

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成25年10月18日提出
【計算期間】	第30特定期間 (自 平成25年1月22日 至 平成25年7月22日)
【ファンド名】	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)
【発行者名】	フィデリティ投信株式会社
【代表者の役職氏名】	代表執行役 ジュディー・マリンスキー
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門4丁目3番1号 城山トラストタワー
【事務連絡者氏名】	照沼 加奈子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門4丁目3番1号 城山トラストタワー
【電話番号】	03 - 4560 - 6000
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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】

ファンドの目的

ファンドは、主としてフィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、米国国債／政府機関債、米国高利回り社債（ハイ・イールド・ボンド）、先進国債券（除く米国）およびエマージング諸国の債券等を中心に分散投資を行ない、利息等収入の確保を図るとともに、値上がり益の追求を目指し、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。

ファンドの信託金の限度額

委託会社は、受託会社と合意のうえ、AコースおよびBコースの合計で2兆円を限度として信託金を追加することができます。追加信託が行なわれたときは、受託会社はその引受けを証する書面を委託会社に交付します。

また、委託会社は受託会社と合意のうえ、あらかじめ監督官庁に届け出ることにより、当該限度額を変更することができます。

ファンドの基本的性格

ファンドは追加型株式投資信託であり、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下のとおり分類されます。

商品分類表

「Aコース」、「Bコース」共通

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	内外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

（注）ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

< 商品分類表（網掛け表示部分）の定義 >

追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

「Aコース」

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル		
	年2回	日本		
	年4回	北米		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)
	年12回 (毎月)	アジア		
		オセアニア		
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(債券(一般)))	その他 ()	アフリカ		
		中近東 (中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

「Bコース」

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル		
	年2回	日本		
	年4回	北米		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり ()
	年12回 (毎月)	アジア		
		オセアニア		
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(債券(一般)))	その他 ()	アフリカ		
		中近東 (中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファンドは、投資信託証券を通じて収益の源泉となる資産に投資しますので、「商品分類表」と「属性区分表」の投資対象資産は異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

<属性区分表（網掛け表示部分）の定義>

その他資産（投資信託証券（債券（一般）））...目論見書又は投資信託約款において、投資信託証券（投資形態がファミリーファンド又はファンド・オブ・ファンズのものを含みます。）を通じて主として債券のうち公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものに投資する旨の記載があるものをいいます。

年12回（毎月）...目論見書又は投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。

日本、北米、欧州、エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本、北米地域、欧州地域およびエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。

あり（フルヘッジ）...目論見書又は投資信託約款において、原則として為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

なし...目論見書又は投資信託約款において、原則として為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

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

（参考）ファンドの仕組み



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

ファンドの特色

ファンドが主として投資を行なうマザーファンドの特色は以下の通りです。

性格の異なる世界の代表的な4債券セクターへ投資することにより、リスク分散を図りながら、利息等収入の確保を図るとともに値上がり益の追求を目指します。

毎月決算を行ないます。

米国国債 / 政府機関債、米国高利回り社債（ハイ・イールド・ボンド）、先進国債券（除く米国）およびエマージング債券を主要な投資対象として分散投資を行ない、利息等収入の確保と値上り益の追求を目指します。

各投資対象についての長期的な分析から資産配分を算出し、長期的にこの配分を維持するアプローチを基本とした運用を行ないます。

異なる性格を持つ債券セクターを組み合わせることにより、ポートフォリオ全体のリスクの低減効果が期待できます。

債券等の発行体の信用力分析にあたっては、アナリストによる独自の企業調査情報等を活用し、計量分析も用いて銘柄の選別を行ないます。

ポートフォリオ構築にあたっては、分散投資を基本としリスク分散を図ります。

債券等の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行なう場合があります。

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インベストメント・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。

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

ただし、資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合もあります。

(2) 【ファンドの沿革】

1998年9月1日 ファンドの受益証券の募集開始

1998年9月30日 信託契約の締結、ファンドの当初設定、ファンドの運用開始

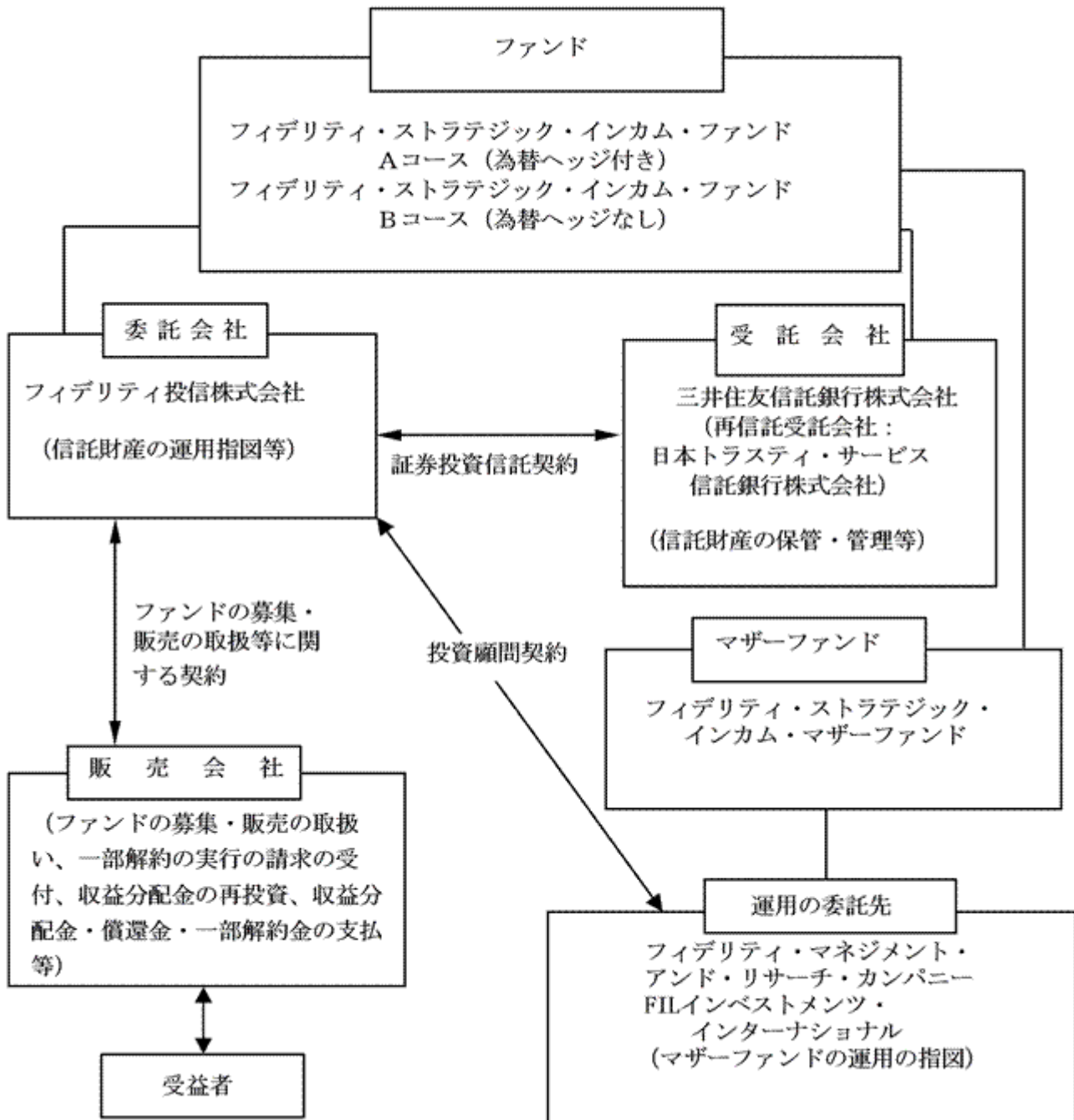
2007年1月4日 投資信託振替制度へ移行

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み

ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行ないます。「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、取得申込者から集めた資金をまとめてベビーファンド(「Aコース」および「Bコース」とし、その資金を主としてマザーファンド(「フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド」)に投資して実質的な運用を行なう仕組みです。

ファンドの仕組みは以下の図の通りです。



委託会社およびファンドの関係法人

委託会社およびファンドの関係法人は以下の通りです。

(a) 委託会社：フィデリティ投信株式会社

ファンドの委託者として、信託財産の運用指図、信託約款の届出、受託会社との信託契約の締結、目論見書・運用報告書の作成、信託財産に組入れた有価証券の議決権等の行使、信託財産に関する帳簿書類の作成等を行ないます。

(b) 受託会社：三井住友信託銀行株式会社

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

(c) 販売会社

ファンドの販売会社として、ファンドの募集・販売の取扱い、目論見書・運用報告書の交付、信託契約の一部解約に関する事務、受益者への収益分配金・一部解約金・償還金の支払に関する事務、収益分配金の再投資、所得税・地方税の源泉徴収、取引報告書・計算書等の交付等を行ないます。

(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：英国ケント)	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。
フィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニー (所在地：米国マサチューセッツ州)	委託会社より運用の指図に関する権限の委託を受け、マザーファンドのアセット・アロケーション、米国国債／政府機関債、米国高利回り社債（ハイ・イールド・ボンド）、エマージング諸国等に関する運用の指図を行ないます。

ただし、委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

(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、FILリミテッドの実質的な子会社です。FILリミテッドは、資産運用業界におけるグローバル・リーダーとして、英国、欧州、中近東およびアジア太平洋地域を含む世界20以上の国や地域で、個人投資家や機関投資家に向け、幅広い資産運用サービスを提供しています。
- ・ フィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニー（FMR Co）は、北米の投資家向けの資産運用サービス、およびFMR LLCが提供するミューチュアル・ファンド商品群の運用を行なう事を目的に1946年に設立されました。株式、ハイ・イールド債券、債券、マネー・マーケット、オルタナティブを含む全ての主要資産クラスを対象とした運用を行なっています。

委託会社が関係法人と締結している契約等の概要

(a) 受託会社と締結している契約

ファンドの根幹となる運用方針、運用制限、信託報酬の総額、手数料等、ファンドの設定・維持のために必要な事項を信託契約で規定しています。

(b) 販売会社と締結している契約

委託会社が販売会社に委託するファンドの募集・販売に係る業務の内容、一部解約に係る事務の内容、およびこれらに関する手続等について規定しています。

(c) 運用の委託先と締結している契約

委託会社が運用の委託先に委託する運用の指図に係る業務の内容、運用の委託先の注意義務、法令等に違反した場合の委託の中止、変更等について規定しています。

委託会社の概況

- (a) 資本金の額 金10億円（2013年8月末日現在）

(b) 沿革

1986年11月17日 フィデリティ投資顧問株式会社設立
1987年2月20日 投資顧問業の登録
同年6月10日 投資一任業務の認可取得
1995年9月28日 社名をフィデリティ投信株式会社に変更
同年11月10日 投資信託委託業務の免許を取得、投資顧問業務と投資信託委託業務を併営
2007年9月30日 金融商品取引業の登録

(c) 大株主の状況

(2013年8月末日現在)

株主名	住所	所有株式数 (株)	所有比率 (%)
フィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社	東京都港区虎ノ門4丁目3番1号 城山トラストタワー	20,000	100

2【投資方針】

（1）【投資方針】

投資態度

- (a) ファンドは、主としてマザーファンド受益証券に投資します。なお、債券等に直接投資を行なうこともできます。
- (b) Aコースは、実質外貨建資産^{*}については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。Bコースは、実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、資金動向、市況動向等により、委託会社が適切と判断した場合には、上記と異なる場合もあります。
- (c) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。
- (d) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行なわれる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらと類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行なうことができます。
- (e) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことができます。

* 「実質外貨建資産」とは、ファンドに属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうちファンドに属するとみなした額（ファンドに属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額をいいます。

ファンドのベンチマーク^{*1}

Aコース：為替ヘッジ付きのインデックスが存在しないため、ベンチマークを設定しません。

Bコース：複合ベンチマーク（円ベース）^{*2}

*1 ベンチマークとは、ファンドのパフォーマンス評価やポートフォリオのリスク管理を行なう際の基準となる指標のことです。

*2 複合ベンチマーク（円ベース）は、複数の債券指数によって構成され当社で算出しているもので、以下の割合で構成されています。

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	バークレイズ米国政府債インデックス	30%
先進国債券 （除く米国）	シティグループG7インデックス（除く米国、ヘッジなし） ^{*3}	15%
米国高利回り社債 （ハイ・イールド・ボンド）	バンクオブアメリカ・メリルリンチ・USハイ・イールド・コンストレインド・インデックス	40%
エマージング債券	JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル	15%

- * 3 同指数は、構成国の比重が等配分された、シティグループ・グローバル・マーケットによるカスタマイズ・インデックスです。(以下同じ。)

運用方針

(a) ファンドの運用について

世界の幅広い債券セクターに投資し、リスク分散を図りながら、好収益をめざします。
分散投資により、リスク低減効果が期待できます。

投資対象の債券セクターは、下図の4つです。

<ファンドの投資対象債券セクター>

安定性・流動性重視/グローバル分散

債券セクター	概要	ベンチマーク	基本配分
米国国債/政府機関債	米国政府や米国の政府系機関が発行する債券	パークレイズ米国政府債インデックス	30%
先進国債券(除く米国)	米国以外の先進国の政府や政府系機関、企業等が発行する債券	シティグループG7インデックス(除く米国、ヘッジなし)	15%

好利回りの追求

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

それぞれの債券セクターは、リスク/リターンの低いものから高いものまで、異なる性格を持っています。このような異なる性格を持つ債券セクターを組み合わせることにより、ポートフォリオ全体のリスクが低減します。

(b) 長期的な資産配分比率に基づく運用手法について

ストラテジック・アセット・アロケーションに基づき運用を行いません。

ストラテジック・アセット・アロケーションとは・・・

各投資対象について長期的な分析を行ない、それに基づき導き出された資産配分比率を、長期的に維持していく運用手法のことです。（これに対し、短中期のマーケットの見通しなどを用い、機動的に資産配分を変更する方法をタクティカル・アセット・アロケーションといいます。）

ファンドは、ストラテジック・アセット・アロケーションの手法を用い、基本的な各債券セクターの資産配分比率を

米国国債 / 政府機関債 30%

米国高利回り社債（ハイ・イールド・ボンド）40%

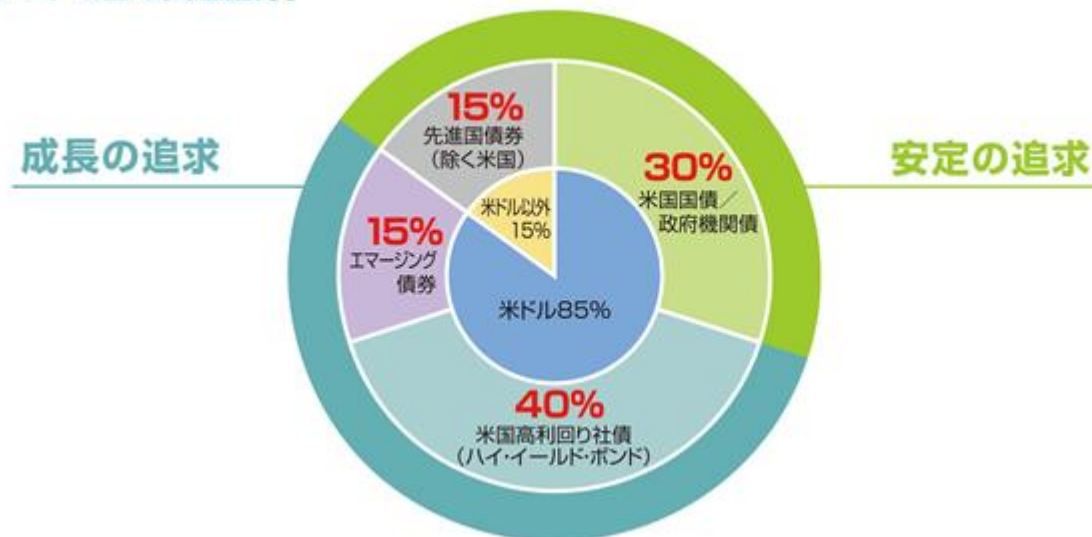
先進国債券（除く米国）15%

エマージング債券 15%

とします。

ファンド名にあるストラテジックは、このアロケーション手法よりつけられています。

[ファンドの基本資産配分]



