952,415</b>	<b>144,928,586</b>
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	130,952,415	144,928,586
<b>分配金</b>	<b>101,757,961</b>	<b>98,163,950</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>2,635,442,098</b>	<b>2,406,449,281</b>

## (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47特定期間 2022年1月20日現在	第48特定期間 2022年7月20日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	6,935,475,580 円	6,686,193,221 円
期中追加設定元本額	343,456,461 円	376,310,380 円
期中一部解約元本額	592,738,820 円	562,243,755 円
2. 受益権の総数	6,686,193,221 口	6,500,259,846 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	2,635,442,098 円	2,406,449,281 円
4. 1口当たり純資産額	0.6058 円	0.6298 円

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第47特定期間 自 2021年 7月21日 至 2022年 1月20日</p>	<p style="text-align: center;">第48特定期間 自 2022年 1月21日 至 2022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0.33%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2021年 7月21日 至2021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（9,258,648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、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（173,496,256円）及び分配準備積立金（94,569,395円）より分配対象収益は277,324,299円（1口当たり0.040134円）であり、うち17,275,050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2022年 1月21日 至2022年 2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（7,979,814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、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（169,572,182円）及び分配準備積立金（37,008,078円）より分配対象収益は214,560,074円（1口当たり0.032498円）であり、うち16,505,684円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p>
<p>（自2021年 8月21日 至2021年 9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（8,344,343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、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（173,003,705円）及び分配準備積立金（85,909,309円）より分配対象収益は267,257,357円（1口当たり0.038850円）であり、うち17,198,197円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2022年 2月22日 至2022年 3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（11,974,714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、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（170,392,198円）及び分配準備積立金（28,350,800円）より分配対象収益は210,717,712円（1口当たり0.031816円）であり、うち16,557,548円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p>
<p>（自2021年 9月22日 至2021年10月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（11,440,950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、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（172,859,654円）及び分配準備積立金（74,347,114円）より分配対象収益は258,647,718円（1口当たり0.038059円）であり、うち16,990,068円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2022年 3月23日 至2022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（13,181,818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、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（169,860,485円）及び分配準備積立金（23,351,092円）より分配対象収益は206,393,395円（1口当たり0.031327円）であり、うち16,470,781円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p>



(自2021年10月21日 至2021年11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(8,215,724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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(171,508,235円)及び分配準備積立金(67,865,813円)より分配対象収益は247,589,772円(1口当たり0.036784円)であり、うち16,827,202円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2021年11月23日 至2021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(6,263,745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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(171,095,057円)及び分配準備積立金(58,662,162円)より分配対象収益は236,020,964円(1口当たり0.035223円)であり、うち16,751,961円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2021年12月21日 至2022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(6,976,324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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(171,358,280円)及び分配準備積立金(47,520,407円)より分配対象収益は225,855,011円(1口当たり0.033779円)であり、うち16,715,483円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2022年4月21日 至2022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(8,726,989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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(168,798,366円)及び分配準備積立金(19,744,441円)より分配対象収益は197,269,796円(1口当たり0.030170円)であり、うち16,346,591円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2022年5月21日 至2022年6月20日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(14,124,871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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(165,620,005円)及び分配準備積立金(11,853,576円)より分配対象収益は191,598,452円(1口当たり0.029876円)であり、うち16,032,697円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2022年6月21日 至2022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(13,889,508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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(168,176,645円)及び分配準備積立金(9,906,447円)より分配対象収益は191,972,600円(1口当たり0.029533円)であり、うち16,250,649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ならびに運用リスク管理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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第47特定期間 2022年1月20日現在	第48特定期間 2022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	34,996,363	87,778,513
合 計	34,996,363	87,778,513

## （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	1,100,314,086	4,091,848,023	
親投資信託受益証券	合計	1,100,314,086	4,091,848,023	
合計		1,100,314,086	4,091,848,023	

（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	2022年 1月20日現在	2022年 7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	502,560,271	636,637,309
貸付債権	493,719,757	694,199,863
株式	944,273,700	750,414,215
新株予約権証券	107,837,242	95,445,809
国債証券	20,589,341,921	18,471,456,850
地方債証券	39,144,553	43,612,757
特殊債券	1,574,196,395	1,509,087,422
社債券	18,061,590,528	14,859,610,202
派生商品評価勘定	2,208,322	1,492,737
未収入金	158,040,452	478,260,571
未収利息	398,078,334	413,005,788
前払費用	7,621,237	2,426,635
その他未収収益	-	38,198
流動資産合計	42,878,612,712	37,955,688,356
資産合計	42,878,612,712	37,955,688,356
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,845	8,292,356
未払金	204,438,631	455,102,470
未払解約金	293,647,242	269,292,634
流動負債合計	498,088,718	732,687,460
負債合計	498,088,718	732,687,460
純資産の部		
元本等		
元本	12,238,483,102	10,009,284,914
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	30,142,040,892	27,213,715,982
元本等合計	42,380,523,994	37,223,000,896
純資産合計	42,380,523,994	37,223,000,896
負債純資産合計	42,878,612,712	37,955,688,356

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式、新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. 貸付債権の評価基準及び評価方法	<p>貸付債権 原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2022年1月20日現在	2022年7月20日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	13,360,348,390 円	12,238,483,102 円
期中追加設定元本額	449,850,668 円	243,133,569 円
期中一部解約元本額	1,571,715,956 円	2,472,331,757 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）	9,206,832,051 円	7,104,738,733 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）	1,169,231,780 円	1,100,314,086 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）	767,238,156 円	631,888,513 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）	1,095,181,115 円	1,172,343,582 円
計	12,238,483,102 円	10,009,284,914 円
3. 受益権の総数	12,238,483,102 口	10,009,284,914 口
4. 1口当たり純資産額	3.4629 円	3.7188 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ならびに運用リスク管理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	2022年1月20日現在	2022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	100,570,799	72,077,269
新株予約権証券	33,374,119	5,439,950
国債証券	937,365,969	2,903,565,331
地方債証券	5,636,515	10,515,493
特殊債券	52,555,976	277,559,406
社債券	352,440,549	2,657,639,798
合 計	1,214,054,091	5,771,762,809

(注) 2022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(2021年7月21日から2022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	2022年1月20日 現在			2022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	291,369,508	-	289,164,031	2,205,477	725,958,528	-	734,249,966	8,291,438
アメリカ・ドル	291,369,508	-	289,164,031	2,205,477	480,464,118	-	484,487,008	4,022,890
ユーロ	-	-	-	-	245,494,410	-	249,762,958	4,268,548
買建	-	-	-	-	245,494,410	-	246,986,229	1,491,819
アメリカ・ドル	-	-	-	-	245,494,410	-	246,986,229	1,491,819
合計	291,369,508	-	289,164,031	2,205,477	971,452,938	-	981,236,195	6,799,619

## （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	VISTRA CORP	13,818	23.63	326,519.34	
	MESQUITE ENERGY INC	11,182	58.63	655,600.66	
	DENBURY INC	6,288	60.49	380,361.12	
	EP ENERGY CORP	19,360	9.35	181,016.00	
	CALIFORNIA RES CORP	6,382	41.09	262,236.38	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,640	88.63	677,133.20	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP PIPE	194	88.63	17,194.22	
	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC A	2,894	25.60	74,086.40	
	VALARIS LTD	2,392	42.66	102,042.72	
	FRONTIER COMMS PARENT INC	5,215	26.33	137,310.95	
	NOBLE CORP	495	26.62	13,176.90	
	NORTHEAST GROCERY INC PP	102,426	0.39	40,663.12	
	INTELSAT SA/LUXEMBOURG	6,535	40.00	261,400.00	
	SOUTHEASTERN GROCERS INC	45,701	24.40	1,115,104.40	
	LEGACY RESERVES INC NEW	9,287	10.00	92,870.00	
	LEGACY RESERVES INC 144A	59,461	10.00	594,610.00	
	NEW COTAI LLC / CAP P/P	170,219	-	-	
	JONAH EGY LLC / JONAH EGY FIN	10,826	45.50	492,583.00	
	NOBLE CORPORATION 144A	145	26.62	3,859.90	
	PURE WEST ENERGY	277	12.00	3,325.38	
	INTELSAT JACKSON CVR SER A RT	684	-	-	
INTELSAT JACKSON CVR SER B RT	684	-	-		
PURE WEST ENERGY CVR	167	-	-		
アメリカ・ドル	小計	482,272		5,431,093.69 (750,414,215)	
合計		482,272		750,414,215 (750,414,215)	



## (イ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	アメリカ・ドル	CALIFORNIA RES CRP WT 10/27/24	1,626.00	19,105.50	
		DENBURY INC WT 09/18/25	17,519.00	639,443.50	
		NOBLE CORPORATION TRANCHE 1 WT	2,011.00	20,170.33	
		NOBLE CORPORATION TRANCHE 2 WT	2,011.00	12,066.00	
	アメリカ・ドル	小計	23,167.00	690,785.33 (95,445,809)	
新株予約権証券	合計		95,445,809 (95,445,809)		
国債証券	日本円	422 2年国債	881,200,000	882,680,416	
	日本円	小計	881,200,000	882,680,416	
	アメリカ・ドル	AID 5.5% 9/18/23	9,504,000.00	9,737,608.32	
		ANGOLA GOVT 8.25% 5/9/28 144A	310,000.00	239,475.00	
		ANGOLA REP 9.5% 11/12/25 144A	360,000.00	313,200.00	
		ARGENTINA GOVT 1% 07/09/29	154,312.00	29,164.96	
		ARGENTINA GOVT STEP 01/09/38	371,540.00	91,027.30	
		ARGENTINA GOVT STEP 07/09/30	1,225,378.00	236,497.95	
		ARGENTINA GOVT STEP 07/09/35	959,621.00	174,651.02	
		BARBADOS 6.5% 10/01/29 144A	138,000.00	131,124.84	
		BRAZIL GLBL 8.25% 1/20/34	150,000.00	164,089.50	
		BRAZIL GOVT 3.875% 06/12/30	320,000.00	272,160.00	
		BRAZIL GOVT 5% 01/27/45	250,000.00	183,640.00	
		CHILE GOVT 4% 01/31/52	200,000.00	164,500.00	
		CHILE REP 2.45% 01/31/2031	305,000.00	260,354.10	
		COLOMBIA GOVT 3.125% 04/15/31	200,000.00	147,850.00	
		COLOMBIA GOVT 5% 06/15/45	440,000.00	293,229.20	
		COLOMBIA REP 7.375% 9/18/37	120,000.00	110,910.00	
		COLOMBIA REP OF 3% 01/30/30	200,000.00	151,850.00	

COSTA RICA 5.625% 4/30/43 144A	180,000.00	128,901.60	
DOMIN REP 4.875% 09/23/32 144A	150,000.00	116,512.50	
DOMIN REP 5.875% 01/30/60 144A	420,000.00	291,450.60	
DOMINICAN REP 6.4% 6/5/49 144A	125,000.00	94,281.25	
DOMINICAN REP 7.45% 04/44 144A	200,000.00	174,536.00	
DUBAI GOVT INT 3.9% 9/9/50 RGS	400,000.00	276,324.00	
ECUADOR REP STEP 07/31/30 144A	245,770.00	136,525.23	
ECUADOR REP STEP 07/31/35 144A	484,689.00	204,718.09	
EGYPT 7.6003% 3/1/29 144A	330,000.00	222,337.50	
EGYPT GOVT 7.903% 2/21/48 144A	440,000.00	236,500.00	
EGYPT REP OF 7.5% 1/31/27 144A	460,000.00	335,800.00	
EGYPT REP OF 8.5% 1/31/47 144A	260,000.00	144,625.00	
EL SALVADOR 7.75% 1/24/23 144A	200,000.00	128,600.00	
EL SALVADOR REPUBLIC OF 7.1246	205,000.00	54,683.75	
EMIRATE OF AB 1.7% 3/2/31 144A	200,000.00	170,724.00	
EMIRATE OF AB 3.125% 4/30 144A	200,000.00	192,350.00	
GABONESE REP 6.95 6/16/25 144A	200,000.00	159,786.00	
GEORGIA GOVT 2.75% 4/26 144A	200,000.00	163,100.00	
GHANA GOVT 8.125% 01/26 144A	125,000.00	86,390.00	
GHANA REP 8.625% 06/16/49	175,000.00	75,446.00	
GUATEMALA GOV 6.125% 6/50 144A	200,000.00	169,036.00	
INDONESIA 7.75% 1/17/38 144A	405,000.00	476,328.60	
INDONESIA 8.5% 10/12/35 144A	385,000.00	480,118.10	
ISRAEL GLBL 5.5% 12/4/23	8,000.00	8,224.08	
IVORY COAST 6.375% 3/3/28 144A	245,000.00	209,597.50	