投資環境、資金動向等によっては、上記配分と異なる可能性もあります。実際の運用上でこれらの数値を保証するものではありません。また、ファンドの運用においては、各セクターへの投資比率に制限を設けるものではありません。

各セクターごとの運用方針と役割は以下の通りです。

米国国債 / 政府機関債

ファンダメンタルズ、計量分析の両方を活用し、銘柄選別を行いません。

高格付けによる安全性と流動性を提供します。

米国高利回り社債（ハイ・イールド・ボンド）

徹底した企業分析に基づくボトム・アップ・アプローチを採用し、個別銘柄の選別を重視します。

高水準の利息収入の確保と値上がり益の獲得を追求します。

先進国債券（除く米国）

原則としてベンチマークの通貨配分比率に基づき、ファンダメンタルズ、計量分析の両面から銘柄選別を行ないます。

グローバル分散投資の機会を提供します。

エマージング債券

トップ・ダウン、ボトム・アップ両方の観点から銘柄を選別します。

分散投資効果と高水準の利回り獲得機会を追求します。

上記の文中で示された考え方は、2013年10月現在のものであり、今後、変更となる場合があります。

（２）【投資対象】

投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主としてマザーファンド受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8．協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9．特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、1．から11．までの証券または証書の性質を有するもの
- 13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14．投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- 17．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、12.ならびに17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券および12.ならびに17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

投資対象とする金融商品

前記にかかわらず、ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

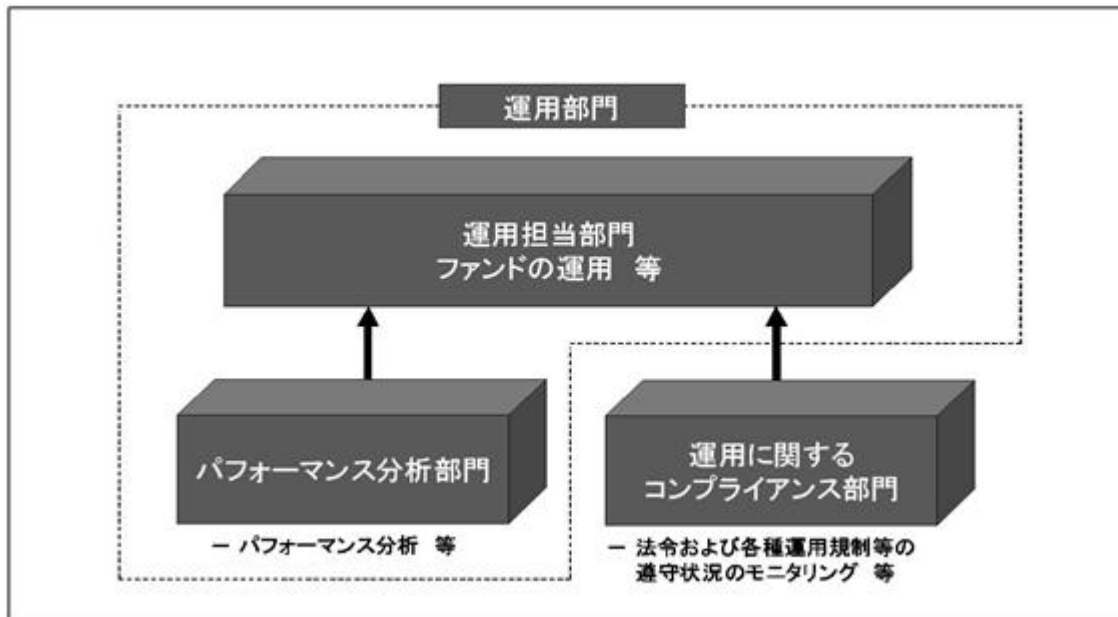
その他の投資対象

1. 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。
2. 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含むものとします(以下同じ。)
3. 信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行なうことの指図をすることができます。
4. 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
5. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、スワップ取引を行なうことの指図をすることができます。なお、スワップ取引を行なうにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。
6. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引^{*1}および為替先渡取引^{*2}を行なうことの指図をすることができます。なお、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

7. 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債の貸付の指図をすることができます。なお、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。
 8. 実質外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
 9. 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。
- * 1 「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。(以下、同じ。)
- * 2 「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下この段落において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下この段落において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。(以下、同じ。)

（３）【運用体制】

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フィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニーに運用の指図に関する権限を委託します。



運用の委託先は、運用の指図に関する権限の範囲内において、ポートフォリオの構築を行ないます。

運用担当部門では、ファンドの運用等を行ないます。

パフォーマンス分析部門では、ファンドのパフォーマンス分析等を行ないます。

運用に関するコンプライアンス部門では、ファンドの法令および各種運用規制等の遵守状況のモニタリング等を行ないます。

< ファンドの運用体制に対する管理等 >

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、運用の委託先の運用部門が自ら行なう方法と、運用の委託先の運用部門から独立している運用に関するコンプライアンス部門が行なう方法を併用し検証しています。

- ・ 運用部門では、部門の担当責任者とポートフォリオ・マネージャーによるミーティング等を実施し、さまざまなリスク要因について協議しています。
- ・ 運用に関するコンプライアンス部門では、ファンドが法令および各種運用規制等を遵守して運用されているかがチェックされ、モニタリングの結果を運用部門および必要に応じて適宜委託会社における運用に関するコンプライアンス部門にフィードバックしています。

なお、委託会社では、インベストメント・リスク・オーバーサイト・コミッティを設置しています。

インベストメント・リスク・オーバーサイト・コミッティは、商品開発部門、パフォーマンス分析部門、運用に関するコンプライアンス部門のメンバー等から構成（８名程度）されており、日本株式以外を主たる投資対象とするファンドや外部運用委託を行なっているファンド等の運用が、その投資目的や運用方針に準拠しているかを検証しています。同コミッティは、原則として月次で開催され、必要に応じて適宜開催されます。

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。

上記「（３）運用体制」の内容は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時(原則毎月20日。同日が休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

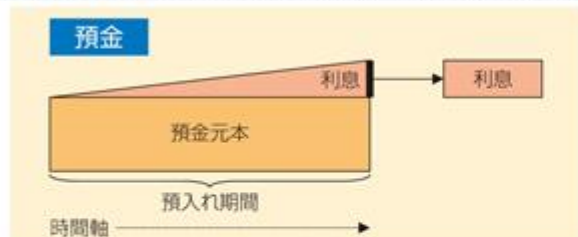
- (a) 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利息等収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- (b) 収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行なうものではありません。
- (c) 留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行いません。

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

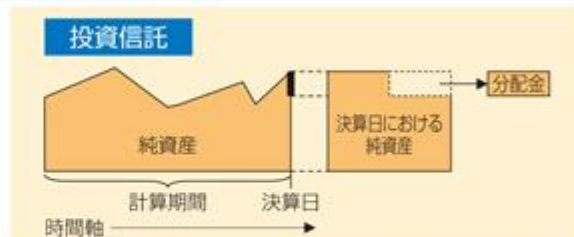
(参考)

[収益分配金に関する留意事項]

分配金は、預貯金の利息とは異なります。分配金の支払いは純資産から行なわれますので、分配金支払い後の純資産は減少することになり、基準価額が下落する要因となります。



(注) 預金は定率の円建て預金をイメージして記載しています。預金元本は必ずしも全額保証されているものではありません。

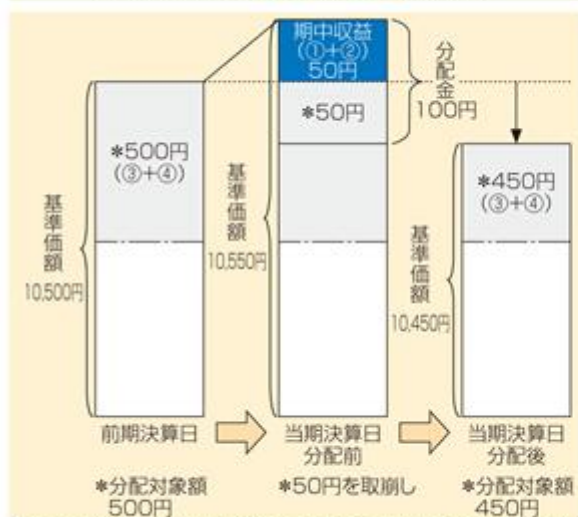


(注) 投資信託の純資産から支払われる分配金をイメージして記載しています。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の利子・配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。計算期間におけるファンドの運用実績は、期中の分配金支払い前の基準価額の推移および収益率によってご判断ください。

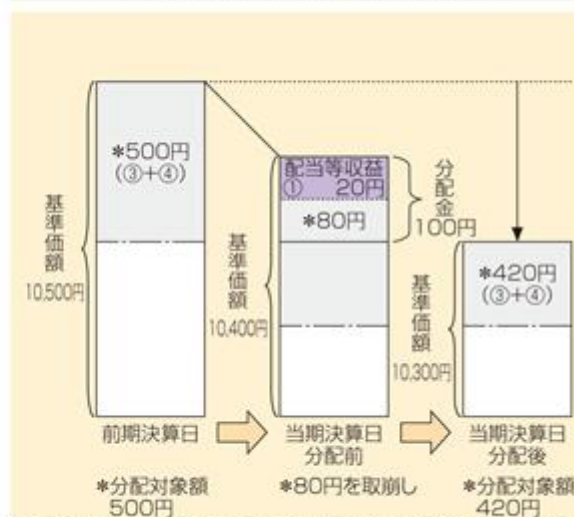
投資信託は、当期の収益の他に、ファンドの設定から当期以前の期間に発生して分配されなかった過去の収益の繰越分等からも分配することができます。

前期決算から基準価額が上昇 当期計算期間の収益がプラスの場合



* 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、収益分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。
* 上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

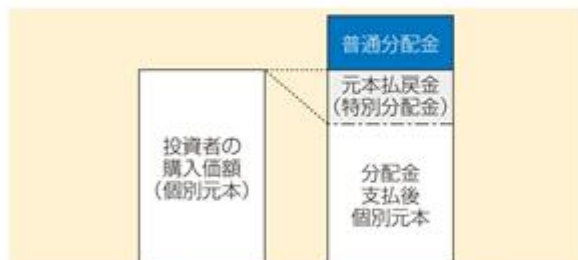
前期決算から基準価額が下落 当期計算期間の収益がマイナスの場合



投資者のファンドの購入価額によっては分配金はその支払いの一部、または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがいさかった場合も同様です。

ファンドの購入価額は、個々の投資者によって異なりますので、投資期間全体での損益は、個々の投資者によって異なります。

分配金の一部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合



「個別元本」とは、追加型投資信託の収益分配金や解約（償還）時の収益に対する課税計算をする際に用いる個々の投資者のファンドの購入価額のことを指します。

「普通分配金」とは、個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

「元本払戻金（特別分配金）」とは、個別元本を下回る部分からの分配金です。実質的に元本の払戻しに相当するため、非課税扱いとなります。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

* 普通分配金に対する課税については、後記「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照ください。

利益の処理方式

信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- (a) 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額は、信託財産保管費用、借入金の利息、信託事務の諸費用等（信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、立替金利息等を含みます。）、信託報酬（以下、総称して「支出金」といいます。）を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 - (b) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、支出金を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
 - (c) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。
- (注) 分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。「累積投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

- (a) 投資する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、および取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。上記にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとし、
- (b) 債券等への実質投資割合^{*}には制限を設けません。
- (c) 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- (d) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- (e) 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。（当該外貨建資産については、為替ヘッジのため外国為替の売買の予約を行なうことができます。）
- (f) 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (g) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (h) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがあるものを含め、以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

- (i) マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (j) 信用取引の指図は、次の1.から6.までに掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の1.から6.までに掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売り出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券
- (k) 有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引の指図は次の範囲で行なうものとします。なお、外国有価証券市場における現物オプション取引は公社債に限るものとします。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金ならびに前記「(2)投資対象 投資対象とする金融商品」1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- (l) 通貨に係る先物取引および先物オプション取引の指図は、次の範囲で行なうものとします。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、ヘッジの対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- (m) 金利に係る先物取引およびオプション取引の指図は、次の範囲で行なうものとします。なお、現物オプション取引は預金に限るものとします。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前記「(2)投資対象 投資対象とする金融商品」1.から4.までに掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに前記「(2)投資対象 投資対象とする金融商品」1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- (n) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。(マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (o) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (p) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。前文の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (q) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。前文の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (r) 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

(s) 借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、当該資金借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。

収益分配金の再投資に係る借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

* 上記(b)から(i)における「実質投資割合」とは、ファンドの信託財産の純資産総額に対する、ファンドの信託財産に属する(b)から(i)に掲げる各種の資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額のうちファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額の割合を意味します。「ファンドの信託財産に属するとみなした額」とは、ファンドの信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

「投資信託及び投資法人に関する法律」（以下「投資信託法」といいます。）および関係法令に基づく投資制限

- (a) 委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ金融商品取引業者等が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含む。）を行なうこと、または継続することを内容とした運用を行なうことを受託会社に指図してはなりません。
- (b) 委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なうすべての委託者指図型投資信託につき信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、当該信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

（参考情報）

フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンドの概要

1. 基本方針

この投資信託は、高水準の利息等収入の確保とともに信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

米国国債 / 政府機関債、米国高利回り社債（ハイ・イールド・ボンド）、先進国の債券およびエマージング諸国の債券等を主要な投資対象とします。

(2) 投資態度

米国国債 / 政府機関債、米国高利回り社債（ハイ・イールド・ボンド）、先進国の債券およびエマージング諸国の債券等を中心に分散投資を行ない、利息等収入の確保を図るとともに、値上り益の追求をめざします。

各投資対象についての長期的な分析に基づき資産配分を算出し、長期的にこの配分を維持するアプローチを基本とした運用を行ないます。

個別銘柄分析、信用分析等に注力した運用を行ないます。

債券等の組入比率は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行なう場合があります。

同一発行体の発行する債券およびその他の有価証券への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、米国政府、米国政府が出資する機関および米国政府機関が発行する証券は除きます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。

有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行なわれる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらと類似の取引を行なうことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、スワップ取引を行なうことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに有価証券等の価格変動リスクおよび為替リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことができます。信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付を行なうことができます。

(3) 投資制限

債券への投資割合には制限を設けません。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので基準価額は変動し、投資元本を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて受益者の皆様に帰属します。したがって、受益者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失が生じることがあります。

ファンドが有する主なリスク等（ファンドが主に投資を行なうマザーファンドが有するリスク等を含みます。）は以下の通りです。

主な変動要因

< 価格変動リスク >

基準価額は有価証券等の市場価格の動きを反映して変動します。有価証券等の発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなる場合があります。

< 信用リスク >

有価証券等への投資にあたっては、発行体において利払いや償還金の支払いが遅延したり、債務が履行されない場合があります。なお、ハイ・イールド債およびエマージング・マーケット債に投資を行なう場合には、上位に格付された債券に比べて前述のリスクが高くなります。

< 金利変動リスク >

公社債等は、金利の変動を受けて価格が変動します。一般に金利が上昇した場合には債券価格は下落し、金利が低下した場合には債券価格は上昇します。

< 為替変動リスク >

Aコースは為替ヘッジを行なうことで、為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、為替ヘッジを行なう際には当該通貨と円の金利差相当分のヘッジコストがかかる場合があります。Bコースは為替ヘッジを行わないため、外貨建の有価証券等に投資を行なう場合には、その有価証券等の表示通貨と日本円との間の為替変動の影響を受けます。