JAMAICA 8% 3/14/39	100,000.00	105,050.00	
KENYA GOVT 7% 05/22/27 144A	140,000.00	96,600.00	
KENYA REP 6.875% 06/24/24 144A	275,000.00	219,312.50	
LEBANE 144A 5.8% 4/14/20 REGS	885,000.00	54,923.10	
LEBANESE REP 6.15% 6/20	180,000.00	11,170.80	
LEBANON REP 6.375% 3/09/20	840,000.00	52,130.40	
MEXICO GOVT 3.25% 04/16/30	200,000.00	176,600.00	
MEXICO UNITED MEX 3.75% 1/28	200,000.00	192,000.00	
NIGERIA GOVT 7.696% 2/38 144A	200,000.00	118,500.00	
NIGERIA REP 7.625% 11/25 144A	175,000.00	148,750.00	
NIGERIA REPUB 6.5% 11/27 144A	280,000.00	203,000.00	
OMAN GOVT 6.25% 01/25/31 144A	230,000.00	218,500.00	
OMAN SULTAN 6.5% 3/8/47 144A	205,000.00	165,537.50	
OMAN SULTANA 6% 08/29 144A	120,000.00	114,600.00	
OMAN SULTANATE 6.75% 1/48 144A	200,000.00	166,000.00	
PAKISTAN GOV 6.875% 12/27 144A	245,000.00	117,626.95	
PAKISTAN ISLAM 0% 4/6/26 144A	130,000.00	62,414.30	
PANAMA GOVT 2.252% 09/29/32	200,000.00	156,350.00	
PANAMA GOVT 3.16% 01/23/30	200,000.00	178,162.00	
PANAMA GOVT 4.5% 05/15/2047	50,000.00	40,587.50	
PARAGUAY REP 5.4% 3/30/50 144A	200,000.00	153,662.00	
PERU GOVT 3% 01/15/34	100,000.00	81,900.00	
PERU GOVT 3.3% 03/11/41	145,000.00	109,692.50	
PERU REPUBLIC 2.783% 1/23/31	375,000.00	319,053.75	
QATAR GOVT 3.75% 04/16/30 144A	200,000.00	199,500.00	

QATAR GOVT 4.4% 04/16/50 144A	380,000.00	366,700.00	
QATAR ST 4.817% 03/14/49 144A	285,000.00	289,275.00	
QATAR ST 5.103% 4/23/48 144A	320,000.00	337,600.00	
REP OF ARMENIA 7.15% 3/25 144A	65,000.00	63,610.30	
ROMANIA GOVT 3.625% 3/32 144A	102,000.00	77,857.62	
ROMANIA GOVT 5.125% 06/48 144A	210,000.00	160,820.10	
ROMANIA REPUBLIC 3% 02/31 144A	77,000.00	59,015.11	
RWANDA GOVT 5.5% 08/09/31 144A	130,000.00	94,315.00	
SAUDI ARABIA 2.25% 02/02/33 144A	200,000.00	170,000.00	
SERBIA GOVT 2.125% 12/01/30 144A	200,000.00	134,000.00	
SRI LANKA GOVT 6.2% 05/27 144A	200,000.00	45,912.00	
SRI LANKA GOVT 6.75% 4/28 144A	230,000.00	52,798.80	
TURKEY GOVT 4.875% 4/16/2043	700,000.00	400,225.00	
TURKEY GOVT 5.125% 2/17/28	120,000.00	90,060.00	
TURKEY GOVT BD 4.25% 04/14/26	70,000.00	55,706.70	
TURKEY REP 6.375% 10/14/25	400,000.00	349,200.00	
TURKEY REP GOVT 4.75% 01/26/26	385,000.00	313,775.00	
TURKEY REPUBLI 4.875% 10/09/26	145,000.00	115,074.90	
TURKEY REPUBLIC OF 4.25% 03/25	140,000.00	118,456.80	
UKRAINE 6.876% 05/21/29 144A	200,000.00	34,000.00	
UKRAINE 7.253% 03/15/33 144A	200,000.00	33,000.00	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/23 144A	470,000.00	94,000.00	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/24 144A	540,000.00	95,850.00	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/26 144A	200,000.00	34,000.00	
UKRAINE CABINET VAR 0% 5/31/40	245,000.00	53,900.00	

UNITED MEXICAN 4.35% 1/15/47	560,000.00	433,580.00	
URUGUAY REPUBLICA ORIENTAL DL	220,000.00	221,621.40	
UST NOTES 2.875% 11/30/25	7,161,000.00	7,077,860.79	
USTB 2% 08/15/51	559,000.00	430,251.12	
USTB 2% 11/15/41	851,000.00	674,017.53	
USTB 2.25% 02/15/52	210,000.00	172,067.70	
USTB 2.375% 02/15/42	50,000.00	42,242.00	
USTB 2.50% 02/15/45	12,466,000.00	10,522,051.96	
USTB 2.875% 05/15/52	651,000.00	612,955.56	
USTB 3% 02/15/49	2,058,000.00	1,953,556.50	
USTB 3.5% 2/15/39	200,000.00	209,132.00	
USTB 4.75% 2/15/37	3,628,000.00	4,381,499.32	
USTB 6.125%	4,002,000.00	4,766,261.94	
USTN .25% 07/31/25	2,281,000.00	2,084,697.14	
USTN .25% 09/30/25	1,393,000.00	1,267,184.24	
USTN .375% 12/31/25	2,639,000.00	2,393,942.46	
USTN .75% 03/31/26	4,597,000.00	4,203,175.01	
USTN .875% 09/30/26	2,500,000.00	2,272,850.00	
USTN 1% 07/31/28	322,000.00	283,749.62	
USTN 1% 08/31/28	5,154,000.00	4,569,742.56	
USTN 1.125% 10/31/26	1,200,000.00	1,101,084.00	
USTN 1.25% 12/31/26	3,677,000.00	3,384,384.34	
USTN 1.5% 01/31/27	690,000.00	641,562.00	
USTN 1.5% 11/30/28	224,000.00	202,578.88	
USTN 1.625% 09/30/26	1,060,000.00	995,149.20	
USTN 1.875% 02/15/32	648,000.00	586,485.36	
USTN 1.875% 02/28/29	621,000.00	575,052.21	
USTN 2.25% 03/31/26	494,000.00	477,401.60	
USTN 2.25% 12/31/24	893,000.00	872,068.08	
USTN 2.375% 03/31/29	796,000.00	758,962.12	
USTN 2.375% 04/30/26	1,107,000.00	1,074,520.62	
USTN 2.5% 02/28/26	90,000.00	87,787.80	
USTN 2.5% 03/31/27	410,000.00	398,146.90	
USTN 2.625% 05/31/27	470,000.00	458,908.00	
USTN 2.625% 12/31/25	750,000.00	735,315.00	
USTN 2.75% 05/31/29	720,000.00	703,008.00	



		USTN 2.75% 06/30/25	5,512,000.00	5,437,257.28	
		USTN 2.875% 04/30/29	590,000.00	580,683.90	
		USTN 2.875% 05/15/32	220,000.00	217,283.00	
		USTN 3.25% 06/30/29	1,115,000.00	1,123,362.50	
		UZBEKISTAN 3.7% 11/25/30 144A	200,000.00	138,000.00	
		VENEZUELA 11.95% 8/31 REGS	1,470,000.00	124,950.00	
		VENEZUELA REP 9.25% 9/15/27	1,805,000.00	153,425.00	
		VENEZUELA REPUB 12.75% 8/23/22	345,000.00	29,756.25	
		VIETNAM PAR 3/5.5% 3/12/28	1,363,249.98	1,346,032.13	
		ZAMBIA REP 8.97% 07/30/27 144A	80,000.00	38,864.80	
	アメリカ・ドル	小計	111,992,559.98	95,353,471.44 (13,174,989,149)	
	イギリス・ポ ンド	UK GILT .375% 10/22/26 RGS	4,845,000.00	4,527,071.10	
		UK GILT .875% 07/31/33 RGS	925,000.00	792,808.25	
	イギリス・ポンド	小計	5,770,000.00	5,319,879.35 (883,153,171)	
	カナダ・ドル	CANADA GOVT .25% 08/01/22	2,325,000.00	2,323,163.25	
		CANADA GOVT 1.5% 06/01/31	2,700,000.00	2,365,956.00	
		CANADA GOVT 2% 12/01/51	4,470,000.00	3,569,786.70	
	カナダ・ドル	小計	9,495,000.00	8,258,905.95 (886,923,910)	
	ユーロ	BTP 1.7% 09/01/51 144A REGS	2,500,000.00	1,718,225.00	
		GERMANY GOVT 0% 02/15/31 REGS	7,035,000.00	6,383,136.90	
		GERMANY GOVT 0% 08/15/31 REGS	11,745,000.00	10,567,916.10	
		NETHERLANDS 0% 1/24 144A RGS	1,000.00	991.80	
	ユーロ	小計	21,281,000.00	18,670,269.80 (2,643,710,204)	
	国債証券 合計			18,471,456,850 (17,588,776,434)	
地方債証券	アメリカ・ド ル	BUENOS AIRE STEP 09/01/37 144A	247,845.00	64,717.28	

		PROVINCE CRDB 7.125% 6/21 144A	337,156.00	250,928.35	
	アメリカ・ドル	小計	585,001.00	315,645.63 (43,612,757)	
地方債証券 合計				43,612,757 (43,612,757)	
特殊債券	アメリカ・ドル	ABU DHABI NA 4% 10/03/49 144A	200,000.00	179,412.00	
		CODELCO INC 4.25% 7/17/42 144A	95,000.00	76,967.10	
		COMISION 4.688% 5/15/29 144A	200,000.00	178,974.00	
		CORPO NAC 4.375% 02/05/49 144A	100,000.00	83,175.00	
		EMPRESA NAC 4.5% 9/14/47 144A	95,000.00	68,506.40	
		ESKOM HLDGS 7.125% 2/25 144A	460,000.00	378,580.00	
		FHLB 0.5% 04/14/25	145,000.00	134,625.25	
		FHLG 15YR 2.5% 03/01/2033#G186	30,445.04	29,408.38	
		FHLG 15YR 2.5% 03/01/2033#G186	12,385.50	11,963.77	
		FHLG 15YR 2.5% 05/33#G18687	6,342.85	6,126.87	
		FHLG 15YR 2.5% 08/32#G18654	6,265.61	6,064.04	
		FHLG 15YR 2.5% 11/32#G18665	6,690.81	6,475.56	
		FHLG 15YR 2.5% 12/01/2032#G186	33,983.22	32,889.97	
		FHLG 20YR 1.5% 02/41#RB5099	68,937.62	59,684.12	
		FHLG 20YR 1.5% 03/41#RB5104	70,096.32	60,687.29	
		FHLG 20YR 1.5% 04/41#RB5107	69,816.30	60,444.85	
		FHLG 20YR 1.5% 12/40#RB5089	41,395.98	35,839.39	
		FHLG 30YR 3% 03/52#RA6988	49,235.99	46,245.39	
		FHLM .375% 04/20/23	1,150,000.00	1,126,241.00	
		FHMS 2021-K135 A2 2.191% 10/31	1,100,000.00	972,598.00	
		FHMS 2021-K136 A2 2.127% 11/31	640,000.00	564,556.80	
FHMS 2022-K139 A2 2.59% 01/32	900,000.00	823,734.00			

FNMA 0.625% 04/22/25	110,000.00	102,267.00	
FNMA 20YR 1.5% 01/41#MA4231	67,663.23	58,580.79	
FNMA 20YR 1.5% 02/41#MA4266	68,664.86	59,447.97	
FNMA 20YR 1.5% 03/41#MA4286	70,042.19	60,640.42	
FNMA 20YR 1.5% 11/40#MA4175	64,348.27	55,831.77	
FNMA 20YR 1.5% 12/40#MA4202	64,351.48	55,713.58	
FNMA 30YR 3% 12/51#BT9503	49,076.20	46,144.87	
FNMA 30YR 3.5% 02/52#MA4550	95,202.33	92,091.11	
FNMA 30YR 3.5% 03/52#CB3174	9,553.22	9,253.24	
HUTAMA KARYA P 3.75% 5/30 144A	200,000.00	180,850.00	
MDC GMTN BV 2.875% 5/21/30 RGS	200,000.00	180,100.00	
NAT BK OF UZBEK 4.85% 10/21/25	200,000.00	175,662.00	
OCP SA 3.75% 06/23/31 144A	220,000.00	167,200.00	
PDVSA 12.75% 2/17/22 144A	400,000.00	22,000.00	
PDVSA PETR VENZ 5.375% 4/12/27	325,000.00	17,875.00	
PEMEX 6.49% 01/23/27	460,000.00	398,705.00	
PEMEX 6.7% 02/16/32	140,000.00	104,475.00	
PEMEX 6.84% 1/23/30	235,000.00	183,934.50	
PEMEX 6.95% 01/28/60	460,000.00	286,520.20	
PEMEX 7.69% 01/23/50	578,000.00	389,629.80	
PEMEX PRO FDG 6.625% 6/15/35	615,000.00	415,986.00	
PETROL VENEZUELA 6% 11/26 144A	1,090,000.00	59,950.00	
PETROLEOS M 6.875% 10/16/25 WI	70,000.00	65,975.00	
PETROLEOS MEX 6.5% 6/02/41	500,000.00	313,975.00	
PETROLEOS MEXCNS 6.75% 9/21/47	495,000.00	308,241.45	

		PETROLEOS MEXICA 6.5% 03/13/27	60,000.00	51,921.60	
		PETROLEOS VENZ 9.75 5/35 144A	670,000.00	31,825.00	
		PRIVATE EXPORT 1.75% 11/15/24	920,000.00	883,200.00	
		PT PERTA PR 4.15% 2/25/60 144A	140,000.00	96,538.40	
		QATAR PETE 2.25% 07/12/31 144A	230,000.00	198,662.50	
		QATAR PETE 3.3% 07/12/51 144A	200,000.00	157,724.00	
		SOUTHERN GAS 6.875% 03/26 144A	230,000.00	228,173.80	
		TVA 5.25% 9/15/39	267,000.00	303,328.02	
		TVA 5.5% 6/15/38	4,000.00	4,598.20	
		YPF SA 8.5% 03/25 144A	141,750.00	96,123.51	
		YPF SOCIEDAD 8.75% 4/4/24 144A	168,000.00	115,617.60	
	アメリカ・ドル	小計	15,298,247.02	10,921,961.51 (1,509,087,422)	
特殊債券 合計				1,509,087,422 (1,509,087,422)	
社債券	アメリカ・ドル	1011778 BC ULC 4% 10/15/30 144A	525,000.00	438,973.50	
		1011778 ULC 3.875% 01/28 144A	160,000.00	145,000.00	
		ACADEMY LTD 6% 11/15/27 144A	235,000.00	213,850.00	
		ACCESS BANK NIG 6.125% 09/21/26	200,000.00	149,724.00	
		ACRISURE 10.125% 08/01/26 144A	110,000.00	110,000.00	
		ACRISURE LLC 7% 11/15/25 144A	475,000.00	448,195.75	
		ADARO INDO 4.25% 10/31/24 144A	345,000.00	321,129.45	
		ADTALEM GLOBA 5.5% 03/01/28 144A	329,000.00	300,212.50	
		ADVANCED DRAIN 5% 9/30/27 144A	40,000.00	38,800.00	
		ADVANCED DRAIN 6.375% 06/15/30 144A	225,000.00	225,382.50	
		AEROPUERTO 5.125% 08/61	200,000.00	152,662.00	
		AEROPUERTO INTE 4% 08/11/41 14	225,000.00	175,612.50	

AFFINTY GME 6.875% 12/15/27 144A	65,000.00	54,990.00	
AHP HEALTH PAR 5.75% 7/29 144A	190,000.00	137,275.00	
AIR CANADA 3.875% 08/15/26 144A	130,000.00	114,653.50	
ALBERTSONS 3.5% 03/15/29 144A	115,000.00	97,318.75	
ALBERTSONS 4.625% 1/15/27 144A	325,000.00	299,406.25	
ALBERTSONS 4.875% 2/15/30 144A	540,000.00	479,250.00	
ALCOA NEDERLAND 4.125% 03/31/29 144A	205,000.00	186,293.75	
ALLEGHENY TECH 4.875% 10/01/29	80,000.00	65,807.20	
ALLEGHENY TECH 5.125% 10/01/31	55,000.00	43,813.00	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 5.8	190,000.00	171,805.60	
ALLEN MEDIA 10.5% 02/28 144A	480,000.00	234,000.00	
ALLIANT HLDG 5.875% 11/01/29 144A	205,000.00	174,737.90	
ALLIANT HLDG 6.75% 10/27 144A	730,000.00	670,687.50	
ALLIED UNV 6% 06/01/29 144A	75,000.00	54,000.00	
ALLY FINL INC 5.8% 05/01/2025	2,000.00	2,043.76	
ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18 Escrow	610,000.00	-	
ALTICE FING 5% 01/15/28 144A	200,000.00	163,500.00	
ALTICE FR HLDS 6% 2/15/28 144A	190,000.00	139,650.00	
ALTICE FRAN 10.5% 5/15/27 RGS	430,000.00	373,025.00	
ALTICE FRANCE 5.125% 01/15/29 144A	155,000.00	122,837.50	
ALTICE FRANCE 5.125% 7/29 144A	320,000.00	253,539.20	
ALTICE FRANCE SA 5.5% 01/15/20	385,000.00	320,512.50	
AMWINS GROUP 4.875% 06/30/29 144A	100,000.00	87,388.00	

ANTERO MIDS 5.75% 1/15/28 144A	185,000.00	175,078.45	
ANTOFAGASTA PLC 2.375% 10/14/30 144A	200,000.00	154,750.00	
ARCHES BUYER 6.125% 12/01/28 144A	40,000.00	32,672.00	
ARCHROCK PR 6.25% 4/1/28 144A	185,000.00	162,091.45	
ARCONIC ROLLED 6% 5/15/25 144A	110,000.00	110,138.60	
ARD FIN SA 6.5% 06/30/27 144A	185,000.00	133,200.00	
ASBURY AUTOMO 4.625% 11/15/29 144A	100,000.00	85,875.00	
ASBURY AUTOMO 5% 02/15/32 144A	100,000.00	85,845.00	
ASBURY AUTOMOTI 4.5% 03/01/28	54,000.00	48,803.58	
ASBURY AUTOMOTI 4.75% 03/01/30	52,000.00	44,590.00	
ASGN INC 4.625% 05/15/28 144A	445,000.00	395,413.65	
ASHTON WO 6.625% 01/15/28 144A	5,000.00	4,278.10	
ASHTON WOODS US 4.625% 08/01/2	100,000.00	74,000.00	
ASSUREDPARTNE 5.625% 01/15/29 144A	100,000.00	84,472.00	
ATLAS LUX 4.625% 06/01/28 144A	98,000.00	81,095.00	
AVANTOR FUNDING 3.875% 11/01/29	155,000.00	139,112.50	
AVANTOR FUNDING 4.625% 07/15/28 144A	235,000.00	222,838.75	
AVIS BUDGET 5.375% 03/01/29 144A	115,000.00	101,842.85	
AVOLON HLD 4.375% 5/01/26 144A	2,000.00	1,838.20	
AVOLON HLDGS 2.528% 11/27 144A	314,000.00	253,997.74	
AVOLON HLDGS 3.95% 7/24 144A	2,000.00	1,908.30	
AXIAN TELECOM 7.375% 02/16/27 144A	200,000.00	178,000.00	

AZUL INVEST 5.875% 10/27 144A	225,000.00	139,990.50	
AZUL INVTS LLP 7.25% 06/15/26 144A	200,000.00	120,374.00	
B2W DIGITAL 4.375% 12/30/30 144A	165,000.00	116,160.00	
BELLRING BRANDS 7% 3/30 144A	60,000.00	57,641.40	
BERRY GBL ES 4.875% 7/26 144A	120,000.00	116,100.00	
BERRY GBL ES 5.625% 7/27 144A	100,000.00	97,605.00	
BIDVST GR 3.625% 09/23/26 144A	200,000.00	172,600.00	
BIG RIV STL LLC 6.625% 01/31/2	416,000.00	403,582.40	
BIM LAND JSC 7.375% 5/26 RGS	200,000.00	157,474.00	
BOBOMBARDIER 7.125% 06/26 144A	240,000.00	209,232.00	
BOMBARDIER 7.875% 04/27 144A	630,000.00	553,612.50	
BOMBARDIER INC 6% 02/28 144A	245,000.00	198,756.25	
BOMBARDIER INC 7.5% 03/25 144A	389,000.00	367,605.00	
BOOZ ALLEN 3.875% 9/01/28 144A	170,000.00	154,739.10	
BOYD GAMING 4.75% 12/01/27	340,000.00	321,300.00	
BRAND ENERGY 8.5% 7/25 144A	920,000.00	733,700.00	
BUILDERS F 4.25% 02/01/32 144A	395,000.00	331,800.00	
C AND S GRP 5% 12/15/28 144A	130,000.00	97,207.50	
C&W SR FIN 6.875% 9/15/27 144A	455,000.00	399,490.00	
CA MAGNUM HLD 5.375% 10/31/26 144A	200,000.00	170,000.00	
CABLE ONDA 4.5% 01/30/30 144A	200,000.00	163,850.00	
CABLEVS LHT 5.625% 09/15/28 144A	70,000.00	54,840.80	
CABLEVS LT LLC 3.875% 9/15/27 144A	90,000.00	75,270.60	
CAESARS E 8.125% 07/01/27	845,000.00	837,716.10	

CAESARS ENTERTA 4.625% 10/15/29 144A	195,000.00	164,283.60	
CALIFORNIA 7.125% 02/01/26 144A	295,000.00	279,376.80	
CAMELOT FIN SA 4.5% 11/26 144A	175,000.00	163,248.75	
CAMPOSOL SA 6% 02/03/2027 144A	275,000.00	220,651.75	
CARLYLE AVIAT 7% 10/15/24 RGS	160,000.00	90,948.80	
CARNIVAL COR 5.75% 3/1/27 144A	405,000.00	308,812.50	
CARNIVAL CORP 0% 01/31/26 144A	240,000.00	244,200.00	
CARNIVAL CORP 9.875% 08/01/27 144A	640,000.00	638,035.20	
CARVANA CO 4.875% 09/01/29 144A	110,000.00	63,339.10	
CATALENT PHARM 5% 6/30/27 144A	70,000.00	67,272.10	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 04/33 144A	320,000.00	272,320.00	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 05/01/32	145,000.00	124,294.00	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 08/30 144A	390,000.00	343,200.00	
CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144	420,000.00	409,122.00	
CDI ESCROW ISSU 5.75% 04/01/30 144A	290,000.00	277,266.10	
CEC ENT CO LLC 6.75% 5/26 144A	160,000.00	147,200.00	
CEMEX SAB 5.125/VAR PERP 144A	200,000.00	156,500.00	
CENTENE CORP 3.375% 2/15/30 WI	155,000.00	136,981.25	
CENTENE CORP 4.625% 12/15/29	290,000.00	275,616.00	
CENTRAL GARDEN 4.125% 10/15/30	115,000.00	96,600.00	
CHARLES RIV 4.25% 5/1/28 144A	55,000.00	51,155.50	
CHARLES RIVER L 3.75% 03/15/29 144A	55,000.00	49,273.40	
CHARLES RIVER L 4% 03/15/31 144A	160,000.00	142,600.00	
CHEMOURS CO 5.75% 11/15/28 144A	245,000.00	223,787.90	



CHESAPEAKE 5.875% 2/01/29 144A	170,000.00	165,687.10	
CHS/CMNTY HEA 6.875% 04/15/29 144A	220,000.00	128,590.00	
CHS/CMNTY HEALT 4.75% 02/15/31 144A	225,000.00	169,875.00	
CHS/CMNTY HEALT 5.25% 05/15/30 144A	355,000.00	277,166.25	
CHS/CMNTY HEALT 6% 01/15/29 144A	175,000.00	147,320.25	
CHS/CMNTY HEALT 6.125% 04/01/30 144A	415,000.00	234,475.00	
CHS/CMNTY HEALTH 8% 3/26 144A	350,000.00	325,255.00	
CHS/CMNTY HLT 5.625% 03/15/27 144A	170,000.00	150,025.00	
CITGO HLDG INC 9.25% 08/01/24 144A	210,000.00	203,700.00	
CITGO PETE COR 7% 6/15/25 144A	410,000.00	394,112.50	
CITGO PETROL 6.375% 06/26 144A	205,000.00	192,700.00	
CLEAR CHAN 7.75% 04/15/28 144A	110,000.00	83,960.80	
CLEARWY ENR 4.75% 3/15/28 144A	110,000.00	104,318.50	
CLEVELAND-CLIF 4.625% 3/1/29 144A	115,000.00	104,650.00	
CLEVELAND-CLIF 4.875% 3/1/31 144A	115,000.00	104,506.25	
CLYDESDALE ACQU 6.625% 3/29 144A	70,000.00	68,600.00	
CLYDESDALE ACQUI 8.75% 03/30 144A	425,000.00	369,218.75	
CNX RESOURCES C 6% 01/15/29 144A	85,000.00	79,475.00	
COGENT COMM 3.5% 05/01/26 144A	125,000.00	116,410.00	
COINBASE GLOBAL 3.375% 10/01/28 144A	680,000.00	447,950.00	
COINBASE GLOBAL 3.625% 10/01/31	410,000.00	244,220.60	
COLGATE ENERGY 5.875% 07/01/29	185,000.00	160,025.00	
COMMERCIAL META 3.875% 02/15/31	90,000.00	72,154.80	

COMSTOCK 5.875% 01/15/30 144A	115,000.00	102,030.30	
COMSTOCK RESO 6.75% 03/29 144A	265,000.00	246,977.35	
CONSLIDATED COM 5% 10/28 144A	100,000.00	76,905.00	
CORECIVIC INC 0% 04/30/26	265,000.00	259,339.60	
CORPORACION NA 3.75% 1/31 144A	200,000.00	180,000.00	
COVERT M 4.875% 12/01/29 144A	95,000.00	79,087.50	
CQP HOLDCO 5.5% 06/15/31 144A	530,000.00	483,625.00	
CRESTWOOD M P/F 6% 02/01/29 144A	580,000.00	498,800.00	
CROCS INC 4.125% 08/15/31 144A	175,000.00	127,312.50	
CROCS INC 4.25% 03/15/29 144A	115,000.00	89,455.05	
CROWDSTRIKE HOL 3% 02/15/29	205,000.00	184,157.65	
CROWNROCK LP / 5% 05/1/29 144A	60,000.00	53,626.80	
CSC HLDGS LLC 3.375% 02/15/31 144A	230,000.00	181,299.80	
CSC HLDGS LLC 4.125% 12/01/30 144A	170,000.00	139,632.90	
CSC HLDGS LLC 4.5% 11/15/31 144A	160,000.00	130,096.00	
CSC HOLDINGS 7.5% 4/1/28 144A	690,000.00	607,200.00	
CT TRUST 5.125% 02/03/32 144A	200,000.00	162,700.00	
CVR ENERGY 5.25% 2/15/25 144A	370,000.00	345,036.10	
CVR ENERGY 5.75% 02/15/28 144A	250,000.00	220,000.00	
CVR PART LP/FIN 6.125% 06/15/28 144A	220,000.00	195,364.40	
DAE FDG LLC 1.55% 08/01/24 144A	200,000.00	186,500.00	
DANA INC 4.25% 09/01/30	105,000.00	84,362.25	
DANA INC 5.625% 6/15/28	160,000.00	142,459.20	