< エマージング市場に関わるリスク >

エマージング市場（新興諸国市場）への投資においては、政治・経済的不確実性、決済システム等市場インフラの未発達、情報開示制度や監督当局による法制度の未整備、為替レートの大きな変動、外国への送金規制等の状況によって有価証券の価格変動が大きくなる場合があります。

その他の変動要因

< デリバティブ（派生商品）に関するリスク >

ファンドは、有価証券先物、各種スワップ、差金決済取引等のデリバティブ（派生商品）を用いることがあります。デリバティブの価格は市場動向などによって変動するため、基準価額の変動に影響を与えます。デリバティブが店頭取引の場合、取引相手の倒産などにより契約が履行されず損失を被る可能性があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

< クーリング・オフ >

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

< 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動の可能性 >

解約資金を手当てするために保有証券を大量に売却しなければならないことがあります。その際には、市況動向や取引量等の状況によって基準価額が大きく変動する可能性があります。

<ファミリーファンド方式にかかる留意点>

ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等に伴い、マザーファンドにおいて売買が生じ、ファンドの基準価額が影響を受ける場合があります。

上記の他、Bコースには下記の留意点もあります。

<ベンチマークに関する留意点>

ファンドのパフォーマンスは、ベンチマークを上回る場合もあれば下回る場合もあり、ベンチマークとの連動を目指すものではありません。また、投資対象国または地域の市場の構造変化等によっては、ファンドのベンチマークを見直す場合があります。

(2) 投資リスクの管理体制

投資リスク管理および投資行動のチェックについては、運用の委託先の運用部門が自ら行なう方法と、運用の委託先の運用部門から独立している運用に関するコンプライアンス部門が行なう方法を併用し検証しています。

- ・ 運用部門では、部門の担当責任者と運用の指図を行なうポートフォリオ・マネージャーが「ポートフォリオ・レビュー・ミーティング」を実施し、さまざまなリスク要因について協議しています。ポートフォリオ・マネージャーは銘柄選定、業種別配分、投資タイミングの決定等についての権限を保有していますが、この「ポートフォリオ・レビュー・ミーティング」では、各ポートフォリオ・マネージャーのポートフォリオ構築状況がレビューされます。この情報共有によって、ポートフォリオ・マネージャーが個人で判断することに起因するリスクが管理される仕組みとなっています。
- ・ 運用に関するコンプライアンス部門では、ファンドが法令および各種運用規制等を遵守して運用されているかがチェックされ、モニタリングの結果を運用部門および必要に応じて適宜委託会社における運用に関するコンプライアンス部門にフィードバックしています。

なお、委託会社では、インベストメント・リスク・オーバーサイト・コミッティを設置しています。

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

(3) 販売会社に係る留意点

販売会社から委託会社に対してお申込み金額の払込みが現実になされるまでは、ファンドも委託会社もいかなる責任も負いません。

収益分配金・一部解約金・償還金の支払は全て販売会社を通じて行なわれます。委託会社は、それぞれの場合においてその金額を販売会社に対して支払った後は、受益者への支払についての責任を負いません。

委託会社は、販売会社（販売会社が選任する取次会社を含みます。）とは別法人であり、委託会社はファンドの設定・運用について、販売会社は販売（お申込み金額の預り等を含みます。）について、それぞれ責任を有し、互いに他について責任を有しません。

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

申込手数料率は3.15%^{*}（税抜 3.00%）を超えないものとします。なお、申込手数料率の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<http://www.fidelity.co.jp/fij/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

* 上記手数料率には、申込手数料に係る消費税等相当額が含まれております。消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。

税法が改正された場合等には、前記数値が変更になることがあります。

申込手数料は、お申込み口数、お申込み金額またはお申込み金総額等に応じて、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に販売会社がそれぞれ定める申込手数料率を乗じて得た額とします。

「お申込み金額」とは、取得申込受付日の翌営業日の基準価額にお申込み口数を乗じて得た金額をいいます。

「お申込み金総額」とは、「お申込み金額」に申込手数料および当該申込手数料に対する消費税等相当額を加算した、取得申込者の支払金総額をいいます。

ただし、「累積投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合のファンドの販売価格は取得申込受付日（各計算期間終了日）の基準価額とし、申込手数料は無手数料とします。

販売会社によっては、スイッチングによるファンドの取得申込みが可能です。スイッチングの取扱い内容等は販売会社によって異なりますので、ご注意ください。スイッチングに伴う換金にあたっては、通常の換金と同様に税金がかかります。

また、販売会社によっては、償還乗換え優遇措置等の適用が受けられる場合があります。

スイッチングおよび償還乗換え優遇措置等の取扱い内容等について、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（２）【換金（解約）手数料】

一部解約にあたっては手数料はかかりません。従って、一部解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

（３）【信託報酬等】

信託報酬（消費税等相当額を含みます。）の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.5015%^{*}（税抜 1.43%）の率を乗じて得た額とします。

* 消費税率が8%になった場合は、年1.5444%となります。

上記の信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託会社、販売会社および受託会社との間の配分は以下の通りに定めます。

（年率）

委託会社	販売会社	受託会社	合計
0.74025% （税抜 0.705%）	0.70875% （税抜 0.675%）	0.0525% （税抜 0.05%）	1.5015% （税抜 1.43%）

消費税率が8%になった場合は、以下の通りとなります。

(年率)

委託会社	販売会社	受託会社	合計
0.7614% (税抜 0.705%)	0.729% (税抜 0.675%)	0.054% (税抜 0.05%)	1.5444% (税抜 1.43%)

委託会社および販売会社に対する信託報酬は、ファンドから委託会社に対して支弁されま
す。信託報酬の販売会社への配分は、販売会社が行なうファンドの募集・販売の取扱い等
に関する業務に対する代行手数料であり、ファンドから委託会社に支弁された後、委託会社よ
り販売会社に対して支払われます。受託会社の報酬は、ファンドから受託会社に対して支弁
されます。

マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者に対する報酬は、ファンドか
ら委託会社が受ける信託報酬の中から支弁されるものとします。

税法が改正された場合等には、前記数値が変更になることがあります。

(4) 【その他の手数料等】

ファンドは以下の費用も負担します。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等の有価証券取引に係る費
用

先物取引やオプション取引等に要する費用

外貨建資産の保管費用

借入金の利息

信託財産に関する租税

信託事務の処理に要する諸費用

受託会社の立替えた立替金の利息

その他、以下の諸費用

1. 投資信託振替制度に係る手数料および費用
2. 有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書の作成、印刷および提出に係る費用
3. 目論見書の作成、印刷および交付に係る費用
4. 信託約款の作成、印刷および届出に係る費用
5. 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出
費用も含まれます。）
6. ファンドの受益者に対してする公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約
の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用
7. ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用

委託会社は、上記の諸費用の支払をファンドのために行ない、その金額を合理的に見積っ
た結果、信託財産の純資産総額に対して年率0.10%（税込）を上限とする額を、かかる諸費用
の合計額とみなして、実際または予想される費用額を上限として、ファンドより受領するこ
とができます。ただし、委託会社は、実際に支払う諸費用の金額状況を考慮して、信託の期中
に、随時かかる諸費用の年率を見直し、これを変更することができます。

上記の諸費用は、ファンドの計算期間を通じて毎日計上されます。かかる諸費用は、毎年
1月および7月に到来する計算期（以下「特定期間」といいます。）末または信託終了のとき
に、信託財産中から委託会社に対して支弁されます。

なお、上記～の費用については、ファンドからその都度支払われます。ただし、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

上記（１）～（４）に係る手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することが出来ません。

（５）【課税上の取扱い】

日本の居住者（法人を含みます。）である受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

個別元本方式について

１．個別元本について

追加型株式投資信託については、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料に対する消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行なうつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には各販売会社毎に、個別元本の算出が行なわれます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店等毎に、「一般コース」と「累積投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行なわれる場合があります。詳しくは販売会社までお問い合わせください。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については下記「３．収益分配金の課税について」をご参照ください。）

２．一部解約時および償還時の課税について

<個人の受益者の場合>

一部解約時および償還時の解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該申込手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益が譲渡益として課税対象となります。

<法人の受益者の場合>

一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

３．収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、（ ）当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、（ ）当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

個人、法人別の課税の取扱いについて
課税上は株式投資信託として取扱われます。

1. 個人の受益者に対する課税

個人の受益者が支払を受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金について、2013年1月1日から2013年12月31日までは10.147%（所得税（復興特別所得税を含みます。）7.147%および地方税3%）、2014年1月1日以後は20.315%（所得税（復興特別所得税を含みます。）15.315%および地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行なうことにより総合課税（配当控除の適用はありません。）または申告分離課税のいずれかを選択することもできます。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

一部解約時および償還時については、解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該申込手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益が譲渡益として課税対象（譲渡所得）となり、2013年1月1日から2013年12月31日までは10.147%（所得税（復興特別所得税を含みます。）7.147%および地方税3%）、2014年1月1日以後は20.315%（所得税（復興特別所得税を含みます。）15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）を選択した場合は申告不要となります。

（注）2014年1月1日以降、公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2. 法人の受益者に対する課税

法人の受益者が支払を受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、2013年1月1日から2013年12月31日までは7.147%（所得税（復興特別所得税を含みます。）7.147%）、2014年1月1日以後は15.315%（所得税（復興特別所得税を含みます。）15.315%）の税率により源泉徴収されます。（地方税の源泉徴収はありません。）収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記「（5）課税上の取扱い」の記載は、2013年8月末現在のもので、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。

上記「（5）課税上の取扱い」の記載は、法的助言または税務上の助言をなすものではありません。ファンドへの投資を検討される方は、ファンドの購入、保有、換金等がもたらす税務上の意味合いにつき専門家と相談されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

Aコース（為替ヘッジ付き）

（2013年8月30日現在）

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	211,623,454,003	100.42
預金・その他の資産（負債控除後）	-	893,758,088	0.42
合計（純資産総額）		210,729,695,915	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

（2013年8月30日現在）

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引（売建）	日本	206,092,872,910	97.80

（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）

（2013年8月30日現在）

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	8,933,222,608	100.04
預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,804,277	0.04
合計（純資産総額）		8,929,418,331	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

(2013年8月30日現在)

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	307,963,377	0.14
	小計	307,963,377	0.14
国債証券	日本	5,761,746,725	2.53
	アメリカ	60,241,692,517	26.49
	ドイツ	7,118,362,763	3.13
	カナダ	5,113,626,017	2.25
	イギリス	4,420,923,792	1.94
	フランス	4,328,159,135	1.90
	イタリア	3,924,688,040	1.73
	トルコ	1,737,637,595	0.76
	ロシア	1,654,671,418	0.73
	ヴェネズエラ	1,494,328,153	0.66
	アルゼンチン	1,298,977,632	0.57
	インドネシア	1,195,227,688	0.53
	ブラジル	1,000,237,840	0.44
	メキシコ	852,989,723	0.38
	ウクライナ	637,411,160	0.28
	フィリピン	574,316,663	0.25
	レバノン	544,646,118	0.24
	クロアチア	512,547,813	0.23
	ニュージーランド	489,819,237	0.22
	コロンビア	460,681,355	0.20
	ハンガリー	405,153,201	0.18
	ベラルーシ	345,231,305	0.15
	スリランカ	291,612,810	0.13
	ペルー	291,061,994	0.13
	リトアニア	290,838,225	0.13
	ポーランド	289,309,957	0.13
	イラク	276,268,650	0.12
	ドミニカ共和国	268,211,344	0.12
	セルビア	248,797,946	0.11
	ナイジェリア	228,372,798	0.10
	ウルグアイ	212,506,780	0.09
	ルーマニア	188,777,430	0.08
	ベトナム	178,686,999	0.08
コンゴ	171,948,866	0.08	

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
	パナマ	149,960,886	0.07
	パキスタン	137,808,508	0.06
	コスタリカ	117,552,495	0.05
	エルサルバドル	98,009,593	0.04
	モロッコ	94,450,190	0.04
	ボリヴィア	91,917,420	0.04
	ラトヴィア	91,110,868	0.04
	南アフリカ	84,571,158	0.04
	ヨルダン	82,560,925	0.04
	バハマ	75,673,266	0.03
	チリ	73,167,791	0.03
	バルバドス	70,125,762	0.03
	グアテマラ	67,647,090	0.03
	コートジボアール	64,985,223	0.03
	アルバ	64,376,620	0.03
	アイスランド	52,413,585	0.02
	アンゴラ	52,130,800	0.02
	タンザニア	50,040,650	0.02
	ガーナ	44,001,346	0.02
	バーレーン	43,435,776	0.02
	モンゴル	43,278,400	0.02
	アラブ首長国連邦	28,032,600	0.01
	グルジア	25,758,025	0.01
	ナミビア	19,877,376	0.01
	パラグアイ	17,901,520	0.01
	オランダ	17,460,365	0.01
	ザンビア	16,746,774	0.01
	イスラエル	14,803,542	0.01
	スペイン	7,098,601	0.00
	小計	108,846,366,844	47.86
地方債証券	アルゼンチン	222,342,780	0.10
	小計	222,342,780	0.10
特殊債券	アメリカ	4,459,415,979	1.96
	ヴェネズエラ	1,827,838,634	0.80
	メキシコ	1,121,969,848	0.49
	インドネシア	444,882,280	0.20
	ロシア	284,577,857	0.13
	アゼルバイジャン	239,650,206	0.11
	ウクライナ	232,412,385	0.10

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
	ブラジル	126,489,731	0.06
	ルクセンブルグ	121,388,621	0.05
	フィリピン	92,556,760	0.04
	グルジア	77,827,350	0.03
	カザフスタン	51,639,000	0.02
	韓国	43,682,691	0.02
	トルコ	39,639,080	0.02
	アイルランド	39,391,213	0.02
	チリ	33,052,378	0.01
	ハンガリー	26,913,755	0.01
	コスタリカ	25,512,125	0.01
	ドイツ	19,864,695	0.01
	小計	9,308,704,588	4.09
社債券	日本	771,130,400	0.34
	アメリカ	70,349,722,104	30.94
	ルクセンブルグ	3,781,684,789	1.66
	カナダ	2,698,839,794	1.19
	オランダ	2,334,022,699	1.03
	ケイマン諸島	1,862,734,794	0.82
	イギリス	1,227,115,921	0.54
	オーストラリア	1,147,453,006	0.50
	バミューダ	621,070,860	0.27
	ブラジル	559,206,305	0.25
	ロシア	548,374,705	0.24
	アルゼンチン	430,727,096	0.19
	メキシコ	370,215,975	0.16
	アイルランド	319,563,306	0.14
	カザフスタン	282,610,362	0.12
	トルコ	233,528,771	0.10
	マーシャル諸島	229,491,093	0.10
	ドイツ	197,281,389	0.09
	イギリス領 バージン諸島	189,802,833	0.08
	グルジア	181,579,937	0.08
	ウクライナ	114,850,054	0.05
	インドネシア	113,741,045	0.05
	エルサルバドル	97,880,495	0.04
	スウェーデン	97,338,120	0.04
	パラグアイ	86,704,340	0.04

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
	ノルウェー	77,500,303	0.03
	チリ	76,208,271	0.03
	ペルー	50,052,945	0.02
	ジャージー	49,728,357	0.02
	ナイジェリア	47,346,816	0.02
	インド	46,032,480	0.02
	コロンビア	44,999,700	0.02
	バハマ	42,425,127	0.02
	マレーシア	24,361,805	0.01
	クロアチア	19,893,310	0.01
	シンガポール	18,652,745	0.01
	南アフリカ	16,426,120	0.01
	リベリア	2,397,525	0.00
	小計	89,362,695,697	39.30
預金・その他の資産(負債控除後)	-	19,357,458,018	8.51
合計(純資産総額)		227,405,531,304	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

(2013年8月30日現在)

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引(買建)	日本	1,067,966,244	0.47

(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。

(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)