DARLING INGRED 6% 6/15/30 144A	75,000.00	76,406.25	
DAVITA INC 0% 05/31/30 144A	480,000.00	383,380.80	
DAVITA INC 3.75% 02/15/31 144A	175,000.00	128,800.00	
DCP MIDSTR 5.85% 5/21/43 144A	185,000.00	154,937.50	
DCP MIDSTREAM 5.125% 05/15/29	320,000.00	300,000.00	
DCP MIDSTREAM 5.625% 07/15/27	145,000.00	142,823.55	
DELEK LOGISTIC 7.125% 06/01/28 144A	110,000.00	96,800.00	
DIAMOND B 4.625% 10/01/29 144A	75,000.00	59,191.50	
DIAMOND SPORT 5.375% 08/15/26	220,000.00	47,300.00	
DISH DBS 5.25% 12/1/26 144A	100,000.00	79,250.00	
DISH DBS 5.75% 12/01/28 144A	100,000.00	76,262.00	
DISH NETWK CV 3.375% 8/26 144A	1,460,000.00	1,000,100.00	
DP WORLD CRESC 3.875% 7/29 RGS	400,000.00	370,000.00	
DPL INC 4.35% 04/15/29	529,000.00	462,875.00	
DT MIDSTREAM 4.125% 06/15/29 144A	185,000.00	162,668.65	
DT MIDSTREAM 4.375% 06/15/31 144A	185,000.00	157,775.40	
EG GLOBAL 8.5% 10/30/25 144A	115,000.00	110,687.50	
EG GLOBAL FINANCE PLC 6.75% 02	670,000.00	628,125.00	
EIG PEARL HOLDI 3.545% 08/31/36 144A	200,000.00	169,250.00	
ELASTIC 4.125% 07/15/29 144A	90,000.00	78,435.00	
EMBRAER NETHER 5.05% 6/15/25	150,000.00	145,033.50	
EMERGENT BIO 3.875% 08/15/30 144A	110,000.00	79,329.80	
EMIRATES NBD PJ VAR PERP REGS	200,000.00	182,000.00	
ENDEAVOR ENERGY 5.75 1/28 144A	375,000.00	371,587.50	

ENDEAVOUR MI 5% 10/14/26 144A	200,000.00	156,536.00	
ENER 4.875% 3/30/26 144A RGS	125,000.00	111,562.50	
ENFRAGEN ENERG 5.375% 12/30/30 144	230,000.00	151,800.00	
ENLINK MID 5.625% 01/15/28 144A	75,000.00	70,767.00	
ENN CLEAN ENE 3.375% 5/26 144A	200,000.00	180,776.00	
ENVIVA PT LP 6.5% 1/15/26 144A	250,000.00	243,437.50	
EQT CORP 5% 01/15/29	175,000.00	168,768.25	
EQT MIDSTR 6.5% 07/01/27 144A	215,000.00	205,643.20	
ERO COPPER 6.5% 2/15/30 144A	535,000.00	364,800.45	
FERRELLGAS/FG 5.375% 04/01/26 144A	135,000.00	121,170.60	
FERTITTA ENTERT 4.625% 01/15/29 144A	210,000.00	185,325.00	
FERTITTA ENTERT 6.75% 07/15/30 144A	365,000.00	292,000.00	
FIRST QUANT 6.875% 10/27 144A	585,000.00	533,812.50	
FIRST QUANTUM 6.875% 3/26 144A	305,000.00	283,268.75	
FMG RES AG 5.875% 4/15/30 144A	285,000.00	265,762.50	
FMG RES AUG LTD 4.375% 04/01/31 144A	120,000.00	100,920.00	
FORD MOTOR 3.25% 02/12/32	300,000.00	236,568.00	
FORD MTR CR 5.125% 6/16/25	515,000.00	507,228.65	
FORD MTR CR LLC 2.9% 02/16/28	155,000.00	129,646.65	
FORD MTR CR LLC 3.375% 11/13/25	115,000.00	106,789.00	
FORD MTR CR LLC 4% 11/13/30	115,000.00	98,859.75	
FORD MTR CR LLC 4.95% 05/28/27	355,000.00	338,204.95	
FREEPOR T INDONE 5.315% 04/14/32 144A	200,000.00	172,500.00	

FREEMPORT MCMORAN INC5.4% 11/34	80,000.00	76,828.00	
FRONT RANGE BID 4% 3/1/27 144A	300,000.00	257,439.00	
FRONT RANGE BIDCO INC 6.125% 0	165,000.00	123,750.00	
FRONTIER 5.875% 11/01/29 144A	52,213.00	42,553.59	
FRONTIER COM 5.875% 10/15/27 144A	170,000.00	162,350.00	
FRONTIER COMM 5% 05/01/28 144A	175,000.00	159,089.00	
FRONTIER COMM 6% 01/31/30 144A	205,000.00	169,125.00	
FRONTIER COMM 6.75% 05/01/29 144A	195,000.00	168,187.50	
FRONTIER COMM 8.75% 05/15/30 144A	140,000.00	146,300.00	
GALAXY PIPE 2.625% 03/31/36 144A	200,000.00	162,350.00	
GANNETT HOLDING 6% 11/01/26 144A	95,000.00	78,850.00	
GEMS MENAS 7.125% 7/31/26 144A	1,015,000.00	944,772.15	
GENESIS ENERGY LP 8% 01/15/27	200,000.00	176,324.00	
GENM CAPITAL LA 3.882% 04/19/3	200,000.00	147,912.00	
GEO GROUP 5.125% 4/1/23 WI	125,000.00	118,750.00	
GEO GROUP INC 5.875% 10/15/24	50,000.00	45,000.00	
GEO GROUP INC 6% 04/15/26	445,000.00	364,406.05	
GEOPARK LTD 5.5% 01/17/27 144A	200,000.00	159,786.00	
GEOPARK LTD 6.5% 09/24 144A	200,000.00	202,724.00	
GEORGIA BK 11.125/VAR PERP RGS	250,000.00	245,000.00	
GLOBAL PARTNER 6.875% 01/15/29	175,000.00	149,360.75	
GO DADDY OP 5.25% 12/1/27 144A	170,000.00	163,625.00	
GPC MERGER SU 7.125% 8/15/28 144A	100,000.00	83,025.00	
GRAN CO 6.875% 08/09/26 144A	200,000.00	147,520.00	
GRAPHIC PACK 3.75% 02/30 144A	80,000.00	69,018.40	

H&E EQUIPMENT S 3.875% 12/15/28	285,000.00	235,293.15	
HARVEST MIDSTRE 7.5% 9/28 144A	400,000.00	375,000.00	
HCA INC 5.625% 09/01/28	305,000.00	303,209.65	
HCA INC 5.875% 02/01/2029	130,000.00	131,726.40	
HEALTH EQUITY INC 4.5% 10/01/29 144A	70,000.00	63,350.00	
HERTZ 4.625% 12/01/26 144A	115,000.00	98,256.00	
HERTZ 5% 12/01/29 144A	150,000.00	121,860.00	
HERTZ 5.5% 10/15/24 144A	210,000.00	262.50	
HERTZ CORP 6% 01/15/2028 144A	265,000.00	15,568.75	
HERTZ CORP 6.25% 10/15/22	190,000.00	237.50	
HERTZ CORP 7.125% 08/01/2026 1	265,000.00	15,237.50	
HESS MIDST 5.125% 6/15/28 144A	220,000.00	199,100.00	
HESS MIDSTREAM 5.5% 10/30 144A	60,000.00	54,473.40	
HIGHTOWER 6.75% 04/15/29 144A	70,000.00	53,773.30	
HILTON DOMEST 3.625% 02/15/32 144A	115,000.00	96,111.25	
HILTON DOMESTIC 3.75% 05/01/29	115,000.00	100,822.80	
HILTON DOMESTIC 4% 05/01/31 144A	115,000.00	99,190.95	
HTA GROUP LTD/M 7% 12/18/25 14	200,000.00	169,350.00	
HUB INTE 5.625% 12/01/29 144A	135,000.00	119,113.20	
HUB INTEL LTD 7% 5/01/26 144A	260,000.00	254,150.00	
HUBBAY MINERAL 6.125% 4/01/29 144A	330,000.00	256,575.00	
ICAHN LP/FN COR 5.25% 05/15/27	435,000.00	401,287.50	
ICAHN LP/FN COR 6.375% 12/15/2	500,000.00	489,540.00	
IHS HOLDING LTD 5.625% 11/29/2	200,000.00	162,912.00	

IHS NETHERLAND 8% 9/18/27 144A	200,000.00	171,286.00	
II-VI INC 5% 12/15/29 144A	100,000.00	91,500.00	
INDONESIA ASA 5.45% 05/30 144A	200,000.00	183,100.00	
INFRABUILD AUST 12% 10/24 144A	450,000.00	421,200.00	
INTELSAT J H SA 5.5% 08/01/23	575,000.00	-	
INTELSAT JACKS 8.5% 10/24 144A	120,000.00	-	
INTELSAT JACKSN 6.5% 1/30 144A	765,000.00	659,537.10	
INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	5,535,000.00	5,285,925.00	
INVESTMENT EGY 6.25% 4/29 144A	200,000.00	175,000.00	
JACOBS ENT 6.75% 02/15/29 144A	90,000.00	74,169.00	
JOSEPH T RYER 8.5% 8/1/28 144A	99,000.00	101,945.25	
KAZAKHSTAN TEMR 6.95 7/42 144A	100,000.00	82,750.00	
KAZMUNAYGAS 3.5% 04/14/33 144A	200,000.00	131,500.00	
KEHE DISTRS LLC / KEHE FIN COR	136,000.00	135,456.00	
KENNEDY-WILSON 4.75% 03/01/29	170,000.00	143,650.00	
KENNEDY-WILSON 5% 03/01/31	170,000.00	138,975.00	
KFC CO/PIZZA 4.75% 6/1/27 144A	255,000.00	247,620.30	
KLX ENERGY 11.5% 11/1/25 144A	245,000.00	147,284.20	
KOBE US MID PIK VAR 11/26 144A	395,000.00	343,650.00	
KONDOR FIN 7.625% 11/26 144A	200,000.00	39,912.00	
KOSMOS ENERGY 7.125% 4/26 144A	335,000.00	268,793.95	
KRAFT HEINZ CO 4.375% 6/1/46	50,000.00	42,607.00	
KRAFT HEINZ FD 4.875% 10/01/49	255,000.00	230,785.20	
KRAFT HEINZ FD 5.5% 06/01/50	70,000.00	69,094.20	
KRONOS ACQ 7% 12/31/27 144A	50,000.00	36,989.50	

KRONOS ACQ K 5% 12/31/26 144A	40,000.00	33,897.20	
L BRANDS INC 6.625% 10/01/30 144A	350,000.00	319,931.50	
LAMAR FDG LTD 3.958% 5/25 144A	40,000.00	37,670.00	
LAMAR MEDIA CRP 4.875% 01/15/2	140,000.00	130,671.80	
LAMB WESTON 4.125% 01/30 144A	155,000.00	139,475.20	
LCM INVESTMENTS 4.875% 05/01/29 144A	260,000.00	211,900.00	
LCPR SENIOR 5.125% 7/29 144A	400,000.00	337,304.00	
LCPR SR 6.75% 10/15/27 144A	180,000.00	166,548.60	
LENOVO GROUP LT 3.421% 11/02/30 144A	200,000.00	166,662.00	
LEVEL 3 FIN 3.75% 07/15/29 144A	295,000.00	239,351.20	
LEVEL 3 FINANCI 4.25% 07/01/28	230,000.00	194,554.70	
LEVIATHAN 6.125% 6/30/25 144A	275,000.00	261,775.25	
LINDBLAD E 6.75% 02/15/27 144A	155,000.00	132,176.25	
LIQUID TELECOMM 5.5% 09/26 144A	200,000.00	174,912.00	
LIVE NATIN 4.75% 10/15/27 144A	230,000.00	212,462.50	
LSB INDUS 6.25% 10/15/28 144A	30,000.00	26,325.00	
MACYS RTL HLDG 5.875% 03/15/30	60,000.00	51,000.00	
MACYS RTL HLDG 6.125% 03/15/32	75,000.00	62,208.75	
MADISON IAQ 4.125% 06/28 144A	130,000.00	111,150.00	
MADISON IAQ 5.875% 6/29 144A	200,000.00	148,500.00	
MAGIC MERG 5.25% 05/1/28 144A	170,000.00	137,196.80	
MAGIC MERG 7.875% 05/1/29 144A	255,000.00	171,806.25	
MAGNOLIA OIL & GAS OPER LLC /	255,000.00	236,759.85	
MATTEL INC 3.375% 04/01/26 144A	55,000.00	51,646.65	



MC BRAZIL DWNST 7.25% 06/31 144A	685,000.00	512,243.00	
MEDCO BELL PTE 6.375% 01/30/27	340,000.00	268,600.00	
MEG ENERGY CRP 5.875% 02/01/29 144A	255,000.00	236,158.05	
MEITUAN 3.05% 10/28/30 144A	200,000.00	143,792.00	
MEITUAN D 2.125% 10/28/25 144A	200,000.00	177,956.00	
MESQUITE 15% PIK CONV 7/23 PP	88,219.00	441,095.00	
MESQUITE 15% PIK CONV 7/23 PP	151,436.00	689,033.80	
MGIC INVT CORP 5.25% 08/15/28	125,000.00	116,401.25	
MICROSTRATEGY 6.125% 06/15/28	490,000.00	415,309.30	
MILEAGE PLUS 6.5% 6/20/27 144A	180,000.00	179,233.20	
MILLICOM INTL 4.5% 04/27/31 144A	200,000.00	157,000.00	
MINERAL RES 8.5% 5/1/30 144A	45,000.00	43,220.25	
MINERAL RES LT 8% 11/1/27 144A	180,000.00	172,825.20	
MINERVA MERGE 6.5% 02/15/30 144A	610,000.00	524,600.00	
MISC CAPITAL T 3.75% 4/27 144A	200,000.00	186,394.00	
MIWD HOLDCO II 5.5% 02/01/30 144A	40,000.00	32,398.40	
MOLINA HEA 4.375% 6/15/28 144A	120,000.00	111,900.00	
MOLINA HEALTHCA 3.875% 11/15/30 144A	170,000.00	151,300.00	
MONG DUONG FI 5.125% 5/29 144A	140,000.00	107,520.00	
MOOG INC 4.25% 12/15/2027 144A	55,000.00	49,775.00	
MOZART DEBT 3.875% 04/01/29 144A	315,000.00	277,407.90	
MUMTALAKAT 4.1% 01/21/27 RGS	200,000.00	192,000.00	
MURPHY OIL USA 3.75% 02/15/31 144A	75,000.00	65,742.75	
MURPHY OIL USA INC 4.75% 09/15	120,000.00	112,800.00	

NAGACORP 7.95% 07/06/24 RGS	200,000.00	177,350.00	
NATURA COSME 4.125% 5/28 144A	200,000.00	156,624.00	
NAVIOS LOG/FI 10.75% 7/25 144A	150,000.00	135,187.50	
NAVIOS MARIT 11.25% 8/22 144A	31,000.00	30,070.00	
NBM US HO 6.625% 08/06/29 144A	105,000.00	97,440.00	
NCL CORP 5.875% 02/15/27 144A	200,000.00	177,506.00	
NCL CORP 7.75% 02/15/29 144A	180,000.00	139,500.00	
NCL CORP LTD 5.875 03/15/26 144A	55,000.00	44,402.60	
NCL FINANCE LTD 6.125% 03/15/28 144A	70,000.00	53,281.90	
NESCO HOLDING 5.5% 04/15/29 144A	135,000.00	113,400.00	
NEW COTAI LLC CONV 5% 2/24/27	194,718.69	165,510.87	
NEW FORTRESS EN 6.75% 09/15/25	175,000.00	167,426.00	
NEW HOME CO 7.25% 10/15/25 144A	115,000.00	93,348.95	
NEXA RESOURCES 6.5% 01/18/28 1	200,000.00	186,162.00	
NEXSTAR 5.625% 7/15/27 144A	220,000.00	212,300.00	
NEXTERA ENERGY 4.25% 9/24 144A	21,000.00	20,370.00	
NGL ENERGY OP 7.5% 02/01/26 144A	575,000.00	513,791.25	
NIELSEN FIN 5.875% 10/01/30 144A	175,000.00	164,937.50	
NIELSEN FINAN 5.625% 10/01/28 144A	175,000.00	165,667.25	
NORTHWEST FIN 10.75% 06/01/28 144A	95,000.00	83,837.50	
NORTHWEST FIN 4.75% 04/30/27 144A	115,000.00	98,581.45	
NORTHWEST FIN 6% 02/15/28 144A	60,000.00	43,774.80	
NOSTRUM OIL 8% 7/25/22 144A	805,000.00	191,839.55	

NRG ENERGY 5.25% 06/15/29 144A	185,000.00	169,837.40	
NRG ENERGY INC 3.875% 02/15/32 144A	100,000.00	81,500.00	
NRG ENERGY INC 6.625% 01/15/27	451,000.00	452,127.50	
NTH OIL & GAS 8.125% 03/01/28 144A	270,000.00	248,672.70	
OCCIDENTAL PETE 4.5% 07/15/44	65,000.00	52,812.50	
OCCIDENTAL PETE 5.5% 12/01/25	115,000.00	115,623.30	
OCCIDENTAL PETE 5.55% 03/15/26	212,000.00	214,120.00	
OCCIDENTAL PETE 5.875% 9/01/25	115,000.00	117,041.25	
OCCIDENTAL PETE 6.2% 03/15/40	75,000.00	75,562.50	
OCCIDENTAL PETE 6.45% 09/15/36	130,000.00	137,475.00	
OCCIDENTAL PETE 6.6% 03/15/46	170,000.00	183,554.10	
OCCIDENTAL PETE 6.95% 07/01/24	195,000.00	204,215.70	
OCCIDENTAL PETE 7.5% 05/01/31	725,000.00	819,308.00	
OCCIDENTAL PETR 6.375% 9/01/28	175,000.00	183,750.00	
OCCIDENTAL PETRO 4.3% 08/15/39	70,000.00	58,100.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM 4.4% 4/46	137,000.00	113,367.50	
OCCIDENTL PETE 8.875% 07/15/30	450,000.00	528,624.00	
OIL & GAS HLDG 7.5% 10/27 144A	485,000.00	456,632.35	
OLEODUCTO CENT 4% 7/14/27 144A	200,000.00	165,536.00	
ON SEMICONDUCT 3.875% 09/01/28 144A	215,000.00	194,508.35	
OORED00 2.625% 04/08/31 144A	200,000.00	174,250.00	
OPEN TEXT 4.125% 2/15/30 144A	245,000.00	220,193.75	
OPEN TEXT CORP 3.875% 12/01/29 144A	145,000.00	126,150.00	

OPEN TEXT HOLDI 4.125% 12/01/31 144A	145,000.00	126,310.95	
OPTION CARE HEA 4.375% 10/31/29	70,000.00	62,475.00	
ORGANON F 4.125% 04/30/28 144A	215,000.00	199,143.75	
ORGANON FINAN 5.125% 04/30/31 144A	215,000.00	196,456.25	
OWENS MINOR INC 6.625% 04/30 144A	245,000.00	234,533.60	
PACIFIC GAS & ELEC 3.95% 12/47	165,000.00	114,919.20	
PACIFIC GAS &ELE 3.75% 8/15/42	30,000.00	20,452.50	
PAO TMK 4.3% 02/12/27 RGS	200,000.00	30,000.00	
PAPA JOHNS IN 3.875% 09/15/29 144A	60,000.00	51,912.00	
PBF HLD LLC/FIN 6% 02/15/28	425,000.00	361,250.00	
PBF HLDG / FIN 7.25% 06/15/25	250,000.00	237,500.00	
PECF USS INTERM 8% 11/29 144A	55,000.00	43,450.00	
PENINSULA 8.5% 11/15/27 144A	210,000.00	223,650.00	
PERFORMANCE FO 4.25% 08/01/29 144A	95,000.00	82,987.25	
PETRONAS CAP 4.8% 4/21/60 144A	200,000.00	193,036.00	
PETRONAS CAP LTD 3.5% 04/21/20	200,000.00	186,146.00	
PG&E 4.55% 07/01/30	1,177,500.00	1,052,579.02	
PG&E 4.95% 07/01/50	1,277,500.00	1,029,626.67	
PG&E CORP 5% 07/01/28	225,000.00	200,036.25	
PG&E CORP 5.25% 07/01/30	655,000.00	562,481.25	
PIKE CORP 5.5% 9/01/28 144A	445,000.00	377,137.50	
POLYONE CO 5.75% 5/15/25 144A	140,000.00	138,539.80	
PROSUS NV 4.027% 8/3/50 144A	200,000.00	126,286.00	
QORVO INC 4.375% 10/15/29	130,000.00	118,939.60	

RACKSPACE INC 5.375% 12/01/28 144A	100,000.00	69,324.00	
RADIATE HOLDC 6.5% 9/15/28 144A	350,000.00	265,125.00	
RADIOLOGY PAR 0% 01/31/28 144A	380,000.00	267,976.00	
REAL HERO 6.25% 02/01/29 144A	55,000.00	42,756.45	
REALOGY GR 5.25% 04/15/30 144A	260,000.00	205,361.00	
REALOGY GROUP 5.75% 01/15/29 144A	90,000.00	72,450.00	
RIVIAN 6ML+600 10/15/26 144A	670,000.00	603,000.00	
ROBLOX CO 3.875% 05/01/30 144A	390,000.00	331,960.20	
ROLLER BEARING 4.375% 10/15/29 144A	45,000.00	38,927.70	
ROLLS-ROYCE PLC 5.75% 10/15/27	175,000.00	159,134.50	
ROYAL CARI 11.5% 06/01/25 144A	96,000.00	99,840.00	
ROYAL CARI 5.375% 7/15/27 144A	140,000.00	101,627.40	
ROYAL CARI 9.125% 6/15/23 144A	260,000.00	262,600.00	
ROYAL CARIBBEAN 4.25% 07/01/26 144A	315,000.00	230,737.50	
ROYAL CARIBBEAN 5.5% 08/31/26	310,000.00	231,210.40	
RP ESCROW ISS 5.25% 12/15/25 144A	160,000.00	137,576.00	
RURAL/METRO C 10.125 7/19 REGS	10,000.00	-	
SABIC CAPITAL I 2.15% 09/14/30	200,000.00	168,500.00	
SABRE GLBL 9.25% 04/15/25 144A	135,000.00	133,562.25	
SABRE GLBL INC 7.375% 09/01/25 144A	175,000.00	165,375.00	
SASOL FING USA 4.375% 09/18/26	200,000.00	175,662.00	
SAUDI ARABIAN OIL 4.25% 04/39	915,000.00	848,662.50	
SCIH SALT 4.875% 05/01/28 144A	190,000.00	164,030.80	

SCIH SALT 6.625% 05/01/29 144A	125,000.00	102,953.75	
SCOTTS MIRACLE 4% 04/01/31	115,000.00	89,700.00	
SCRIPPS ESC I 3.875% 01/15/29 144A	160,000.00	136,800.00	
SCRIPPS ESC II 5.375% 01/15/31 144A	80,000.00	65,800.00	
SCRIPPS ESCRO 5.875% 7/27 144A	180,000.00	163,211.40	
SEASPAN CORPORA 5.5% 08/01/29 144A	260,000.00	192,992.80	
SEASPAN CORPORA 6.5% 4/26 144A	200,000.00	180,000.00	
SEG HLD LLC 5.625% 10/15/28 144A	175,000.00	157,739.75	
SENSATA TECHNOL 4% 04/15/29 14	190,000.00	169,100.00	
SERVICE CO INTL 5.125% 6/1/29	105,000.00	101,713.50	
SIMMONS FOOD IN 4.625% 03/29 144A	115,000.00	98,047.85	
SM ENERGY CO 6.5% 07/15/28	65,000.00	61,059.70	
SM ENERGY CO 6.625% 1/15/27	190,000.00	183,350.00	
SM ENERGY CO 6.75% 09/15/26	210,000.00	204,813.00	
SOUTHWESTERN EN 4.75% 02/01/32	155,000.00	138,379.35	
SOUTHWESTERN EN 5.375% 02/29	350,000.00	331,471.00	
SOUTHWESTERN EN 8.375% 9/15/28	175,000.00	183,750.00	
SPA HOLDINGS 4.875% 2/28 144A	135,000.00	109,541.70	
SPIRIT LOYALT 8% 09/20/25 144A	125,663.00	129,432.89	
SPRINGLEAF CORP 4% 09/15/30	205,000.00	159,889.75	
SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32	1,435,000.00	1,782,987.50	
SQUARE INC 2.75% 06/01/26 144A	190,000.00	172,314.80	
SQUARE INC 3.5% 06/01/31 144A	190,000.00	158,986.30	