(2013年8月30日現在)

順位	種類	銘柄名	国名	数量 (口数)	帳簿価 額単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	親投資 信託受 益証券	フィデリティ・ス トラテジック・イ ンカム・マザー ファンド	日本	103,321,674,643	2.0376	210,532,900,832	2.0482	211,623,454,003	100.42

Bコース(為替ヘッジなし)

(2013年8月30日現在)

順位	種類	銘柄名	国名	数量 (口数)	帳簿価 額単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	親投資 信託受 益証券	フィデリティ・ス トラテジック・イ ンカム・マザー ファンド	日本	4,361,499,174	2.0376	8,887,237,233	2.0482	8,933,222,608	100.04

種類別投資比率

Aコース(為替ヘッジ付き)

(2013年8月30日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.42

Bコース(為替ヘッジなし)

(2013年8月30日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.04

(参考) マザーファンドの投資有価証券の主要銘柄

フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

(2013年8月30日現在)

順位	銘柄名	通貨地域	種類	数量	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 時価金額(円)	利率(%) 償還期限	投資比率 (%)
1	USTN 2.125% 08/31/20	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	68,558,000	9,836.21 6,743,513,785	9,782.10 6,706,411,240	2.125 2020/08/31	2.95
2	UST NOTES 0.25% 03/31/2015	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	58,464,000	9,830.19 5,747,126,233	9,827.54 5,745,573,593	0.250 2015/03/31	2.53
3	USTN 1.50% 8/31/18	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	53,542,000	9,782.04 5,237,501,805	9,788.30 5,240,849,123	1.500 2018/08/31	2.30
4	UK GILT 4% 3/07/22	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	23,885,000	16,949.34 4,048,352,080	17,105.74 4,085,706,906	4.000 2022/03/07	1.80
5	CANADA GOVT 3.25% 6/01/21	カナダ・ドル カナダ	国債証券	33,675,000	9,822.80 3,307,829,284	9,917.76 3,339,806,151	3.250 2021/06/01	1.47
6	GERMANY GOVT 1.5% 09/04/2022	ユーロ ドイツ	国債証券	25,400,000	12,743.85 3,236,938,855	12,794.00 3,249,675,024	1.500 2022/09/04	1.43
7	USTN 0.25% 05/15/2016	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	33,000,000	9,729.57 3,210,759,578	9,726.82 3,209,850,732	0.250 2016/05/15	1.41
8	USTN .625% 08/15/16	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	30,045,000	9,799.80 2,944,350,967	9,794.49 2,942,755,145	0.625 2016/08/15	1.29
9	USTN .375% 01/15/16	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	29,945,000	9,802.55 2,935,375,873	9,799.12 2,934,344,986	0.375 2016/01/15	1.29
10	US T-NOTE 0.25% 4/15/2016	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	28,500,000	9,742.16 2,776,516,899	9,739.90 2,775,872,149	0.250 2016/04/15	1.22
11	USTB 3.625% 08/15/43	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	28,506,000	9,365.64 2,669,770,045	9,694.56 2,763,530,794	3.625 2043/08/15	1.22
12	第308回 10年国債	日本・円 日本	国債証券	2,404,750,000	105.63 2,540,137,425	105.81 2,544,538,117	1.300 2020/06/20	1.12
13	GERMANY OBL 164 .5% 10/13/17	ユーロ ドイツ	国債証券	18,000,000	12,932.44 2,327,839,430	12,944.55 2,330,019,648	0.500 2017/10/13	1.02
14	FNMA 0.625% 8/26/16	アメリカ・ドル アメリカ	特殊債券	22,849,000	9,758.19 2,229,650,487	9,757.51 2,229,493,167	0.625 2016/08/26	0.98
15	USTB 5.375%	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	17,339,000	12,175.09 2,111,040,443	12,433.29 2,155,808,874	5.375 2031/02/15	0.95
16	US T-NOTES 0.375% 3/15/16	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	22,000,000	9,786.03 2,152,927,286	9,781.41 2,151,910,244	0.375 2016/03/15	0.95
17	CIT GROUP NEW 4.75 2/15 144A	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	19,481,000	10,143.37 1,976,030,883	10,155.67 1,978,426,072	4.750 2015/02/15	0.87
18	HAWK ACQ 4.25% 10/15/20 144A	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	21,155,000	9,221.25 1,950,755,437	9,282.72 1,963,760,473	4.250 2020/10/15	0.86
19	GMAC LLC MTN 8% 11/01/31	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	16,894,000	11,323.69 1,913,025,033	11,299.10 1,908,870,798	8.000 2031/11/01	0.84
20	US T NOTES1% 05/31/18	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	18,892,000	9,582.72 1,810,368,029	9,602.40 1,814,084,463	1.000 2018/05/31	0.80

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 (%)
21	第313回 10年国債	日本・円 日本	国債証券	1,695,100,000	105.30 1,784,957,251	105.55 1,789,110,246	1.300 2021/03/20	0.79
22	USTN 1.75% 05/15/2023	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	19,450,000	8,889.28 1,728,965,932	8,989.12 1,748,383,917	1.750 2023/05/15	0.77
23	BUONI POLIENNALI DE 1.7 09/18	ユーロ イタリア	国債証券	13,550,000	12,887.24 1,746,222,104	12,774.07 1,730,886,409	1.700 2018/09/15	0.76
24	USTN 1.375% 07/31/18	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	17,546,000	9,730.32 1,707,282,520	9,744.53 1,709,774,391	1.375 2018/07/31	0.75
25	USTN .375% 06/30/15	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	17,000,000	9,842.49 1,673,223,599	9,837.48 1,672,370,818	0.375 2015/06/30	0.74
26	UST NOTE .875% 1/31/18	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	17,173,000	9,597.77 1,648,225,399	9,611.54 1,650,590,190	0.875 2018/01/31	0.73
27	FRANCE OAT 3% 4/25/22	ユーロ フランス	国債証券	11,875,000	13,821.72 1,641,329,250	13,825.24 1,641,746,832	3.000 2022/04/25	0.72
28	BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5%	ユーロ イタリア	国債証券	12,000,000	13,302.45 1,596,294,374	13,195.01 1,583,400,614	4.500 2023/05/01	0.70
29	FRANCE OAT 4% 4/25/2018	ユーロ フランス	国債証券	10,165,000	14,709.30 1,495,200,914	14,692.90 1,493,532,813	4.000 2018/04/25	0.66
30	US T NOTE 0.125% 04/30/15	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	15,000,000	9,805.60 1,470,841,014	9,803.64 1,470,545,934	0.125 2015/04/30	0.65

(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

(2013年8月30日現在)

種類	国内/外国	業種/種別	投資比率 (%)
株式	外国	銀行	0.04
		各種金融	0.09
		公益事業	0.00
	小計		0.14
公社債券	国内	国債証券	2.53
		社債券	0.34
	小計		2.87
	外国	国債証券	45.33
		地方債証券	0.10
		特殊債券	4.09
		社債券	38.96
小計		88.48	
合計(対純資産総額比)			91.49

【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)

(2013年8月30日現在)

種類	名称等	買建/売建	数量	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	ニュージーランド・ドル	売建	5,990,100	456,403,689	456,265,917	0.22
	カナダ・ドル	売建	51,307,100	4,781,411,263	4,783,874,004	2.27
	イギリス・ポンド	売建	32,216,400	4,909,344,439	4,912,356,672	2.33
	ユーロ	売建	117,458,700	15,287,414,247	15,295,471,914	7.26
	アメリカ・ドル	売建	1,837,129,100	180,500,322,343	180,644,904,403	85.72

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

(2013年8月30日現在)

種類	名称等	買建/売建	数量	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカ・ドル	買建	10,858,833	1,065,577,301	1,067,966,244	0.47

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

2013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)
2004年1月20日 (第11特定期間)	689	691	1.0392	1.0422
2004年7月20日 (第12特定期間)	793	796	1.0113	1.0143
2005年1月20日 (第13特定期間)	832	835	1.0317	1.0347
2005年7月20日 (第14特定期間)	827	828	1.0263	1.0278
2006年1月20日 (第15特定期間)	714	714	1.0175	1.0185
2006年7月20日 (第16特定期間)	582	583	0.9861	0.9871
2007年1月22日 (第17特定期間)	540	541	1.0036	1.0046
2007年7月20日 (第18特定期間)	468	469	0.9798	0.9808
2008年1月21日 (第19特定期間)	445	447	0.9629	0.9664
2008年7月22日 (第20特定期間)	393	395	0.9168	0.9223
2009年1月20日 (第21特定期間)	344	347	0.8251	0.8311
2009年7月21日 (第22特定期間)	375	378	0.8568	0.8628
2010年1月20日 (第23特定期間)	438	441	0.9033	0.9103
2010年7月20日 (第24特定期間)	729	735	0.8866	0.8936
2011年1月20日 (第25特定期間)	1,073	1,082	0.8728	0.8798
2011年7月20日 (第26特定期間)	1,437	1,447	0.8581	0.8636
2012年1月20日 (第27特定期間)	1,116	1,123	0.8418	0.8473
2012年7月20日 (第28特定期間)	2,273	2,289	0.8424	0.8484

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
2012年8月末日	2,873	-	0.8401	-
2012年9月末日	3,571	-	0.8389	-
2012年10月末日	8,764	-	0.8349	-
2012年11月末日	16,399	-	0.8342	-
2012年12月末日	26,770	-	0.8353	-
2013年1月末日	38,908	-	0.8296	-
2013年2月末日	59,912	-	0.8237	-
2013年3月末日	85,068	-	0.8194	-
2013年4月末日	119,516	-	0.8245	-
2013年5月末日	148,696	-	0.8060	-
2013年6月末日	170,206	-	0.7774	-
2013年7月末日	194,025	-	0.7784	-
2013年8月末日	210,729	-	0.7619	-

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)
2004年1月20日 (第11特定期間)	3,390	3,405	0.9063	0.9103
2004年7月20日 (第12特定期間)	3,604	3,618	0.8923	0.8958
2005年1月20日 (第13特定期間)	3,546	3,560	0.8737	0.8772
2005年7月20日 (第14特定期間)	3,814	3,829	0.9466	0.9501
2006年1月20日 (第15特定期間)	3,677	3,691	0.9648	0.9683
2006年7月20日 (第16特定期間)	3,161	3,172	0.9540	0.9575
2007年1月22日 (第17特定期間)	3,114	3,129	1.0118	1.0168
2007年7月20日 (第18特定期間)	2,962	2,977	1.0031	1.0081
2008年1月21日 (第19特定期間)	2,533	2,546	0.8759	0.8804
2008年7月22日 (第20特定期間)	2,382	2,393	0.8509	0.8549
2009年1月20日 (第21特定期間)	1,732	1,742	0.6489	0.6529
2009年7月21日 (第22特定期間)	1,849	1,858	0.7164	0.7199
2010年1月20日 (第23特定期間)	1,832	1,842	0.7474	0.7514
2010年7月20日 (第24特定期間)	1,678	1,688	0.7063	0.7103
2011年1月20日 (第25特定期間)	1,547	1,557	0.6741	0.6781
2011年7月20日 (第26特定期間)	1,422	1,431	0.6528	0.6568
2012年1月20日 (第27特定期間)	1,265	1,273	0.6202	0.6242
2012年7月20日 (第28特定期間)	1,290	1,298	0.6359	0.6399
2013年1月21日 (第29特定期間)	2,289	2,301	0.7192	0.7232
2013年7月22日 (第30特定期間)	8,214	8,257	0.7587	0.7627
2012年8月末日	1,249	-	0.6351	-

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)
2012年9月末日	1,230	-	0.6293	-
2012年10月末日	1,325	-	0.6419	-
2012年11月末日	1,483	-	0.6603	-
2012年12月末日	2,058	-	0.6958	-
2013年1月末日	2,616	-	0.7276	-
2013年2月末日	3,264	-	0.7324	-
2013年3月末日	3,947	-	0.7405	-
2013年4月末日	5,422	-	0.7774	-
2013年5月末日	6,942	-	0.7868	-
2013年6月末日	7,551	-	0.7402	-
2013年7月末日	8,341	-	0.7406	-
2013年8月末日	8,929	-	0.7288	-

【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11特定期間(56期～61期計算期間合計)	0.0180
第12特定期間(62期～67期計算期間合計)	0.0180
第13特定期間(68期～73期計算期間合計)	0.0180
第14特定期間(74期～79期計算期間合計)	0.0135
第15特定期間(80期～85期計算期間合計)	0.0065
第16特定期間(86期～91期計算期間合計)	0.0060
第17特定期間(92期～97期計算期間合計)	0.0060
第18特定期間(98期～103期計算期間合計)	0.0060
第19特定期間(104期～109期計算期間合計)	0.0135
第20特定期間(110期～115期計算期間合計)	0.0295
第21特定期間(116期～121期計算期間合計)	0.0340
第22特定期間(122期～127期計算期間合計)	0.0360
第23特定期間(128期～133期計算期間合計)	0.0400
第24特定期間(134期～139期計算期間合計)	0.0420
第25特定期間(140期～145期計算期間合計)	0.0420
第26特定期間(146期～151期計算期間合計)	0.0405
第27特定期間(152期～157期計算期間合計)	0.0330
第28特定期間(158期～163期計算期間合計)	0.0360
第29特定期間(164期～169期計算期間合計)	0.0360
第30特定期間(170期～175期計算期間合計)	0.0360

Bコース(為替ヘッジなし)

期	1口当たりの分配金(円)
第11特定期間(56期～61期計算期間合計)	0.0240
第12特定期間(62期～67期計算期間合計)	0.0210
第13特定期間(68期～73期計算期間合計)	0.0210
第14特定期間(74期～79期計算期間合計)	0.0210
第15特定期間(80期～85期計算期間合計)	0.0210
第16特定期間(86期～91期計算期間合計)	0.0210
第17特定期間(92期～97期計算期間合計)	0.0270
第18特定期間(98期～103期計算期間合計)	0.0300
第19特定期間(104期～109期計算期間合計)	0.0285
第20特定期間(110期～115期計算期間合計)	0.0245
第21特定期間(116期～121期計算期間合計)	0.0240
第22特定期間(122期～127期計算期間合計)	0.0230
第23特定期間(128期～133期計算期間合計)	0.0230
第24特定期間(134期～139期計算期間合計)	0.0240
第25特定期間(140期～145期計算期間合計)	0.0240
第26特定期間(146期～151期計算期間合計)	0.0240
第27特定期間(152期～157期計算期間合計)	0.0240
第28特定期間(158期～163期計算期間合計)	0.0240
第29特定期間(164期～169期計算期間合計)	0.0240
第30特定期間(170期～175期計算期間合計)	0.0240

【収益率の推移】

Aコース(為替ヘッジ付き)

期	収益率(%)
第11特定期間(56期～61期計算期間合計)	3.8
第12特定期間(62期～67期計算期間合計)	1.0
第13特定期間(68期～73期計算期間合計)	3.8
第14特定期間(74期～79期計算期間合計)	0.8
第15特定期間(80期～85期計算期間合計)	0.2
第16特定期間(86期～91期計算期間合計)	2.5
第17特定期間(92期～97期計算期間合計)	2.4
第18特定期間(98期～103期計算期間合計)	1.8
第19特定期間(104期～109期計算期間合計)	0.3
第20特定期間(110期～115期計算期間合計)	1.7
第21特定期間(116期～121期計算期間合計)	6.3
第22特定期間(122期～127期計算期間合計)	8.2
第23特定期間(128期～133期計算期間合計)	10.1
第24特定期間(134期～139期計算期間合計)	2.8
第25特定期間(140期～145期計算期間合計)	3.2
第26特定期間(146期～151期計算期間合計)	3.0
第27特定期間(152期～157期計算期間合計)	1.9
第28特定期間(158期～163期計算期間合計)	4.3
第29特定期間(164期～169期計算期間合計)	3.0
第30特定期間(170期～175期計算期間合計)	1.5