SRS DISTRIBUTIO 4.625% 07/01/28 144A	135,000.00	121,589.10	
SRS DISTRIBUTIO 6% 12/01/29 144A	115,000.00	96,600.00	
SRS DISTRIBUTIO 6.125% 07/01/29 144A	75,000.00	64,125.75	
STATION CAS LLC 4.625% 12/01/31 144A	250,000.00	208,042.50	
STERICYCL 3.875% 01/15/29 144A	115,000.00	100,780.25	
STILLWATER MIN 4% 11/16/26 144	200,000.00	162,980.00	
STUDIO CITY 6.5% 1/15/28 144A	355,000.00	166,850.00	
STUDIO CITY CO 7% 02/27 144A	160,000.00	127,200.00	
SUEK SECURITI 3.375% 9/15/26 144A	200,000.00	10,000.00	
SUNOCO LP /CORP 4.5% 05/15/29	160,000.00	136,408.00	
SUNOCO LP /CORP 6% 04/15/27	520,000.00	497,343.60	
SUPERIOR PLUS 4.5% 03/15/29 144A	125,000.00	109,353.75	
SURGERY CTR 10% 04/15/27 144A	195,000.00	187,593.90	
SYNAPTICS INC 4% 06/15/29 144A	90,000.00	75,487.50	
T-MOBILE USA IN 3.5% 03/31/31	135,000.00	121,331.25	
TALLGRASS LP 6% 12/31/30 144A	175,000.00	154,014.00	
TAYLOR MOR 5.875% 6/15/27 144A	165,000.00	161,007.00	
TAYLOR MORRISON CMNTY/ MONARCH	240,000.00	222,300.00	
TEGNA INC 5% 09/15/29	445,000.00	430,541.95	
TEMPUR SEALY 3.875% 10/15/31 1	170,000.00	131,719.40	
TEMPUR SEALY 4% 04/15/29 144A	180,000.00	149,400.00	
TENCENT HLD 2.39% 6/3/30 144A	200,000.00	165,224.00	
TENET HEALTH 4.25% 06/01/29 144A	470,000.00	422,703.90	

TENET HEALTH 4.375% 01/15/30 144A	450,000.00	402,750.00	
TENET HEALTH 6.125% 06/15/30 144A	230,000.00	224,726.10	
TENET HEALTH 6.125% 10/01/28 144A	755,000.00	696,004.30	
TENET HEALTH 6.875% 11/15/31	25,000.00	22,852.50	
TENGIZCHEVR 3.25% 8/15/30 144A	150,000.00	105,000.00	
TERMOCANDELARIA POWER LTD 7.87	195,500.00	171,465.23	
TERRIER M 8.875% 12/15/27 144A	245,000.00	186,812.50	
THOR INDUSTRIES 4% 10/15/29 144A	215,000.00	173,612.50	
TINKOFF CREDIT VAR PERP 144A	200,000.00	60,000.00	
TKC HOLDIN 10.5% 05/15/29 144A	190,000.00	159,638.00	
TOPS MARKETS CORP ESCROW	1,325,000.00	-	
TRANSDIGM INC 5.5% 11/15/27	895,000.00	808,856.25	
TRANSOCEAN 5.375% 5/15/23 144A	183,099.65	173,029.16	
TREEHOUSE FOODS 4% 09/01/28	60,000.00	51,706.80	
TRI POINTE GROUP 5.7% 06/15/28	55,000.00	49,974.65	
TRITON WAT 6.25% 04/01/29 144A	80,000.00	58,278.40	
TRIVIUM PACKING 5.5% 8/26 144A	125,000.00	118,750.00	
TRONOX INC 4.625% 03/15/29 144A	170,000.00	139,869.20	
TTM TECH INC 4% 03/01/29 144A	170,000.00	144,710.80	
TULLOW OI 10.25% 05/15/26 144A	570,000.00	524,400.00	
TULLOW OIL 7% 03/01/25 144A	395,000.00	311,062.50	
TV AZTECA SAB 8.25% 8/9/24 RGS	400,000.00	160,000.00	
TWILIO INC 3.875% 03/15/31	140,000.00	121,259.60	
TWITTER INC 5% 03/01/30 144A	300,000.00	290,649.00	
UBER TECH I 7.5% 09/15/27 144A	185,000.00	182,963.15	



UBER TECH INC 4.5% 08/15/29 144A	870,000.00	731,478.60	
UBER TECH INC 6.25% 01/15/28 144A	150,000.00	141,000.00	
UNISYS 6.875% 11/01/27 144A	95,000.00	88,836.40	
UNITED AIRLIN 4.625% 04/30/29 144A	105,000.00	94,468.50	
UNITI GRP/UNI 6% 01/15/30 144A	465,000.00	307,453.35	
UNITI/FIN 4.75% 04/15/28 144A	145,000.00	121,657.90	
UNITI/FIN/CSL 6.5% 02/15/29 144A	260,000.00	183,950.00	
UNIVISION 6.625% 06/01/27 144A	340,000.00	333,625.00	
UNIVISION COM 7.375% 06/30/30 144A	80,000.00	79,380.00	
US AWYS 12-2 A 4.625% 12/03/26	18,035.36	16,442.47	
US FOODS INC 4.625% 06/01/30 144A	75,000.00	66,225.75	
US FOODS INC 4.75% 02/15/29 144A	245,000.00	226,470.65	
USA COMPRESSIO 6.875% 04/01/26	100,000.00	91,755.00	
USIMINAS INTL 5.875% 7/26 144A	145,000.00	136,236.20	
USIS MERGER 6.875% 05/25 144A	405,000.00	387,840.15	
VAIL RESORT 6.25% 05/15/2025 144A	100,000.00	100,718.00	
VALARIS 12%/VAR 04/30/28 144A	60,000.00	58,335.60	
VALEANT PHARM 5.5% 11/25 144A	145,000.00	129,412.50	
VALEANT PHARMA 9.25% 4/26 144A	140,000.00	99,094.80	
VALVOLINE INC 4.25% 2/30 144A	125,000.00	110,312.50	
VENTURE GLOBAL 3.875% 08/15/29 144	155,000.00	140,275.00	
VENTURE GLOBAL 4.125% 08/15/31 144A	155,000.00	139,310.90	
VICTORIA'S 4.625% 07/29 144A	120,000.00	97,404.00	

	VIKING CRUIS 13% 05/15/25 144A	150,000.00	156,348.00	
	VIPER ENER 5.375% 11/1/27 144A	85,000.00	81,962.95	
	VISTAJET MAL/XO 6.375% 02/01/30 144A	310,000.00	255,049.40	
	VOLCAN CO 4.375% 02/11/26 144A	55,000.00	45,257.85	
	VTR COMMUN 5.125% 1/15/28 144A	78,000.00	47,034.00	
	VTR COMMUNICACI 4.375% 04/15/2	100,000.00	56,750.00	
	VZ SECURED FINA 5% 01/15/32 14	500,000.00	434,305.00	
	WALTER ENERGY 9.5% 10/19 144A	735,000.00	-	
	WASH MULT 5.75% 4/15/26 144A	115,000.00	110,112.50	
	WEEKLEY HOMES L 4.875% 09/15/28	80,000.00	64,164.80	
	WESTERN GLO 10.375% 8/25 144A	185,000.00	172,980.55	
	WINDSTREA 7.75% 08/15/28 144A	725,000.00	618,860.00	
	WINNEBAGO IND 6.25% 7/28 144A	145,000.00	134,670.20	
	WOLVERINE 8.5% 11/24 144A	124,000.00	64,480.00	
	WP ROCKET MRGR 10.125 7/19 REG	15,000.00	-	
	WR GRACE 4.875% 06/15/27 144A	215,000.00	191,350.00	
	WR GRACE HLG 5.625% 08/29 144A	165,000.00	126,225.00	
	WYNN RESORTS LTD 7.75% 04/15/2	365,000.00	359,247.60	
	YUM BRANDS INC 4.625% 01/31/32	195,000.00	179,400.00	
	ZIGGO BOND CO 5.125% 02/28/30 144A	90,000.00	73,800.00	
	ZIGGO BV 4.875% 01/15/2030 144	135,000.00	118,704.15	
	アメリカ・ドル 小計	127,370,884.70	107,545,850.78 (14,859,610,202)	
社債券 合計			14,859,610,202 (14,859,610,202)	
合計			34,979,213,040 (34,096,532,624)	

（注）新株予約権証券における券面総額の数値は証券数を表示しております。

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株 予約権証券 時価比率	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 23銘柄	2.47%	-%	-%	87.33%
	新株予約権証券 4銘柄	-%	0.31%	-%	
	国債証券 138銘柄	-%	-%	43.29%	
	地方債証券 2銘柄	-%	-%	0.14%	
	特殊債券 58銘柄	-%	-%	4.96%	
	社債券 528銘柄	-%	-%	48.83%	
イギリス・ポンド	国債証券 2銘柄	-%	-%	100%	2.53%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	-%	-%	100%	2.55%
ユーロ	国債証券 4銘柄	-%	-%	100%	7.59%

## 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	ACRISURE TERM B 1LN 02/15/27 C1	14,925.00	99.24 14,812.91	94.62 14,122.78	690.13	-
	AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C1	22,814.22	99.03 22,594.74	95.62 21,816.09	778.65	-
	AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C2	11,485.78	99.03 11,375.28	95.62 10,983.27	392.01	-
	ALLIANT TERM B-2 1LN 05/10/25 C1	184,300.00	98.88 182,243.21	95.18 175,431.48	6,811.73	-
	ANASTASIA BEV TERM B 08/25 C1	247,531.34	85.08 210,609.56	76.79 190,084.26	20,525.30	-
	ASCEND LEARNING TM 2LN 11/29 C1	20,000.00	99.75 19,950.00	88.83 17,766.60	2,183.40	-
	ATHENAHEALTH TM B 1LN 02/15/29 C1	196,666.67	99.50 195,683.34	93.68 184,253.06	11,430.28	-
	AUTHENTIC BR TM B 2LN 12/20/29 C1	10,000.00	99.25 9,925.00	92.00 9,200.00	725.00	-
	CITGO HOLDING TM B 1LN 8/1/23 C1	24,133.08	99.24 23,951.35	98.10 23,674.55	276.80	-
	CONSOLIDATE TM INCR B 1LN 5/25 C1	415,800.00	96.50 401,247.00	96.25 400,207.50	1,039.50	-
	CSC SERVICEWORKS TM B 1LN 2/28 C1	113,562.50	100.00 113,562.50	90.93 103,271.46	10,291.04	-

EXAMWORKS TERM B 1LN 11/01/28 C1	19,950.00	99.50 19,850.25	96.00 19,152.00	698.25	-
FRST EAGLE TERM B 1LN 2/1/27 C1	80,685.92	98.33 79,342.49	93.31 75,290.45	4,052.04	-
GREAT OUTDOOR TM B1 1LN 3/5/28 C1	467,901.73	100.12 468,467.89	92.66 433,590.49	34,877.40	-
HUNTER DOUGLAS TERM B 1LN 2/29 C1	76,800.00	99.50 76,416.00	87.09 66,888.19	9,527.81	-
HUNTER DOUGLAS TERM B 1LN 2/29 C2	28,200.00	99.50 28,059.00	87.09 24,560.50	3,498.50	-
INFO RES TERM B 1LN 11/30/25 C1	295,717.05	99.78 295,090.12	98.85 292,316.30	2,773.82	-
INTERNET TM 1LN 09/15/2024 C1	34,734.17	99.74 34,646.63	95.95 33,327.43	1,319.20	-
MISYS LIMITED TERM 2LN 06/25 C1	115,000.00	100.69 115,796.95	86.11 99,027.65	16,769.30	-
MULTI-COLOR TM B 1LN 10/29/28 C1	368,150.00	98.49 362,624.06	91.75 337,777.62	24,846.44	-
PROJECT EPIC TRM B 1LN 3/1/26 C1	158,837.66	76.32 121,232.84	84.08 133,555.46	12,322.62	-
SANCHEZ DIP ROLL UP TL 5/11/20 C1	89,000.00	- -	- -	-	-
SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C1	108,722.08	- -	- -	-	-
SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C2	98,160.45	- -	- -	-	-
SCIENTIFIC GAME TM B 1LN 02/29 C1	30,000.00	99.75 29,925.00	94.64 28,393.80	1,531.20	-
SINCLAIR BROAD TM 1LN 05/26 C1	32,106.00	92.99 29,858.25	93.93 30,159.73	301.48	-
SOFTBANK SVF II TERM 1LN 12/24 C1	714,486.45	100.00 714,486.45	100.00 714,486.45	-	-
THE GOLUB CORPOR TM 2LN 05/26 C1	610,924.94	100.01 611,014.21	100.00 610,924.94	89.27	-
TRANSDIGM TERM G 1LN 08/22/24 C1	275,764.54	98.55 271,776.98	97.46 268,768.39	3,008.59	-
TRAVELPORT TERM 1LN 05/29/2026 C1	111,828.69	86.62 96,867.12	75.78 84,750.49	12,116.63	-
UKG TERM 1LN 5/3/26 C1	505,066.48	99.96 504,894.75	95.80 483,853.68	21,041.07	-
UKG TERM 2LN 05/03/2027 C1	40,000.00	100.00 40,000.00	94.54 37,816.80	2,183.20	-
ULTIMATE SOFTWARE TERM 1LN 5/26 C1	68,075.00	99.98 68,065.46	96.56 65,735.26	2,330.20	-
VEEAM SOFTWARE TERM B 1LN 2/27 C1	34,212.50	99.24 33,954.53	96.62 33,057.82	896.71	-

貸付債権 / アメリカ・ドル 小計		5,208,323.87 (719,634,109)	5,024,244.50 (694,199,863)	184,079.37 ( 25,434,246)	
貸付債権 合計		719,634,109 (719,634,109)	694,199,863 (694,199,863)	25,434,246 ( 25,434,246)	
合計		719,634,109 (719,634,109)	694,199,863 (694,199,863)	25,434,246 ( 25,434,246)	

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）

（2022年8月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	26,289,224,457	円
負債総額	275,222,889	円
純資産総額（ - ）	26,014,001,568	円
発行済数量	51,968,340,948	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.5006	円

## Bコース（為替ヘッジなし）

（2022年8月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	4,157,547,862	円
負債総額	1,823,073	円
純資産総額（ - ）	4,155,724,789	円
発行済数量	6,525,239,951	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6369	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

（2022年8月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	37,394,598,407	円
負債総額	67,917,413	円
純資産総額（ - ）	37,326,680,994	円
発行済数量	9,868,500,646	口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.7824	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（2022年2月末日現在）

（略）

< 訂正後 >

(1) 資本金等（2022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）

2022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174本、単位型株式投資信託1本、親投資信託44本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,922,906,998,097円です。

< 訂正後 >

（略）

2022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175本、単位型株式投資信託2本、親投資信託46本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額4,233,215,272,333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。以下「財務諸表等規則」という。）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。

当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条および第57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。

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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度（2021年4月1日から2021年12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。第37期事業年度の中間会計期間（2022年1月1日から2022年6月30日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

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35期 (2021年3月31日)	第36期 (2021年12月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	3,247,762	2,332,260
立替金	55,896	10,825
前払費用	33,253	391,344
未収委託者報酬	6,757,847	5,945,170
未収運用受託報酬	9,468,144	1,090,786
未収収益	7,227	7,554
未収入金	*1 197,099	230,819
流動資産計	19,767,230	10,008,763
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 4,012,754	3,719,377
長期差入保証金	13,505	13,505
繰延税金資産	378,891	218,947
その他	230	230
投資その他の資産合計	4,405,381	3,952,060
固定資産計	4,412,868	3,959,547
資産合計	24,180,098	13,968,310
負債の部		
流動負債		
預り金	7	325
未払金	*1	
未払手数料	2,988,518	2,709,755
その他未払金	6,727,569	2,414,060
未払費用	349,227	288,865
未払法人税等	483,198	15,600
未払消費税等	1,276,957	633,070
賞与引当金	1,074,712	1,037,307
その他流動負債	355	355
流動負債合計	12,900,547	7,099,341
固定負債		
長期賞与引当金	210,912	389,323
退職給付引当金	1,942,812	1,998,303
固定負債合計	2,153,725	2,387,627
負債合計	15,054,272	9,486,968
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	250,000	250,000
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	7,875,826	3,231,341
利益剰余金合計	8,125,826	3,481,341
株主資本合計	9,125,826	4,481,341
純資産合計	9,125,826	4,481,341
負債・純資産合計	24,180,098	13,968,310

## （２）【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第36期 (自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)
営業収益		
委託者報酬	35,304,609	33,458,146
運用受託報酬	10,862,519	2,247,705
その他営業収益	113,747	123,584
営業収益計	46,280,877	35,829,436
営業費用	* 1	
支払手数料	16,235,726	15,249,826
広告宣伝費	265,312	221,226
調査費		
調査費	515,713	415,452
委託調査費	9,748,114	6,177,490
営業雑経費		
通信費	30,346	45,710
印刷費	48,792	42,662
協会費	22,019	19,694
その他	288	216
営業費用計	26,866,314	22,172,280
一般管理費		
給料		
給料・手当	2,533,226	1,881,393
賞与	2,260,530	1,831,999
福利厚生費	578,598	421,801
交際費	6,471	4,232
旅費交通費	15,854	5,368
租税公課	209,635	100,646
弁護士報酬	14,658	2,224
不動産賃貸料・共益費	559,825	308,067
退職給付費用	224,469	194,768
消耗器具備品費	3,121	5,503
事務委託費	4,604,958	3,898,698
諸経費	268,414	224,902
一般管理費計	11,279,765	8,879,607
営業利益	8,134,797	4,777,549
営業外収益		
受取利息	* 1	18,850
保険配当金	8,005	8,869
為替差益	9,074	-
雑益	2,461	2,451
営業外収益計	39,452	30,171
営業外費用		
寄付金	-	2,790
為替差損	-	59,075
営業外費用計	-	61,865
経常利益	8,174,250	4,745,855
特別損失		
特別退職金	37,362	59,274
事務過誤損失	24,478	2,386
特別損失計	61,841	61,661
税引前当期純利益	8,112,409	4,684,194
法人税、住民税及び事業税	2,591,057	1,368,735
法人税等調整額	(151,011)	159,943
法人税等合計	2,440,046	1,528,678
当期純利益	5,672,362	3,155,515

## (3)【株主資本等変動計算書】

第35期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本				株主資本合計	純資産合計
	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	250,000	2,203,463	2,453,463	3,453,463	3,453,463
当期変動額						
当期純利益	-	-	5,672,362	5,672,362	5,672,362	5,672,362
当期変動額合計	-	-	5,672,362	5,672,362	5,672,362	5,672,362
当期末残高	1,000,000	250,000	7,875,826	8,125,826	9,125,826	9,125,826

第36期(自2021年4月1日至2021年12月31日)

(単位:千円)

	株主資本				株主資本合計	純資産合計
	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	250,000	7,875,826	8,125,826	9,125,826	9,125,826
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	(7,800,000)	(7,800,000)	(7,800,000)	(7,800,000)
当期純利益	-	-	3,155,515	3,155,515	3,155,515	3,155,515
当期変動額合計	-	-	(4,644,485)	(4,644,485)	(4,644,485)	(4,644,485)
当期末残高	1,000,000	250,000	3,231,341	3,481,341	4,481,341	4,481,341

## 注記事項

## (重要な会計方針)

## 1. 引当金の計上基準

## (1) 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。

## (2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当期末において発生していると認められる額を計上しております。退職給付見込額を当期までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。

過去勤務債務については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による按分額を定額法により費用処理しております。数理計算上の差異については、発生年度に全額費用処理しております。

## 2. 収益及び費用の計上基準

当社は、顧客への投資運用業に関するサービスから生じる委託者報酬、運用受託報酬等により収益を獲得しております。

これらには実績報酬が含まれる場合があります。

## (1) 運用報酬

投資運用サービスのうち運用資産残高等を基礎として算定される報酬(運用報酬)については、一定の期間にわたり履行義務を充足し収益として認識しております。確定した報酬を月次、年4回、年2回もしくは年1回受け取ります。

## (2) 実績報酬

実績報酬は、変動対価の額に関する不確実性が事後的に解消される際に、解消される時点までに計上された収益の著しい減額が発生しない可能性が高い部分に限り取引価格に含めております。確定した報酬は、履行義務充足時点から短期間で支払いを受けます。

## 3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

## (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。

## (重要な会計上の見積り)

第35期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

当事業年度の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌事業年度の財務諸表に影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

第36期(自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)

当事業年度の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌事業年度の財務諸表に影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

## (会計方針の変更)

## 1. 収益認識会計基準の適用

「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)等を当事業年度の期首から適用し、約束した又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。なお、当該変更による影響額は軽微であります。

## (表示方法の変更)

## 1. 時価算定会計基準の適用

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用しております。時価算定会計基準19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44 - 2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとし、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。

## (追加情報)

## 決算期の変更

当社は、2021年6月28日開催の定時株主総会において、定款の一部変更を決議し、事業年度を、1月1日から12月31日までに変更いたしました。その経過措置として、当事業年度は2021年4月1日から2021年12月31日までの9ヶ月間となっております。

## (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35期 (2021年3月31日)	第36期 (2021年12月31日)
未収入金	1,646 千円	1,846 千円
その他未払金	6,519,813 千円	2,192,392 千円
長期貸付金	3,680,000 千円	3,345,000 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35期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第36期 (自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)
営業費用	12,554,987 千円	8,358,672 千円
受取利息	4,830 千円	11,307 千円

## (株主資本等変動計算書関係)

第35期 (自 2020年4月1日 至 2021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

該当事項はありません。

第36期 (自 2021年4月1日 至 2021年12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

2021年12月13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 | 7,800,000 千円 |
| (3) 1株当たりの配当額 | 390 千円       |
| (4) 基準日       | 2021年12月13日  |
| (5) 効力発生日     | 2021年12月13日  |

**(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運用受託報酬、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。

未収委託者報酬および未収運用受託報酬は、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. 金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31日（前期の決算日）における貸借対照表計上額、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35期（2021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	3,247,762	3,247,762	-
(2) 未収委託者報酬	6,757,847	6,757,847	-
(3) 未収運用受託報酬	9,468,144	9,468,144	-
(4) 未収収益	7,227	7,227	-
(5) 未収入金	197,099	197,099	-
(6) 長期貸付金	4,012,754	4,012,754	-
資産計	23,690,833	23,690,833	-
(1) 未払手数料	2,988,518	2,988,518	-
(2) その他未払金	6,727,569	6,727,569	-
(3) 未払費用	349,227	349,227	-
(4) 未払法人税等	483,198	483,198	-
(5) 未払消費税等	1,276,957	1,276,957	-
負債計	11,825,469	11,825,469	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## 資産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬、(4) 未収収益、(5) 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。

## (6) 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) 未払法人税等、(5) 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。

2021年12月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、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。

## 第36期（2021年12月31日）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 長期貸付金	3,719,377	3,719,377	-
資産計	3,719,377	3,719,377	-

## (注2) 資産

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収収益、未収入金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

## 負債

未払手数料、その他未払金、未払費用、未払法人税等、未払消費税等

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注3) 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35期（2021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	3,247,762	-	-	-
未収委託者報酬	6,757,847	-	-	-
未収運用受託報酬	9,468,144	-	-	-
未収収益	7,227	-	-	-
未収入金	197,099	-	-	-
合計	19,678,080	-	-	-

金銭債権のうち長期貸付金(4,012,754千円)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36期（2021年12月31日）

金銭債権のうち長期貸付金(3,719,377千円)については、契約上返済期限の定めがないため、記載を省略しております。

## 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

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

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

(1)時価で貸借対照表に計上している金融商品

該当事項はありません。

(2)時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

区分	時価			
	レベル1 (千円)	レベル2 (千円)	レベル3 (千円)	合計 (千円)
(1) 長期貸付金	-	3,719,377	-	3,719,377
資産計	-	3,719,377	-	3,719,377

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1)長期貸付金

変動金利によるものであり、短期間で市場金利を反映するため、貸付先の信用状態が実行後大きく異なっていない場合は時価と帳簿価額が近似していることから、帳簿価額を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

(退職給付関係)

第35期（自 2020年4月1日 至 2021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	1,900,779
勤務費用	171,251
利息費用	10,280
数理計算上の差異の発生額	29,517
退職給付の支払額	114,101
退職給付債務の期末残高	1,938,692

## (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	1,938,692
未認識過去勤務費用	4,120
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,942,812

退職給付引当金	1,942,812
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,942,812

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	153,392
利息費用	9,208
数理計算上の差異の費用処理額	29,517
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	131,209

## (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 0.8%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は93,260千円であります。

第36期（自 2021年4月1日 至 2021年12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	1,938,692
勤務費用	132,302
利息費用	10,621
数理計算上の差異の発生額	1,689
退職給付の支払額	87,714
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,995,588</u>

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

	(千円)
非積立型制度の退職給付債務	1,995,588
未認識過去勤務費用	2,715
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>1,998,303</u>
退職給付引当金	1,998,303
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>1,998,303</u>

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	116,263
利息費用	9,334
数理計算上の差異の費用処理額	1,689
過去勤務債務の費用処理額	1,406
<u>確定給付型年金制度に係る退職給付費用</u>	<u>125,879</u>

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.6%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は68,889千円であります。

## (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35期 (2021年3月31日)	第36期 (2021年12月31日)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払費用	116,119	100,529
賞与引当金	326,665	317,623
退職給付引当金	594,889	611,880
資産除去債務	2,685	2,685
その他	209,769	186,073
繰延税金資産小計	1,250,127	1,218,790
評価性引当額	690,287	763,405
繰延税金資産合計	559,840	455,385
繰延税金負債		
未払金	180,949	236,438
繰延税金負債合計	180,949	236,438
繰延税金資産又は繰延税金負債( )の純額	378,891	218,947

## 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35期 (2021年3月31日)	第36期 (2021年12月31日)
法定実効税率	30.62%	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.94%	0.40%
評価性引当額	1.51%	1.56%
過年度法人税等	0.00%	0.04%
その他	0.02%	0.02%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.08%	32.63%

## (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。

## (収益認識関係)

第36期(自2021年4月1日至2021年12月31日)

## 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

(単位:千円)

	運用報酬	実績報酬	合計
委託者報酬	33,458,146	-	33,458,146
運用受託報酬	2,247,705	-	2,247,705
その他営業収益	123,584	-	123,584
合計	35,829,436	-	35,829,436

## 2. 収益を理解するための基礎となる情報

注記事項(重要な会計方針)の2. 収益及び費用の計上基準に記載の通りであります。

## 3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

## 顧客との契約から生じた債権等

(単位:千円)