Bコース（為替ヘッジなし）

期	収益率(%)
第11特定期間（56期～61期計算期間合計）	4.0
第12特定期間（62期～67期計算期間合計）	0.8
第13特定期間（68期～73期計算期間合計）	0.3
第14特定期間（74期～79期計算期間合計）	10.7
第15特定期間（80期～85期計算期間合計）	4.1
第16特定期間（86期～91期計算期間合計）	1.1
第17特定期間（92期～97期計算期間合計）	8.9
第18特定期間（98期～103期計算期間合計）	2.1
第19特定期間（104期～109期計算期間合計）	9.8
第20特定期間（110期～115期計算期間合計）	0.1
第21特定期間（116期～121期計算期間合計）	20.9
第22特定期間（122期～127期計算期間合計）	13.9
第23特定期間（128期～133期計算期間合計）	7.5
第24特定期間（134期～139期計算期間合計）	2.3
第25特定期間（140期～145期計算期間合計）	1.2
第26特定期間（146期～151期計算期間合計）	0.4
第27特定期間（152期～157期計算期間合計）	1.3
第28特定期間（158期～163期計算期間合計）	6.4
第29特定期間（164期～169期計算期間合計）	16.9
第30特定期間（170期～175期計算期間合計）	8.8

（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11特定期間 (2003年7月23日～2004年1月20日)	98,339,728	197,068,289	663,804,097
第12特定期間 (2004年1月21日～2004年7月20日)	163,257,822	42,076,230	784,985,689
第13特定期間 (2004年7月21日～2005年1月20日)	98,783,601	76,671,300	807,097,990
第14特定期間 (2005年1月21日～2005年7月20日)	96,079,648	96,663,325	806,514,313
第15特定期間 (2005年7月21日～2006年1月20日)	19,421,430	123,994,094	701,941,649
第16特定期間 (2006年1月21日～2006年7月20日)	14,799,189	125,903,537	590,837,301
第17特定期間 (2006年7月21日～2007年1月22日)	20,194,204	72,395,193	538,636,312
第18特定期間 (2007年1月23日～2007年7月20日)	16,502,381	76,522,349	478,616,344
第19特定期間 (2007年7月21日～2008年1月21日)	8,737,732	24,226,947	463,127,129
第20特定期間 (2008年1月22日～2008年7月22日)	13,954,281	48,254,225	428,827,185
第21特定期間 (2008年7月23日～2009年1月20日)	7,727,031	18,872,063	417,682,153
第22特定期間 (2009年1月21日～2009年7月21日)	33,412,326	12,970,083	438,124,396
第23特定期間 (2009年7月22日～2010年1月20日)	81,074,878	34,124,786	485,074,488
第24特定期間 (2010年1月21日～2010年7月20日)	410,594,707	72,784,202	822,884,993
第25特定期間 (2010年7月21日～2011年1月20日)	550,181,722	143,213,845	1,229,852,870
第26特定期間 (2011年1月21日～2011年7月20日)	673,360,340	227,408,219	1,675,804,991
第27特定期間 (2011年7月21日～2012年1月20日)	289,992,304	639,456,056	1,326,341,239
第28特定期間 (2012年1月21日～2012年7月20日)	1,848,841,716	476,914,630	2,698,268,325
第29特定期間 (2012年7月21日～2013年1月21日)	35,614,303,030	834,470,520	37,478,100,835

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
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

(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11特定期間 (2003年7月23日～2004年1月20日)	237,549,466	480,458,432	3,741,090,120
第12特定期間 (2004年1月21日～2004年7月20日)	468,604,749	170,182,648	4,039,512,221
第13特定期間 (2004年7月21日～2005年1月20日)	137,569,283	118,057,972	4,059,023,532
第14特定期間 (2005年1月21日～2005年7月20日)	188,601,691	217,420,744	4,030,204,479
第15特定期間 (2005年7月21日～2006年1月20日)	170,453,581	388,468,754	3,812,189,306
第16特定期間 (2006年1月21日～2006年7月20日)	41,106,924	539,723,037	3,313,573,193
第17特定期間 (2006年7月21日～2007年1月22日)	48,612,907	284,098,923	3,078,087,177
第18特定期間 (2007年1月23日～2007年7月20日)	63,653,126	188,379,058	2,953,361,245
第19特定期間 (2007年7月21日～2008年1月21日)	54,154,930	114,741,795	2,892,774,380
第20特定期間 (2008年1月22日～2008年7月22日)	26,975,836	119,417,910	2,800,332,306
第21特定期間 (2008年7月23日～2009年1月20日)	14,473,059	145,830,122	2,668,975,243
第22特定期間 (2009年1月21日～2009年7月21日)	15,727,825	103,427,009	2,581,276,059
第23特定期間 (2009年7月22日～2010年1月20日)	22,283,648	151,674,518	2,451,885,189
第24特定期間 (2010年1月21日～2010年7月20日)	37,021,716	112,024,451	2,376,882,454
第25特定期間 (2010年7月21日～2011年1月20日)	55,295,207	135,897,958	2,296,279,703
第26特定期間 (2011年1月21日～2011年7月20日)	177,636,827	294,654,373	2,179,262,157
第27特定期間 (2011年7月21日～2012年1月20日)	71,064,657	210,032,661	2,040,294,153
第28特定期間 (2012年1月21日～2012年7月20日)	354,385,919	365,547,403	2,029,132,669

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

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

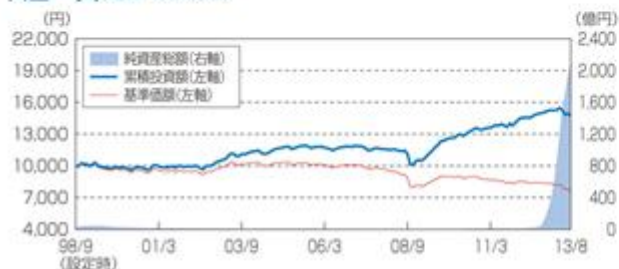
< 参考情報 >

(2013年8月30日現在)

※運用実績等について別途月次等で適時開示している場合があります。この場合、委託会社のホームページにおいて閲覧できます。
 ※下記データは過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。
 ※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。
 ※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。
 ※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。

基準価額・純資産の推移

Aコース(為替ヘッジ付き)



Bコース(為替ヘッジなし)



※累積投資額は、ファンド設定時に10,000円でスタートしてからの収益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収益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。

基準価額	Aコース(為替ヘッジ付き)	Bコース(為替ヘッジなし)
	7,619円	7,288円
純資産総額	Aコース(為替ヘッジ付き)	Bコース(為替ヘッジなし)
	2,107.3億円	89.3億円

分配の推移

決算期	分配金(1万口当たり/税込)	
	Aコース(為替ヘッジ付き)	Bコース(為替ヘッジなし)
2013年4月	60円	40円
2013年5月	60円	40円
2013年6月	60円	40円
2013年7月	60円	40円
2013年8月	60円	40円
直近1年間累計	720円	480円
設定来累計	5,930円	6,530円

主要な資産の状況(マザーファンド)

資産別組入状況

債券	91.4%
新株予約権付社債(転換社債)	0.0%
株式	0.1%
新株予約権証券(ワラント)	-
現金-その他	8.5%

組入上位10銘柄

	銘柄	国*	格付	比率
1	USTN 2.125% 2020/08/31	アメリカ	AA/Aa	2.9%
2	UST NOTES 0.25% 2015/03/31	アメリカ	AA/Aa	2.5%
3	USTN 1.50% 2018/08/31	アメリカ	AA/Aa	2.3%
4	UK GILT 4% 2022/03/07	イギリス	AA/Aa	1.8%
5	CANADA GOVT 3.25% 2021/06/01	カナダ	AAA/Aaa	1.5%
6	GERMANY GOVT 1.5% 2022/09/04	ドイツ	AAA/Aaa	1.4%
7	USTN 0.25% 2016/05/15	アメリカ	AA/Aa	1.4%
8	USTN 0.625% 2016/08/15	アメリカ	AA/Aa	1.3%
9	USTN 0.375% 2016/01/15	アメリカ	AA/Aa	1.3%
10	US T-NOTE 0.25% 2016/04/15	アメリカ	AA/Aa	1.2%

(*発行体の国籍ベース)

国別組入状況(発行体の国籍ベース)

アメリカ	59.5%
カナダ	3.4%
ドイツ	3.2%
日本	2.9%
イギリス	2.5%
フランス	1.9%
イタリア	1.7%
ルクセンブルグ	1.7%
ペネズエラ	1.5%
その他	13.1%

格付別組入状況(対投資債券比率)

AAA/Aaa	6.2%
AA/Aa	38.4%
A	0.7%
BBB/Baa	10.5%
BB/Ba	20.1%
B	18.2%
CCC/Caa	4.7%
CC/Ca以下	0.1%
格付なし	1.0%

通貨別組入状況(対投資資産比率)

アメリカドル	84.2%
ユーロ	7.8%
日本円	2.8%
イギリスポンド	2.5%
カナダドル	2.5%
その他	0.3%

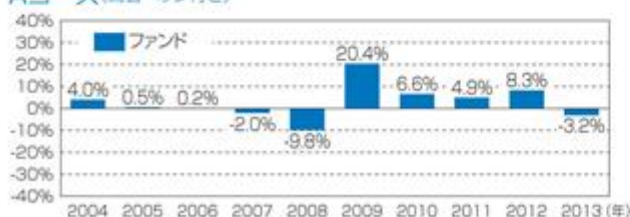
組入債券種別内訳(対投資債券比率)

米国国債-政府機関債	31.0%
ハイイールドポンド	40.9%
先進国債券(除く米国)	14.7%
エマージング債券	13.4%

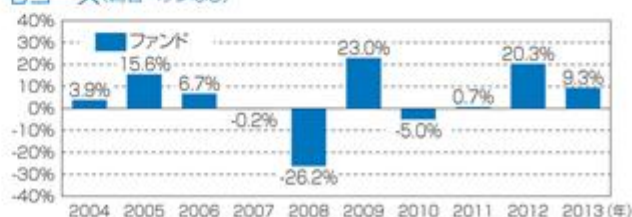
※格付は、S&P社もしくはムーディーズ社による格付を採用し、S&P社の格付を優先して採用しています。〔「プラス/マイナス」の符号は省略しています。〕なお、両社による格付のない場合は、「格付なし」に分類しています。

年間収益率の推移

Aコース(為替ヘッジ付き)



Bコース(為替ヘッジなし)



※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、収益分配金(税込)を再投資したものとみなして算出しています。
 ※2013年は年初以降8月末までの実績となります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

ファンドの取得申込みは、申込期間における販売会社の営業日において行なわれます。ただし、ニューヨーク証券取引所の休業日と同日にはお申込みの受付は行ないません。取得申込みの受付は、原則として午後3時までに取得申込みが行なわれ、かつ当該取得申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分として取扱います。ただし、受付時間は販売会社によって異なることもありますので、ご注意ください。これらの受付時間を過ぎてからの取得申込みは翌営業日の取扱いとなります。

ファンドの販売価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。なお、取得申込みには、手数料がかかります。手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、販売会社所定の申込手数料率を乗じて得た額となります。申込手数料率は3.15%^{*}（税抜3.00%）を超えないものとします。

^{*}消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。

税法が改正された場合等には、前記数値が変更になることがあります。

申込単位は、販売会社が別途定める単位とします。

ただし、「累積投資コース」に基づいて収益分配金を再投資する場合には、1口の整数倍をもって取得の申込みができます。

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

申込代金は、原則として、取得申込受付日から起算して5営業日までにお申込みの販売会社にお支払いください。なお、販売会社が別に定める日がある場合には、その期日までに申込代金をお支払いください。

販売会社によっては、スイッチングによるファンドの取得申込みが可能です。スイッチングの取扱い内容等は販売会社によって異なりますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

委託会社は、信託財産の効率的な運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、または取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社の判断により、ファンドの取得申込みの受付を停止することおよび既に受付けた取得申込みを取り消すことができます。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、解約請求による換金を行なうことが可能です。

受益者は、自己に帰属する受益権につき、販売会社の営業日に一部解約の実行を請求することができます。ただし、ニューヨーク証券取引所の休業日と同日には解約の受付は行ないません。一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までに一部解約の実行の請求が行なわれ、かつ当該請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分として取扱います。ただし、受付時間は販売会社によって異なることもありますので、ご注意ください。これらの受付時間を過ぎてからの一部解約の実行の請求は翌営業日の取扱いとなります。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受付けた場合には、ファンドの信託契約の一部を解約します。

一部解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額（解約価額）とします。なお、一部解約にあたっては、手数料はかかりません。

解約単位は、販売会社が別途定める単位とします。

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

個人の受益者の場合のお手取額（1口当たり）は、一部解約時の差益（譲渡益）に対してかかる税金を差し引いた金額となります。

法人の受益者の場合のお手取額（1口当たり）は、解約価額の個別元本超過額に対してかかる税金を差し引いた金額となります。

上記の記載は、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。

解約代金は、原則として一部解約の実行の請求を受付けた日から起算して5営業日目から、販売会社の営業所等において受益者に支払われます。

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することができます。一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして計算された価額とします。

信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約には制限をさせていただく場合があります。

換金の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。換金の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行なうものとします。受益証券をお手許で保有されている方は、換金のお申し込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

ファンドの基準価額は、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値により計算します。予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

主な投資資産の評価方法の概要は以下の通りです。

マザーファンド受益証券：基準価額で評価します。

公社債等：原則として、金融商品取引所また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）、また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ます。

基準価額は毎営業日計算され、委託会社のホームページ（アドレス：<http://www.fidelity.co.jp/fij/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞に掲載されます。（日本経済新聞においては、ファンドは、「悠々債券A付」および「悠々債券B無」として略称で掲載されています。）
なお、基準価額は便宜上、1万口当たりをもって表示されることがあります。

（２）【保管】

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は無期限とします。ただし、下記「（５）その他（a）信託の終了」の場合には、信託は終了します。

（４）【計算期間】

計算期間は原則として毎月21日から翌月20日までとします。各計算期間終了日に該当する日が休業日のときは該当日の翌営業日を計算期間の終了日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

(a) 信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において信託契約の一部を解約することにより受益権の残存口数がAコースおよびBコースの合計で30億口を下回った場合、またはファンドの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるときその他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、あらかじめ監督官庁に届け出ることにより、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合、委託会社は、あらかじめ、これを公告し、かつ知られたる受益者に対して書面を交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

前段の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定期間(1ヵ月を下らないものとし、)内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記するものとします。当該一定期間内に信託契約の解約に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の50%を超えることとなる場合は、信託契約を解約しないこととします。信託契約を解約しないこととなった場合には、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

なお、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記一定期間が1ヵ月を下らないこととすることが困難な場合には、前段は適用されません。

2. 委託会社は、監督官庁よりファンドの信託契約の解約の命令を受けたときはその命令に従い、信託契約を解約し、信託を終了させます。
3. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がファンドに関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の50%を超えることとなる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
4. 受託会社が信託業務を営む銀行でなくなったとき(ただしファンドに関する受託会社の業務を他の受託会社が引き継ぐ場合を除きます。)、受託会社の辞任および解任に際し委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社はファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(b) 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、あらかじめ監督官庁に届け出ることにより、信託約款を変更することができます。
2. 委託会社は、変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、これを公告し、かつ知られたる受益者に対して書面を交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
3. 上記2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定期間(1ヵ月を下らないものとし、)内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記するものとします。当該一定期間内に信託約款の変更に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の50%を超えることとなる場合は、信託約款の変更は行なわないこととします。信託約款の変更を行なわないこととなった場合には、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
4. 委託会社は監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、その命令に従い、信託約款を変更します。その変更内容が重大なものとなる場合には上記2.および3.の手法に従います。

(c) 関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間のファンドの募集・販売等に係る契約書は、期間満了の3ヵ月前までにいずれの当事者からも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されます。自動延長後も同様です。委託会社と他の関係法人との契約は無期限です。

(d) 公告

委託会社が受益者に対してする公告は日本経済新聞に掲載します。

(e) 運用報告書の作成

委託会社は、毎特定期間終了後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成し、これを販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

(f) 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、ファンドの信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、ファンドの信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(g) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記「(b) 信託約款の変更」の規定に従い、新受託会社を選任します。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は、あらかじめ監督官庁に届出のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

(h) 信託事務処理の再信託

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社が支払を決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として計算期間終了日から起算して5営業日まで）から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払いを開始するものとし、

なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。収益分配金の支払は、販売会社の営業所等において行ないます。

上記にかかわらず、自動けいぞく投資契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が販売会社に交付されます。この場合販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行ないます。当該売付けにより増加した受益権は振替口座簿に記載または記録されます。

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、ファンドの償還金（信託終了時におけるファンドの信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として信託終了日から起算して5営業日まで）から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払いを開始するものとし、

なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。償還金の支払は、販売会社の営業所等において行ないます。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払を請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

(3) 受益権の一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、販売会社が委託会社の承認を得て定める解約単位をもって一部解約の実行を請求することができます。詳しくは、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の項をご参照ください。

(4) 委託会社の免責

収益分配金、償還金および一部解約金の受益者への支払については、委託会社は販売会社に対する支払をもって免責されるものとします。かかる支払がなされた後は、当該収益分配金、償還金および一部解約金は、源泉徴収されるべき税額（および委託会社が一定期間経過後当該販売会社より回収した金額があればその金額）を除き、受益者の計算に属する金銭になるものとします。

(5) 帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

(6) 反対者の買取請求権

信託契約の解約または信託約款の重大な内容の変更を行なう場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

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30特定期間（平成25年1月22日から平成25年7月22日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

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

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第29特定期間 平成25年1月21日現在	第30特定期間 平成25年7月22日現在
資産の部		
流動資産		
預金	6,557,824	251,923,325
親投資信託受益証券	32,375,509,919	187,837,482,237
派生商品評価勘定	85,990	40,247,324
未収入金	267,489,656	1,746,947,294
流動資産合計	32,649,643,389	189,876,600,180
資産合計		
	32,649,643,389	189,876,600,180
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,197,081,358	2,063,027,954
未払金	318,760	-
未払収益分配金	224,868,605	1,424,038,535
未払解約金	6,557,824	251,923,325
未払受託者報酬	1,246,034	8,021,099
未払委託者報酬	34,390,809	221,382,509
その他未払費用	3,161,552	7,318,048
流動負債合計	1,467,624,942	3,975,711,470
負債合計		
	1,467,624,942	3,975,711,470
純資産の部		
元本等		
元本	37,478,100,835	237,339,755,959
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,296,082,388	51,438,867,249
（分配準備積立金）	26,823,966	25,291,017
元本等合計	31,182,018,447	185,900,888,710
純資産合計		
	31,182,018,447	185,900,888,710
負債純資産合計		
	32,649,643,389	189,876,600,180

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第29特定期間		第30特定期間	
	自	平成24年7月21日 平成25年1月21日	自	平成25年1月22日 平成25年7月22日
営業収益				
受取利息		423		2,263
有価証券売買等損益		3,139,363,855		6,138,194,226
為替差損益		2,660,249,440		7,851,372,932
営業収益合計		479,114,838		1,713,176,443
営業費用				
受託者報酬		2,833,363		28,367,962
委託者報酬		78,202,075		782,956,783
その他費用		3,161,552		7,318,048
営業費用合計		84,196,990		818,642,793
営業利益又は営業損失（ ）		394,917,848		2,531,819,236
経常利益又は経常損失（ ）		394,917,848		2,531,819,236
当期純利益又は当期純損失（ ）		394,917,848		2,531,819,236
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（ ）		1,638,675		38,870,087
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		425,230,207		6,296,082,388
剰余金増加額又は欠損金減少額		137,737,321		1,502,453,647
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		137,737,321		1,502,453,647
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,825,788,444		38,761,591,680
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,825,788,444		38,761,591,680
分配金		576,080,231		5,390,697,679
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,296,082,388		51,438,867,249

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間の取扱い ファンドの特定期間は前期末日、当期末日および翌日が休日のため、平成25年1月22日から平成25年7月22日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第29特定期間 平成25年1月21日現在	第30特定期間 平成25年7月22日現在
1．元本の推移		
期首元本額	2,698,268,325 円	37,478,100,835 円
期中追加設定元本額	35,614,303,030 円	207,720,317,789 円
期中一部解約元本額	834,470,520 円	7,858,662,665 円
2．受益権の総数	37,478,100,835 口	237,339,755,959 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	6,296,082,388 円	51,438,867,249 円
4．1口当たり純資産額	0.8320 円	0.7833 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第29特定期間 自 平成24年 7月21日 至 平成25年 1月21日</p>	<p style="text-align: center;">第30特定期間 自 平成25年 1月22日 至 平成25年 7月22日</p>
<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.35%以内の額</p>	<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左</p>
<p>2．分配金の計算過程 （平成24年 7月21日から平成24年 8月20日までの分配金計算期間） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（6,017,168円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（478,393,529円）及び分配準備積立金（25,719,851円）より分配対象収益は510,130,548円（1口当たり0.158776円）であり、うち19,277,381円（1口当たり0.006000円）を分配金額としております。</p> <p>（平成24年 8月21日から平成24年 9月20日までの分配金計算期間） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（9,527,246円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（16,559,195円）、信託約款に規定される収益調整金（566,055,413円）及び分配準備積立金（25,285,211円）より分配対象収益は617,427,065円（1口当たり0.159818円）であり、うち23,179,911円（1口当たり0.006000円）を分配金額としております。</p> <p>（平成24年 9月21日から平成24年10月22日までの分配金計算期間） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（10,583,611円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（3,880,715円）、信託約款に規定される収益調整金（1,085,219,756円）及び分配準備積立金（27,825,537円）より分配対象収益は1,127,509,619円（1口当たり0.156541円）であり、うち43,215,899円（1口当たり0.006000円）を分配金額としております。</p>	<p>2．分配金の計算過程 （平成25年 1月22日から平成25年 2月20日までの分配金計算期間） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（61,709,904円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（8,824,404,442円）及び分配準備積立金（26,448,253円）より分配対象収益は8,912,562,599円（1口当たり0.146491円）であり、うち365,042,001円（1口当たり0.006000円）を分配金額としております。</p> <p>（平成25年 2月21日から平成25年 3月21日までの分配金計算期間） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（117,398,824円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（13,007,397,671円）及び分配準備積立金（26,248,538円）より分配対象収益は13,151,045,033円（1口当たり0.142104円）であり、うち555,270,698円（1口当たり0.006000円）を分配金額としております。</p> <p>（平成25年 3月22日から平成25年 4月22日までの分配金計算期間） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（240,734,509円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（419,889,764円）、信託約款に規定される収益調整金（18,136,148,691円）及び分配準備積立金（26,059,405円）より分配対象収益は18,822,832,369円（1口当たり0.141500円）であり、うち798,140,770円（1口当たり0.006000円）を分配金額としております。</p>

<p style="text-align: center;">第29特定期間 自 平成24年 7月21日 至 平成25年 1月21日</p>	<p style="text-align: center;">第30特定期間 自 平成25年 1月22日 至 平成25年 7月22日</p>
<p>（平成24年10月23日から平成24年11月20日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（13,991,006円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,382,835,816円）及び分配準備積立金（27,281,068円）より分配対象収益は2,424,107,890円（1口当たり0.151977円）であり、うち95,702,681円（1口当たり0.006000円）を分配金額としております。</p>	<p>（平成25年 4月23日から平成25年 5月20日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（221,161,797円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（53,145,322円）、信託約款に規定される収益調整金（22,630,591,212円）及び分配準備積立金（25,864,551円）より分配対象収益は22,930,762,882円（1口当たり0.137397円）であり、うち1,001,364,381円（1口当たり0.006000円）を分配金額としております。</p>
<p>（平成24年11月21日から平成24年12月20日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（42,608,889円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（117,220,064円）、信託約款に規定される収益調整金（4,118,362,973円）及び分配準備積立金（27,076,042円）より分配対象収益は4,305,267,968円（1口当たり0.152098円）であり、うち169,835,754円（1口当たり0.006000円）を分配金額としております。</p>	<p>（平成25年 5月21日から平成25年 6月20日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（248,570,629円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（27,330,032,402円）及び分配準備積立金（25,619,608円）より分配対象収益は27,604,222,639円（1口当たり0.132836円）であり、うち1,246,841,294円（1口当たり0.006000円）を分配金額としております。</p>
<p>（平成24年12月21日から平成25年 1月21日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（70,563,123円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（102,561,379円）、信託約款に規定される収益調整金（5,460,903,940円）及び分配準備積立金（26,823,966円）より分配対象収益は5,660,852,408円（1口当たり0.151044円）であり、うち224,868,605円（1口当たり0.006000円）を分配金額としております。</p>	<p>（平成25年 6月21日から平成25年 7月22日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（384,212,988円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（30,121,736,652円）及び分配準備積立金（25,291,017円）より分配対象収益は30,531,240,657円（1口当たり0.128639円）であり、うち1,424,038,535円（1口当たり0.006000円）を分配金額としております。</p>

（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」に基づき行なっております。
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、運用部門が自ら行なう方法と運用部門から独立したコンプライアンス部門が行なう方法を併用し検証しています。

．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第29特定期間 平成25年 1月21日現在	第30特定期間 平成25年 7月22日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,863,998,027	6,126,658,165
合 計	1,863,998,027	6,126,658,165

（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

第29特定期間（平成25年 1月21日現在）

種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建				
アメリカ・ドル	24,206,932,630	-	25,244,988,840	1,038,056,210
イギリス・ポンド	665,654,400	-	683,616,000	17,961,600
カナダ・ドル	699,161,000	-	729,459,610	30,298,610
ユーロ	2,256,807,052	-	2,367,486,000	110,678,948
合 計	27,828,555,082	-	29,025,550,450	1,196,995,368

第30特定期間（平成25年 7月22日現在）

種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建				
アメリカ・ドル	154,917,549,928	-	156,528,237,437	1,610,687,509
イギリス・ポンド	4,516,465,085	-	4,576,829,712	60,364,627
カナダ・ドル	4,566,033,144	-	4,661,430,400	95,397,256
ニュージーランド・ドル	491,302,693	-	495,510,625	4,207,932
ユーロ	13,700,890,754	-	13,953,014,060	252,123,306
合 計	178,192,241,604	-	180,215,022,234	2,022,780,630

（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

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
日本・円	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	88,736,527,890	187,837,482,237	-
	合計		88,736,527,890	187,837,482,237	

(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29特定期間 平成25年1月21日現在	第30特定期間 平成25年7月22日現在
資産の部		
流動資産		
預金	16,346,085	26,726,541
親投資信託受益証券	2,288,394,397	8,210,202,971
未収入金	16,889,512	87,354,315
流動資産合計	2,321,629,994	8,324,283,827
資産合計	2,321,629,994	8,324,283,827
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	12,731,582	43,308,751
未払解約金	16,346,085	55,765,460
未払受託者報酬	95,557	358,062
未払委託者報酬	2,637,676	9,882,702
その他未払費用	737,252	824,876
流動負債合計	32,548,152	110,139,851
負債合計	32,548,152	110,139,851
純資産の部		
元本等		
元本	3,182,895,604	10,827,187,830
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	893,813,762	2,613,043,854
(分配準備積立金)	101,046,391	419,447,655
元本等合計	2,289,081,842	8,214,143,976
純資産合計	2,289,081,842	8,214,143,976
負債純資産合計	2,321,629,994	8,324,283,827

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第29特定期間		第30特定期間	
	自	平成24年7月21日 至 平成25年1月21日	自	平成25年1月22日 至 平成25年7月22日
営業収益				
受取利息		57		249
有価証券売買等損益		283,262,853		297,181,974
営業収益合計		283,262,910		297,182,223
営業費用				
受託者報酬		387,070		1,352,588
委託者報酬		10,684,520		37,332,721
その他費用		737,252		824,876
営業費用合計		11,808,842		39,510,185
営業利益又は営業損失（ ）		271,454,068		257,672,038
経常利益又は経常損失（ ）		271,454,068		257,672,038
当期純利益又は当期純損失（ ）		271,454,068		257,672,038
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（ ）		4,140,911		10,771,226
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		738,838,833		893,813,762
剰余金増加額又は欠損金減少額		114,875,339		247,182,919
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		114,875,339		247,182,919
剰余金減少額又は欠損金増加額		481,828,680		2,058,492,826
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		481,828,680		2,058,492,826
分配金		55,334,745		176,363,449
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		893,813,762		2,613,043,854

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間の取扱い ファンドの特定期間は前期末日、当期末日および翌日が休日のため、平成25年1月22日から平成25年7月22日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第29特定期間 平成25年1月21日現在	第30特定期間 平成25年7月22日現在
1. 元本の推移 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	2,029,132,669 円 1,485,014,674 円 331,251,739 円	3,182,895,604 円 8,735,735,391 円 1,091,443,165 円
2. 受益権の総数	3,182,895,604 口	10,827,187,830 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	893,813,762 円	2,613,043,854 円
4. 1口当たり純資産額	0.7192 円	0.7587 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第29特定期間 自 平成24年 7月21日 至 平成25年 1月21日</p>	<p style="text-align: center;">第30特定期間 自 平成25年 1月22日 至 平成25年 7月22日</p>
<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.35%以内の額</p>	<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左</p>
<p>2．分配金の計算過程 （平成24年 7月21日から平成24年 8月20日までの分配金計算期間） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（4,015,243円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（41,559,721円）及び分配準備積立金（112,817,896円）より分配対象収益は158,392,860円（1口当たり0.080235円）であり、うち7,896,417円（1口当たり0.004000円）を分配金額としております。</p> <p>（平成24年 8月21日から平成24年 9月20日までの分配金計算期間） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（2,840,917円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（38,144,856円）及び分配準備積立金（110,819,239円）より分配対象収益は151,805,012円（1口当たり0.077698円）であり、うち7,815,082円（1口当たり0.004000円）を分配金額としております。</p> <p>（平成24年 9月21日から平成24年10月22日までの分配金計算期間） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（3,137,422円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（34,101,582円）及び分配準備積立金（109,843,672円）より分配対象収益は147,082,676円（1口当たり0.075314円）であり、うち7,811,722円（1口当たり0.004000円）を分配金額としております。</p>	<p>2．分配金の計算過程 （平成25年 1月22日から平成25年 2月20日までの分配金計算期間） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（6,809,208円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（168,091,036円）及び分配準備積立金（99,312,463円）より分配対象収益は274,212,707円（1口当たり0.066230円）であり、うち16,561,336円（1口当たり0.004000円）を分配金額としております。</p> <p>（平成25年 2月21日から平成25年 3月21日までの分配金計算期間） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（7,228,277円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（15,132,646円）、信託約款に規定される収益調整金（215,795,073円）及び分配準備積立金（95,938,564円）より分配対象収益は334,094,560円（1口当たり0.066887円）であり、うち19,979,740円（1口当たり0.004000円）を分配金額としております。</p> <p>（平成25年 3月22日から平成25年 4月22日までの分配金計算期間） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（11,926,225円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（200,819,255円）、信託約款に規定される収益調整金（296,782,551円）及び分配準備積立金（97,350,986円）より分配対象収益は606,879,017円（1口当たり0.097241円）であり、うち24,963,818円（1口当たり0.004000円）を分配金額としております。</p>