	期首残高	期末残高
顧客との契約から生じた債権	16,225,991	7,035,957

(注)なお、当事業年度の期首および期末において、顧客との契約から生じた契約資産はありません。

(セグメント情報等)

セグメント情報

第35期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）及び第36期（自 2021年4月1日 至 2021年12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35期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. サービスごとの情報

(単位:千円)

	投資信託の運用	投資顧問業	その他	合計
外部顧客への営業収益	35,304,609	10,862,519	113,747	46,280,877

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦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。

3. 主要な顧客ごとの情報

(1) 委託者報酬

(単位:千円)

投資信託の名称	委託者報酬	関連するセグメント名
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	7,613,617	資産運用業
フィデリティ・USリート・ファンドB（為替ヘッジなし）	6,963,153	資産運用業
フィデリティ・日本成長株・ファンド	5,887,035	資産運用業

(2) 運用受託報酬

運用受託報酬については、顧客との守秘義務契約により、開示ができないため、記載を省略しております。

第36期（自 2021年4月1日 至 2021年12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) 営業収益

本邦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。

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	関連するセグメント名
フィデリティ・USリート・ファンドB（為替ヘッジなし）	6,361,705	資産運用業
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	5,608,242	資産運用業
フィデリティ・日本成長株・ファンド	5,264,940	資産運用業

(関連当事者情報)

第35期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. 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	共通発生経費負担額（注3）	千円 9,231,998	未払金	千円 4,108,489
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3） 連結法人税の個別帰属額	千円 1,800,000 4,830 365,300 -	長期貸付金 未収入金 未払金 未払金	千円 3,680,000 1,646 77,826 2,090,219
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3）	千円 2,957,688	未払金	千円 243,277

## (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 10,857,500	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3） 投資信託販売に係る代行手数料（注4）	千円 496,200 754,160	未収入金 未払金	千円 31,831 148,905
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3）	千円 408,673	未払金	千円 17,954

## 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) 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4) 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。

## 2. 親会社に関する注記

- ・FIL Limited（非上場）
- ・FIL Asia Holdings Pte Limited（非上場）
- ・FIL Japan Holdings (Singapore) Pte Limited（非上場）
- ・フィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社（非上場）

第36期（自 2021年4月1日 至 2021年12月31日）

## 1. 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、ペンブローク市	千米ドル 6,825	投資顧問業	被所有間接100%	投資顧問契約の再委任等役員の兼任	委託調査等報酬（注3） 共通発生経費負担額（注4）	千円 - 5,640,534	未収入金 未払金	千円 620 686,919
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） 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 剰余金の配当	千円 335,000 11,307 234,202 - 7,800,000	長期貸付金 未収入金 未払金 未払金 未払金	千円 3,345,000 1,226 50,325 1,098,134 -
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 2,483,934	未払金	千円 357,012



## (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	10,857,500	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）	452,000	未収入金	56,159
							投資信託販売に係る代行手数料（注5）	656,658	未払金	88,138

## 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。

## 2. 親会社に関する注記

- ・FIL Limited（非上場）
- ・FIL Asia Holdings Pte Limited（非上場）
- ・FIL Japan Holdings (Singapore) Pte Limited（非上場）
- ・フィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社（非上場）

## (1株当たり情報)

	第35期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第36期 (自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)
1株当たり純資産額	456,291円33銭	224,067円09銭
1株当たり当期純利益	283,618円14銭	157,775円76銭

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。

(注) 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35期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第36期 (自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)
当期純利益(千円)	5,672,362	3,155,515
普通株式に係る当期純利益(千円)	5,672,362	3,155,515
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。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

		第37期中間会計期間末 (2022年6月30日)	
科目	注記 番号	金額 (千円)	構成比 (%)
(資産の部)			
流動資産			
現金及び預金		2,351,893	
未収委託者報酬		6,438,252	
未収運用受託報酬		471,904	
未収収益		1,570	
未収入金		148,645	
その他		88,594	
流動資産計		9,500,860	49.8
固定資産			
無形固定資産		7,487	
投資その他の資産			
長期貸付金		9,348,010	
長期差入保証金		12,685	
会員預託金		230	
繰延税金資産		218,947	
投資その他の資産計		9,579,873	50.2
固定資産計		9,587,360	50.2
資産合計		19,088,220	100.0

		第37期中間会計期間末 (2022年6月30日)	
科目	注記 番号	金額 (千円)	構成比 (%)
<b>(負債の部)</b>			
流動負債			
未払手数料		2,979,846	
その他未払金		1,513,453	
未払費用		278,197	
未払法人税等		1,668,781	
賞与引当金		1,300,508	
未払消費税等	*1	1,118,195	
その他		493	
流動負債計		8,859,476	46.4
固定負債			
長期賞与引当金		8,510	
退職給付引当金		1,958,819	
固定負債計		1,967,329	10.3
負債合計		10,826,805	56.7
<b>(純資産の部)</b>			
株主資本			
資本金		1,000,000	
利益剰余金			
利益準備金		250,000	
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		7,011,415	
利益剰余金合計		7,261,415	
株主資本合計		8,261,415	43.3
純資産合計		8,261,415	43.3
負債・純資産合計		19,088,220	100.0

## (2) 中間損益計算書

		第37期中間会計期間 自 2022年1月1日 至 2022年6月30日	
科目	注記 番号	金額 (千円)	百分比 (%)
営業収益			
委託者報酬		23,198,024	
運用受託報酬		6,348,968	
その他営業収益		73,943	
営業収益計		29,620,936	100.0
営業費用及び一般管理費		23,992,228	81.0
営業利益		5,628,707	19.0
営業外収益	*2	11,284	0.0
営業外費用	*3	205,732	0.7
経常利益		5,434,259	18.3
特別利益			
特別退職金戻入額		17,315	0.1
特別利益計		17,315	0.1
特別損失			
特別退職金		4,125	0.0
特別損失計		4,125	0.0
税引前中間純利益		5,447,450	18.4
法人税等	*1	1,667,376	5.6
中間純利益		3,780,073	12.8

## 重要な会計方針

項目	第37期中間会計期間 自 2022年1月1日 至 2022年6月30日
1 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金、長期賞与引当金</p> <p>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中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金</p> <p>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、当中間会計期間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事業年度末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。</p>
2 収益及び費用の計上基準	<p>当社は、顧客への投資運用業に関するサービスから生じる委託者報酬、運用受託報酬等により収益を獲得しております。これらには実績報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 運用報酬</p> <p>投資運用サービスのうち運用資産残高等を基礎として算定される報酬（運用報酬）については、一定の期間にわたり履行義務を充足し収益として認識しております。確定した報酬を月次、年4回、年2回もしくは年1回受け取ります。</p> <p>(2) 実績報酬</p> <p>実績報酬は、変動対価の額に関する不確実性が事後的に解消される際に、解消される時点までに計上された収益の著しい減額が発生しない可能性が高い部分に限り取引価格に含めております。確定した報酬は、履行義務充足時点から短期間で支払いを受けます。</p>
3 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 重要な外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算の基準</p> <p>外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p> <p>(2) 消費税等の会計処理</p> <p>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。</p> <p>(3) グループ通算制度への移行に係る税効果会計</p> <p>「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。</p>

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

項目	第37期中間会計期間末 2022年6月30日
*1 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「未払消費税等」に含めて表示しておりません。

## (中間損益計算書関係)

項目	第37期中間会計期間 自 2022年1月1日 至 2022年6月30日
*1 税金費用の取扱い	税金費用については、簡便法による税効果会計を適用しているため、法人税等調整額は法人税等に含めて表示しております。
*2 営業外収益の主要な項目	営業外収益のうち主要な項目は以下のとおりであります。 貸付金利息 9,167千円
*3 営業外費用の主要な項目	営業外費用のうち主要な項目は以下のとおりであります。 為替差損 205,175千円

## (金融商品関係)

第37期中間会計期間(2022年6月30日)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

2022年6月30日における中間貸借対照表計上額、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。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 長期貸付金	9,348,010	9,348,010	-
資産計	9,348,010	9,348,010	-

## (注) 資産

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収収益、未収入金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

## 負債

未払手数料、その他未払金、未払費用、未払法人税等、未払消費税等

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

## 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

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

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

## (1) 時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

該当事項はありません。

## (2) 時価で中間貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

区分	時価(千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 長期貸付金	-	9,348,010	-	9,348,010
資産計	-	9,348,010	-	9,348,010

## (注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

## (1) 長期貸付金

変動金利によるものであり、短期間で市場金利を反映するため、貸付先の信用状態が実行後大きく異なっていない場合は時価と帳簿価額が近似していることから、帳簿価額を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

## (資産除去債務関係)

第37期中間会計期間(2022年6月30日)

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。

## (収益認識関係)

第37期中間会計期間(自 2022年1月1日 至 2022年6月30日)

## 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

(単位:千円)

	運用報酬	実績報酬	合計
委託者報酬	23,198,024	-	23,198,024
運用受託報酬	1,486,504	4,862,463	6,348,968
その他営業収益	73,943	-	73,943
合計	24,758,472	4,862,463	29,620,936

## 2. 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針に係る事項に関する注記の2.収益及び費用の計上基準に記載の通りであります。



## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第37期中間会計期間(自 2022年1月1日 至 2022年6月30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37期中間会計期間(自 2022年1月1日 至 2022年6月30日)

## 1. サービスごとの情報

(単位:千円)

	投資信託の運用	投資顧問業	その他	合計
外部顧客への営業収益	23,198,024	6,348,968	73,943	29,620,936

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

## (1) 委託者報酬

(単位:千円)

投資信託の名称	委託者報酬	関連するセグメント名
フィデリティ・US リート・ファンド B (為替ヘッジなし)	4,551,461	資産運用業
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	3,521,152	資産運用業
フィデリティ・日本成長株・ファンド	3,178,915	資産運用業

## (2) 運用受託報酬

運用受託報酬については、顧客との守秘義務契約により、開示ができないため、記載を省略しております。

## (1株当たり情報)

	第37期中間会計期間 自 2022年1月1日 至 2022年6月30日
1株当たり純資産額	413,070.78円
1株当たり中間純利益金額	189,003.69円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額	3,780,073千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	3,780,073千円
普通株式の期中平均株式数	20,000株

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

## (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 (2022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	
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	11,757百万円	
	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	17,495百万円	
	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	
	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		
あかつき証券株式会社	3,067百万円		

	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	
	株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958百万円	
	株式会社第四北越銀行	32,776百万円	
	株式会社イオン銀行	51,250百万円	
	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	1,770,900百万円	
	株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
	ソニー銀行株式会社	38,500百万円	
	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	
	株式会社三十三銀行	37,400百万円	
	株式会社熊本銀行	10,000百万円	
	株式会社十八親和銀行	36,878百万円	
	日本生命保険相互会社	1,450,000百万円* *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34百万円*) * 1英ポンド155.24円で換算 (2021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。
	FIL(ルクセンブルグ)・エスエイ	1,547,850ユーロ (約202百万円*) * 1ユーロ130.51円で換算 (2021年12月末日現在)	主としてルクセンブルグおよびヨーロッパにおいて知的財産の保有または管理、ファンドの運用および販売業務を営んでいます。

	FIAM LLC	123,235,903米ドル (約14,174百万円 <sup>*</sup> ) <sup>*</sup> 1米ドル115.02円で換算 (2021年12月末日現在)	主として米国において ファンドに対する投資 顧問業務を営んでいま す。
--	----------	---	--

新規募集は行ないません。

## 2【関係業務の概要】

&lt;訂正前&gt;

(略)

(3) 運用の委託先：

名称	業務の内容
FILインベストメンツ・インターナショナル (所在地：英国)	委託会社より運用の指図に関する権限の委託を受け、マザーファンドの先進国債券（除く米国）に関する運用の指図を行ないます。
(略)	

(注) 2022年9月1日付けで、マザーファンドの先進国債券（除く米国）に関する運用の指図に関する権限の委託先に、「FIL（ルクセンブルグ）・エスエイ」が追加となる予定です。なお、当該変更は、担当ポートフォリオ・マネージャーのルクセンブルグ拠点への異動によるもので、当該マザーファンドおよびファンドに係る運用方針や運用スタイル等に変更ありません。

&lt;訂正後&gt;

(略)

(3) 運用の委託先：

名称	業務の内容
FILインベストメンツ・インターナショナル (所在地：英国)	委託会社より運用の指図に関する権限の委託を受け、マザーファンドの先進国債券（除く米国）に関する運用の指図を行ないます。
FIL（ルクセンブルグ）・エスエイ	
(略)	

# 独立監査人の監査報告書

2022年10月14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2022年1月21日から2022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2022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。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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

2022年10月14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2022年1月21日から2022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2022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。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。



## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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

2022年3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2021年4月1日から2021年12月31日までの第36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2021年12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. 上記の監査報告書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](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

2022年9月2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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているフィデリティ投信株式会社の2022年1月1日から2022年12月31日までの第37期事業年度の中間会計期間(2022年1月1日から2022年6月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、フィデリティ投信株式会社の2022年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2022年1月1日から2022年6月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。
- ・ 中間財務諸表に対する意見を表明するために、中間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中間監査の指示、監督及び実施に関して責任がある。監査人は、単独で中間監査意見に対して責任を負う。

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

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。