<p style="text-align: center;">第29特定期間 自 平成24年 7月21日 至 平成25年 1月21日</p>	<p style="text-align: center;">第30特定期間 自 平成25年 1月22日 至 平成25年 7月22日</p>
<p>（平成24年10月23日から平成24年11月20日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（2,839,348円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（44,357,661円）及び分配準備積立金（108,903,806円）より分配対象収益は156,100,815円（1口当たり0.072704円）であり、うち8,588,270円（1口当たり0.004000円）を分配金額としております。</p>	<p>（平成25年 4月23日から平成25年 5月20日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（15,075,675円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（188,235,867円）、信託約款に規定される収益調整金（477,433,177円）及び分配準備積立金（278,927,844円）より分配対象収益は959,672,563円（1口当たり0.118658円）であり、うち32,350,975円（1口当たり0.004000円）を分配金額としております。</p>
<p>（平成24年11月21日から平成24年12月20日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（3,654,665円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（76,571,502円）及び分配準備積立金（104,149,740円）より分配対象収益は184,375,907円（1口当たり0.070294円）であり、うち10,491,672円（1口当たり0.004000円）を分配金額としております。</p>	<p>（平成25年 5月21日から平成25年 6月20日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（11,342,618円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（698,424,256円）及び分配準備積立金（427,646,528円）より分配対象収益は1,137,413,402円（1口当たり0.116066円）であり、うち39,198,829円（1口当たり0.004000円）を分配金額としております。</p>
<p>（平成24年12月21日から平成25年 1月21日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（5,949,212円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（110,575,270円）及び分配準備積立金（101,046,391円）より分配対象収益は217,570,873円（1口当たり0.068356円）であり、うち12,731,582円（1口当たり0.004000円）を分配金額としております。</p>	<p>（平成25年 6月21日から平成25年 7月22日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（23,733,430円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（795,479,289円）及び分配準備積立金（419,447,655円）より分配対象収益は1,238,660,374円（1口当たり0.114403円）であり、うち43,308,751円（1口当たり0.004000円）を分配金額としております。</p>
<p>3. その他費用の内訳</p> <p>信託事務費用 737,252 円</p>	<p>-</p>

（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」に基づき行なっております。
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、運用部門が自ら行なう方法と運用部門から独立したコンプライアンス部門が行なう方法を併用し検証しています。

．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第29特定期間 平成25年 1月21日現在	第30特定期間 平成25年 7月22日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	140,469,099	272,773,102
合 計	140,469,099	272,773,102

（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

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
日本・円	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	3,878,591,729	8,210,202,971	-
	合計		3,878,591,729	8,210,202,971	

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

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

ファンドは、「フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は以下のとおりです。

「フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1) 貸借対照表

区 分	平成25年 1月21日現在	平成25年 7月22日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	4,583,284,124	19,291,794,102
株式	137,298,350	334,113,144
国債証券	16,623,284,937	98,881,995,938
地方債証券	17,855,700	225,179,955
特殊債券	1,105,135,498	8,656,277,312
社債券	13,262,824,189	79,160,967,202
派生商品評価勘定	2,480,667	1,993,684
未収入金	342,290,049	1,815,757,479
未収利息	162,959,257	1,342,638,253
前払費用	133,972,161	520,216,760
流動資産合計	36,371,384,932	210,230,933,829
資産合計	36,371,384,932	210,230,933,829
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	242,815	2,829,871
未払金	1,422,764,358	7,051,194,198
未払解約金	284,379,168	1,834,301,609
流動負債合計	1,707,386,341	8,888,325,678
負債合計	1,707,386,341	8,888,325,678
純資産の部		
元本等		
元本	17,965,226,389	95,118,450,732
剰余金		
剰余金又は欠損金()	16,698,772,202	106,224,157,419
元本等合計	34,663,998,591	201,342,608,151
純資産合計	34,663,998,591	201,342,608,151
負債純資産合計	36,371,384,932	210,230,933,829

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	平成25年 1月21日現在	平成25年 7月22日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	2,173,006,841 円	17,965,226,389 円
期中追加設定元本額	17,117,574,989 円	85,177,001,695 円
期中一部解約元本額	1,325,355,441 円	8,023,777,352 円
2. 期末元本額及びその内訳		
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）	16,779,222,555 円	88,736,527,890 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）	1,186,003,834 円	3,878,591,729 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）	- 円	1,986,234,259 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）	- 円	517,096,854 円
計	17,965,226,389 円	95,118,450,732 円
3. 受益権の総数	17,965,226,389 口	95,118,450,732 口
4. 1口当たり純資産額	1.9295 円	2.1168 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」に基づき行なっております。
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、運用部門が自ら行なう方法と運用部門から独立したコンプライアンス部門が行なう方法を併用し検証しています。

・金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成25年 1月21日現在	平成25年 7月22日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	293,362	4,222,348
国債証券	38,570,283	75,439,487
地方債証券	1,010,700	6,048,790
特殊債券	407,421	27,117,464
社債券	99,270,057	163,972,318
合 計	59,575,015	125,921,433

(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

(平成25年1月21日現在)

種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建				
アメリカ・ドル	30,456,855	-	30,409,462	47,393
買建				
アメリカ・ドル	1,625,738,448	-	1,628,171,722	2,433,274
カナダ・ドル	30,456,855	-	30,214,040	242,815
合 計	1,686,652,158	-	1,688,795,224	2,237,852

(平成25年7月22日現在)

種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建				
アメリカ・ドル	1,101,231,851	-	1,100,954,575	277,276
買建				
アメリカ・ドル	1,139,435,530	-	1,139,599,681	164,151
カナダ・ドル	210,028,528	-	208,755,804	1,272,724
ユーロ	175,024,216	-	175,019,326	4,890
合 計	2,625,720,125	-	2,624,329,386	836,187

(注1) 時価の算定方法

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

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

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

(注2) デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておりません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(ア) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AFFILIATED MAN 5.25 PFD 10/22	14,954	25.05	374,597.70	-
	GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.5% P	37,995	25.02	950,634.90	-
	AES TR III 6.75% CV PFD	600	50.12	30,072.00	-
	ALLY FIN INC 7 PFD 144A PERP	745	990.00	737,550.00	-
	ALLY FINANCIAL 7% PFD RGS PERP	129	990.00	127,710.00	-
	GMAC CAP 8.125% PFD 2 PERP	3,712	26.35	97,811.20	-
	US BANCORP 6.5/VR PERP PFD F	408	28.00	11,424.00	-
	WELLS FARGO 5.85 PFD PERP	40,000	25.30	1,012,000.00	-
アメリカ・ドル	小計	98,543		3,341,799.80 (334,113,144)	
合計		98,543		334,113,144 (334,113,144)	

(イ) 株式以外の有価証券

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券				
日本・円	第111回 5年国債	200,000,000	201,380,000	-
	第140回 20年国債	121,850,000	122,468,998	-
	第308回 10年国債	2,104,750,000	2,222,342,382	-
	第313回 10年国債	1,280,100,000	1,345,180,284	-
	第326回 2年国債	725,000,000	724,818,750	-
	第33回 30年国債	3,000,000	3,120,810	-
日本・円 小計		4,434,700,000	4,619,311,224	
アメリカ・ドル	AID 5.5% 9/18/23	128,000.00	153,826.56	-
	ANGOLA 7% 8/16/19 REGS	500,000.00	542,500.00	-
	ARGENTINA 1.33 12/31/38	1,010,000.00	343,400.00	-
	ARGENTINA 8.28 12/31/33	1,301,580.98	813,488.07	-
	ARGENTINA REP 7% 10/03/15	4,150,000.00	3,697,276.50	-
	ARGENTINA REP 7% 9/12/13 EC	7,035,000.00	7,037,321.55	-
	ARUBA GOVT 4.625% 9/14/23 REGS	700,000.00	668,500.00	-
	BAHAMAS GOVT 6.95% 11/29 144A	240,000.00	268,800.00	-
	BARBADOS GOVT 7.25% 12/21 144A	405,000.00	409,050.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	BELARUS 8.75% 8/03/15	2,625,000.00	2,677,500.00	-
	BELARUS REPUB 8.95% 1/18 REGS	500,000.00	515,000.00	-
	BOLIVIA GOVT 4.875% 10/22 144A	400,000.00	384,000.00	-
	BRAZIL GBL 10.125 5/15/2	750,000.00	1,185,000.00	-
	BRAZIL GBL 7.125% 1/20/37 EC	1,340,000.00	1,661,600.00	-
	BRAZIL GBL 8.25%	1,000,000.00	1,375,000.00	-
	BRAZIL GOVT 12.25% 3/06/30 EC	855,000.00	1,504,800.00	-
	BRAZIL GOVT 2.625% 1/05/23	800,000.00	715,200.00	-
	BRAZIL GOVT 5.625% 1/7/41	2,345,000.00	2,462,250.00	-
	CHILE GOVT 2.25% 10/30/22	350,000.00	320,250.00	-
	COLOMBIA GLB 10.375% 1/28/33	1,185,000.00	1,896,000.00	-
	COLOMBIA REP 7.375% 9/18/37	750,000.00	1,005,000.00	-
	COLOMBIA REP GL 6.125% 1/18/41	900,000.00	1,046,250.00	-
	CONGO REP 2.5% 6/30/29	2,068,826.60	1,841,255.65	-
	COSTA RICA 4.375% 4/30/25 144A	215,000.00	198,875.00	-
	COSTA RICA 5.625% 4/30/43 144A	215,000.00	203,175.00	-
	COSTA RICA GOVT 4.25 1/23 144A	700,000.00	651,000.00	-
	CROATIA GOVT 5.5% 4/4/23 144A	900,000.00	911,250.00	-
	CROATIA GOVT 6.375 3/24/21 144	900,000.00	967,500.00	-
	CROATIA GOVT 6.75 11/5/19 144A	1,000,000.00	1,096,680.00	-
	CROATIA REP 6.25 4/27/17 144A	1,050,000.00	1,130,115.00	-
	CROATIA REP 6.625% 7/20 144A	625,000.00	680,500.00	-
	DOMINICAN 9.04 1/23/18 144	710,434.97	774,374.09	-
	DOMINICAN REP 5.875% 4/24 144A	520,000.00	510,900.00	-
	DOMINICAN REP 7.5 5/06/21 144A	700,000.00	766,500.00	-
	DOMINICAN REP 7.5 5/06/21 REGS	200,000.00	219,000.00	-
	EL SALVADOR 5.875 1/30/25 144A	150,000.00	148,125.00	-
	EL SALVADOR 7.625% 2/41 144A	300,000.00	300,000.00	-
	EL SALVADOR REP 7.65 6/35 REGS	375,000.00	375,937.50	-
	EL SALVADOR REP 8.25 4/32 REGS	200,000.00	209,000.00	-
	GEORGIA GOVT 6.875% 4/21 144A	250,000.00	268,750.00	-
	GUATEMALA 4.875% 2/13/28 144A	200,000.00	182,500.00	-
	GUATEMALA GOVT 5.75% 6/22 144A	500,000.00	510,000.00	-
	HUNGARY GOVT 4.125% 2/19/18	914,000.00	901,432.50	-
	HUNGARY GOVT 7.625% 3/29/41	944,000.00	1,012,440.00	-
	ICELAND GOVT 5.875 5/11/22 RGS	525,000.00	548,625.00	-
	INDONESIA 3.375% 4/15/23 144A	710,000.00	640,775.00	-
	INDONESIA 4.625% 4/15/43 144A	210,000.00	177,975.00	-
	INDONESIA 5.875% 3/13/20 144A	1,000,000.00	1,090,000.00	-
	INDONESIA 6.625% 2/17/37 144A	950,000.00	1,023,625.00	-
	INDONESIA 6.875% 1/17/18 144A	950,000.00	1,073,500.00	-
	INDONESIA 7.75% 1/17/38 144A	1,050,000.00	1,283,625.00	-
	INDONESIA 8.5% 10/12/35 144A	750,000.00	975,000.00	-
	INDONESIA 8.5% 10/12/35 REGS	450,000.00	585,000.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	INDONESIA GOV 4.875% 5/21 144A	1,350,000.00	1,380,375.00	-
	INDONESIA GOVT 5.25 1/42 144A	800,000.00	738,000.00	-
	INDONESIA GVT 11.625 3/19 144A	1,400,000.00	1,918,000.00	-
	IRAQ REP 5.8% 1/15/28 REGS	2,750,000.00	2,365,000.00	-
	IVORY COAST GOV STEP 12/32 RGS	575,000.00	523,250.00	-
	JORDAN 3.875% 11/15/15	450,000.00	441,000.00	-
	LATVIA REP 2.75% 1/12/20 144A	1,000,000.00	948,800.00	-
	LEBANESE REP MTN 4% 12/31/17	1,818,000.00	1,792,548.00	-
	LEBANON REP 4.75% 11/16 REGS	350,000.00	345,625.00	-
	LEBANON REP 5% 10/12/17 RGS	200,000.00	194,000.00	-
	LEBANON REP 5.15% 11/12/18	550,000.00	530,750.00	-
	LEBANON REP 5.45% 11/28/19	750,000.00	712,500.00	-
	LEBANON REP 6.1% 10/4/22	200,000.00	194,000.00	-
	LEBANON REP 6.375% 3/09/20	500,000.00	492,500.00	-
	LEBANON REP 6.6% 11/28/26	200,000.00	193,000.00	-
	LITHUANIA REP 6.125% 3/21 144A	775,000.00	895,125.00	-
	LITHUANIA REP 6.625% 2/22 144A	350,000.00	416,955.00	-
	LITHUANIA REP 6.625% 2/22 REGS	400,000.00	476,520.00	-
	LITHUANIA REP 7.375% 2/20 144A	1,050,000.00	1,283,625.00	-
	MEXICO GOV 6.05% 1/11/40	2,000,000.00	2,325,000.00	-
	MEXICO GOV GLB 7.5%	500,000.00	665,000.00	-
	MEXICO GOV GLBL 8.3% 8/15/31	200,000.00	285,000.00	-
	MEXICO GVT GLB 6.75 9/27/34 EC	1,120,000.00	1,394,400.00	-
	MONGOLIA GOVT 4.125% 1/18 144A	500,000.00	471,875.00	-
	MOROCCO GOV 4.25 12/11/22 144A	750,000.00	696,562.50	-
	MOROCCO GOV 5.5 12/11/42 144A	400,000.00	344,000.00	-
	NAMIBIA GOVT 5.5% 11/3/21 144A	200,000.00	207,798.00	-
	NIGERIA GOVT 6.75 1/28/21 144A	450,000.00	488,250.00	-
	NIGERIA REP 5.125% 01/18 144A	440,000.00	453,200.00	-
	NIGERIA REP 6.375% 7/23 144A	500,000.00	518,750.00	-
	NIGERIA RTS(PMT ADJ)11/15/20	250.00	444.47	-
	PAKISTAN 7.125% 3/31/16 144A	1,350,000.00	1,319,625.00	-
	PAKISTAN 7.125% 3/31/16 REGS	100,000.00	97,750.00	-
	PANAMA 6.7% 1/26/36 EC	440,000.00	531,300.00	-
	PANAMA GLBL 8.875% 9/30/27	525,000.00	749,437.50	-
	PANAMA REPUBLIC 4.3% 4/29/53	255,000.00	211,650.00	-
	PARAGUAY RP 4.625 1/25/23 144A	200,000.00	189,000.00	-
	PERU GOVT 5.625% 11/18/50	150,000.00	160,500.00	-
	PERU REP GLBL 8.75 11/21/33	1,320,000.00	1,996,500.00	-
	PHILIPPINE 10.625% 3/16/25	1,175,000.00	1,871,187.50	-
	PHILIPPINE GL 6.375 1/15/32	590,000.00	709,475.00	-
	PHILIPPINE GLBL 7.75% 1/31	1,250,000.00	1,690,625.00	-
	PHILIPPINE GOV 9.5% 2/02/30 DT	1,045,000.00	1,611,912.50	-
	POLAND GOVT 3% 3/17/23	1,220,000.00	1,133,075.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	POLAND GOVT 6.375% 7/15/19	1,625,000.00	1,923,593.75	-
	REP OF HUNGARY GLB 4.75 2/3/15	1,375,000.00	1,405,937.50	-
	REP OF VENEZUELA 13.625%	1,150,000.00	1,242,000.00	-
	ROMANIA 4.375% 8/22/23 144A	600,000.00	587,250.00	-
	ROMANIA 6.75% 2/07/22 144A	875,000.00	1,000,825.00	-
	ROMANIA GOVT 6.75% 2/22 RGS	350,000.00	400,330.00	-
	RUSSIA FED 12.75 6/24/28	2,795,000.00	4,989,075.00	-
	RUSSIAN FD CPN REGS	7,528,225.00	8,987,194.99	-
	RUSSIAN FEDN 5.625 4/4/42 144A	825,000.00	884,812.50	-
	SERBIA 6.75% 11/1/24 144A	1,115,275.29	1,105,460.86	-
	SERBIA 6.75% 11/1/24 REGS	355,308.99	352,182.26	-
	SERBIA REP 5.25% 11/21/17 144A	200,000.00	201,040.00	-
	SERBIA REP 7.25% 9/28/21 144A	520,000.00	553,800.00	-
	SERBIA REP OF 4.875% 2/20 144A	450,000.00	428,625.00	-
	SOUTH AFRICA 4.665% 1/17/24	475,000.00	477,375.00	-
	SOUTH AFRICA 5.5% 3/09/20	400,000.00	438,000.00	-
	SRI LANKA GOV 6.25 10/4/20 144	1,100,000.00	1,100,000.00	-
	SRI LANKA GOV 6.25 7/27/21 144	450,000.00	448,875.00	-
	SRI LANKA REP 7.4% 1/15 144A	800,000.00	840,000.00	-
	TURKEY GLBL 7.375% 2/05/25	1,875,000.00	2,259,375.00	-
	TURKEY GOVT 3.25% 3/23/23	800,000.00	720,000.00	-
	TURKEY GOVT 4.875% 4/16/2043	560,000.00	501,200.00	-
	TURKEY GOVT 6% 1/14/41	1,495,000.00	1,551,062.50	-
	TURKEY GOVT 7.5% 11/07/19	970,000.00	1,166,425.00	-
	TURKEY REP 5.125% 3/25/22	500,000.00	525,000.00	-
	TURKEY REP 5.625% 3/30/21	1,000,000.00	1,092,500.00	-
	TURKEY REP 6.25% 9/26/22	950,000.00	1,069,985.00	-
	TURKEY REP 6.75% 4/03/18	1,000,000.00	1,147,500.00	-
	TURKEY REP 6.75% 5/30/40	1,025,000.00	1,168,500.00	-
	TURKEY REP 7% 3/11/19	650,000.00	760,500.00	-
	TURKEY REP 7.25% 3/05/38	650,000.00	780,000.00	-
	TURKEY REP GLBL 11.875%	655,000.00	1,113,500.00	-
	TURKEY REP GLBL 8%	800,000.00	1,028,000.00	-
	TURKEY REP OF 7.5 7/14/17	1,000,000.00	1,165,000.00	-
	TURKEY RP GLB 6.875% 3/17/36EC	1,345,000.00	1,543,387.50	-
	UAE GOVT 7.75% 10/05/20 REGS	250,000.00	296,875.00	-
	UKRAINE 7.8% 11/28/22 144A	1,250,000.00	1,137,500.00	-
	UKRAINE 9.25% 7/24/17 REGS	800,000.00	809,040.00	-
	UKRAINE GOVT 6.25% 6/16 144A	850,000.00	799,000.00	-
	UKRAINE GOVT 7.75 9/23/20 144A	1,000,000.00	925,000.00	-
	UKRAINE GOVT 7.95 2/23/21 144A	500,000.00	462,500.00	-
	UKRAINE GOVT 7.95% 6/14 REGS	750,000.00	747,375.00	-
	UKRAINE GOVT 7.95% 6/4/14 144A	910,000.00	906,815.00	-
	UKRAINE GOVT 9.25% 7/17 144A	480,000.00	485,424.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	UKRAINE GV 6.75% 11/14/17 144A	350,000.00	323,750.00	-
	UNITED MEX 5.75 10/12/2110	324,000.00	322,380.00	-
	UNITED MEXICAN 4.75% 3/08/44	1,872,000.00	1,802,736.00	-
	UNITED MEXICAN 5.625% 1/17 EC	700,000.00	785,883.00	-
	UNITED REP TANZ 6ML+600 8/20	500,000.00	520,000.00	-
	URUGUAY REP 4.125% 11/20/45	225,000.00	187,875.00	-
	URUGUAY REP PIK 7.875% 1/15/33	1,345,000.00	1,761,950.00	-
	US T BOND 3.125% 2/15/43	16,600,000.00	15,326,448.00	-
	US T NOTE 0.125% 04/30/15	15,000,000.00	14,958,900.00	-
	US T NOTES 0.25% 05/31/15	14,000,000.00	13,988,940.00	-
	US T NOTES1% 05/31/18	46,809,000.00	46,205,163.90	-
	US T-NOTE 0.25% 4/15/2016	28,500,000.00	28,292,805.00	-
	US T-NOTES 0.375% 3/15/16	22,000,000.00	21,931,140.00	-
	US T-NOTES 2% 2/15/23	14,538,000.00	13,998,494.82	-
	UST BILL 2.875% 2/15/43	21,004,000.00	18,381,650.60	-
	UST BOND 4.5% 2/15/36	5,035,000.00	5,946,788.15	-
	UST BOND 5.25% 2/15/29	1,350,000.00	1,710,909.00	-
	UST NOTE .875% 1/31/18	17,173,000.00	16,938,073.36	-
	UST NOTES 0.25% 03/31/2015	58,464,000.00	58,447,630.08	-
	USTB 4.375% 2/15/38	806,000.00	935,330.76	-
	USTB 4.75% 2/15/37	600,000.00	733,776.00	-
	USTB 5.375%	17,339,000.00	22,459,380.09	-
	USTB 6.125% 11/15/27	6,000.00	8,210.58	-
	USTB 6.625% 2/15/27	58,000.00	82,377.98	-
	USTB 7.125% 2/15/23	257,000.00	362,508.78	-
	USTB 8.125% 8/15/19	175,000.00	241,444.00	-
	USTB 9.875% 11/15/15	284,000.00	345,880.76	-
	USTN .125% 9/30/13	5,150,000.00	5,150,772.50	-
	USTN .25% 1/15/15	200,000.00	200,086.00	-
	USTN .25% 10/15/15	6,753,000.00	6,732,403.35	-
	USTN .25% 4/30/14	10,074,000.00	10,083,368.82	-
	USTN .25% 9/15/14	37,000.00	37,035.89	-
	USTN .25% 9/30/14	9,164,000.00	9,172,889.08	-
	USTN .250% 7/15/15	1,215,000.00	1,213,189.65	-
	USTN .375% 01/15/16	29,945,000.00	29,891,099.00	-
	USTN .375% 06/30/15	10,000,000.00	10,014,000.00	-
	USTN .375% 3/15/15	270,000.00	270,515.70	-
	USTN .5% 7/31/17	420,000.00	411,696.60	-
	USTN .5% 8/15/14	186,000.00	186,675.18	-
	USTN .625% 7/15/14	777,000.00	780,636.36	-
	USTN .750% 6/30/17	507,000.00	502,720.92	-
	USTN .875% 11/30/16	56,000.00	56,235.76	-
	USTN .875% 4/30/17	692,000.00	691,183.44	-
	USTN .875% 7/31/19	380,000.00	363,401.60	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	USTN 0.25% 05/15/2016	33,000,000.00	32,731,710.00	-
	USTN 0.375% 02/15/2016	10,008,000.00	9,982,980.00	-
	USTN 0.5% 06/15/16	10,997,000.00	10,977,205.40	-
	USTN 0.625% 07/15/16	9,000,000.00	9,010,530.00	-
	USTN 1% 10/31/16	20,000.00	20,187.40	-
	USTN 1.125% 12/31/19	800,000.00	769,248.00	-
	USTN 1.25% 07/31/18	15,187,000.00	15,121,088.42	-
	USTN 1.375% 06/30/18	15,000,000.00	15,055,050.00	-
	USTN 1.5% 3/31/19	50,000.00	49,917.50	-
	USTN 1.75% 05/15/2023	15,700,000.00	14,706,347.00	-
	USTN 1.875% 06/30/20	63,177,000.00	63,137,198.49	-
	USTN 1.875% 10/31/17	105,000.00	108,419.85	-
	USTN 2.125% 11/30/14	81,000.00	83,126.25	-
	USTN 2.375% 5/31/18	150,000.00	157,792.50	-
	USTN 2.375% 6/30/18	10,000.00	10,515.60	-
	USTN 2.375% 8/31/14	9,295,000.00	9,522,634.55	-
	USTN 2.5 6/30/17	35,000.00	37,077.95	-
	USTN 2.625% 4/30/16	80,000.00	84,605.60	-
	USTN 2.625% 7/31/14	21,000.00	21,530.67	-
	USTN 2.75% 5/31/17	266,000.00	284,348.68	-
	USTN 3% 9/30/16	4,000.00	4,292.48	-
	USTN 3.125% 1/31/17	152,000.00	164,207.12	-
	USTN 3.125% 10/31/16	133,000.00	143,348.73	-
	USTN 3.375% 7/31/13	445,000.00	445,347.10	-
	USTN 3.5% 2/15/18	779,000.00	859,571.97	-
	USTN 4%	226,000.00	239,250.38	-
	USTN 4.25%	286,000.00	286,780.78	-
	USTN 4.75% 8/15/17	171,000.00	196,528.59	-
	VENEZUELA 10.75%	665,000.00	666,662.50	-
	VENEZUELA 11.95% 8/31 REGS	2,175,000.00	2,071,687.50	-
	VENEZUELA REP 11.75% 10/26 RGS	1,550,000.00	1,476,375.00	-
	VENEZUELA REP 6% 12/09/20	500,000.00	370,000.00	-
	VENEZUELA REP 7% 3/31/38 REGS	650,000.00	437,125.00	-
	VENEZUELA REP 8.5% 10/8/14 EC	1,170,000.00	1,170,000.00	-
	VENEZUELA REP 9% 5/07/23 REGS	1,900,000.00	1,605,500.00	-
	VENEZUELA REP 9.25 5/7/28 REGS	1,000,000.00	815,000.00	-
	VENEZUELA REP 9.25 9/15	500,000.00	425,000.00	-
	VENEZUELA REP 9.375 1/13/34 EC	910,000.00	746,200.00	-
	VENEZUELA REPUB 12.75% 8/23/22	2,560,000.00	2,649,600.00	-
	VIETNAM 6.875% 1/15/16 144A	824,000.00	883,740.00	-
	VIETNAM GOVT 6.75% 1/20 144A	400,000.00	436,000.00	-
	VIETNAM PAR 3/5.5% 3/12/28	565,416.67	459,401.04	-
	VIETNAM SOC REP VRN 03/12/16	52,173.90	47,608.68	-
	ZAMBIA REP 5.375% 9/20/22 144A	200,000.00	181,500.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ・ドル 小計		688,643,492.40	700,841,755.19 (70,070,158,684)	
イギリス・債券	UK GILT 1% 9/07/17	2,700,000.00	2,704,779.00	-
	UK GILT 4% 3/07/22	21,385,000.00	24,534,368.95	-
	UK GILT 4.5% 9/07/34	100,000.00	118,795.00	-
イギリス・債券 小計		24,185,000.00	27,357,942.95 (4,183,850,215)	
カナダ・ドル	CANADA GOVT .75% 5/01/14	6,350,000.00	6,334,760.00	-
	CANADA GOVT 1.5% 6/01/23	3,000,000.00	2,774,700.00	-
	CANADA GOVT 3.25% 6/01/21	33,675,000.00	36,324,885.75	-
	CANADA GOVT 4% 6/01/17	5,620,000.00	6,153,900.00	-
	CANADA GOVT 5.75%	75,000.00	104,494.50	-
カナダ・ドル 小計		48,720,000.00	51,692,740.25 (4,990,417,144)	
ナイジェリア・ナイラ	NIGERIA REP 0% 9/5/13	146,500,000.00	144,053,450.00	-
ナイジェリア・ナイラ 小計		146,500,000.00	144,053,450.00 (89,341,950)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVT I/L2% 9/20/25	6,750,000.00	6,719,760.00	-
ニュージーランド・ドル 小計		6,750,000.00	6,719,760.00 (533,414,549)	
ユーロ	BUONI POLIENNALI DE 1.7 09/18	13,550,000.00	13,194,177.00	-
	BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5%	12,000,000.00	12,142,080.00	-
	FRANCE GOVT I/L .25% 7/25/24	2,000,000.00	1,946,460.00	-
	FRANCE OAT 3% 4/25/22	10,175,000.00	11,012,504.25	-
	FRANCE OAT 4% 10/25/38	75,000.00	84,876.00	-
	FRANCE OAT 4% 4/25/2018	10,165,000.00	11,624,998.95	-
	FRANCE OAT I/L 1% 7/25/2017	4,000,000.00	4,815,840.00	-
	GERMANY GOVT 1.5% 09/04/2022	21,100,000.00	21,310,578.00	-
	GERMANY GOVT 2.5% 7/04/44	6,900,000.00	7,084,299.00	-
	GERMANY GOVT I/L 0.75% 4/15/18	4,150,000.00	4,676,427.50	-
	GERMANY OBL 164 .5% 10/13/17	16,250,000.00	16,338,237.50	-
	GERMANY REP 5.5%	200,000.00	295,200.00	-
	ITALY GOVT 4.75% 9/01/21	4,450,000.00	4,678,285.00	-
	NETHERLAND GOV 5.5%	100,000.00	138,670.00	-
	SPAIN GOVT 5.5% 4/30/21	50,000.00	53,994.00	-
ユーロ 小計		105,165,000.00	109,396,627.20 (14,395,502,173)	
国債証券 合計			98,881,995,938 (94,262,684,714)	

[次へ](#)

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
地方債証券				
アメリカ・ドル	BUENOS AIRES 12.5% 4/06/15 144	1,375,000.00	1,402,500.00	-
	PROV CORDOBA 12.375% 8/17 144A	1,100,000.00	849,750.00	-
アメリカ・ドル 小計		2,475,000.00	2,252,250.00 (225,179,955)	
地方債証券 合計			225,179,955 (225,179,955)	
特殊債券				
アメリカ・ドル	AZERBAIJAN RAIL 8.25 2/16	1,100,000.00	1,166,000.00	-
	BANCO NACIONAL 6.5% 6/19 144A	650,000.00	717,600.00	-
	CAIXA ECON 3.5% 11/07/22 144A	725,000.00	613,495.00	-
	CODELCO INC 4.25% 7/17/42 REGS	425,000.00	353,298.25	-
	COMISION FED 4.875 5/26/21 144	200,000.00	208,500.00	-
	COMISION FEDERA 5.75 2/42 144A	200,000.00	193,000.00	-
	DEV BK KAZA 4.125% 12/22 144A	300,000.00	270,000.00	-
	FANNIE MAE 0.5% 3/30/16	51,000.00	50,908.71	-
	FANNIEMAE .5% 7/02/15	396,000.00	396,938.52	-
	FHLB 1% 6/21/17	30,000.00	29,851.80	-
	FHLB 4.875% 5/17/17	1,005,000.00	1,150,111.95	-
	FHLMC .5% 5/13/16	2,247,000.00	2,238,101.88	-
	FHLMC 1% 9/29/17	43,000.00	42,616.44	-
	FIN INFRA 8.375% 11/03/17 144A	750,000.00	684,375.00	-
	FNMA .875% 2/8/18	15,000.00	14,668.20	-
	FNMA 0.625% 8/26/16	22,849,000.00	22,776,568.67	-
	FNMA 0.875% 05/21/18	9,925,000.00	9,637,770.50	-
	FNMA 0.875% 12/20/17	15,000.00	14,705.40	-
	FNMA 1.25% 9/28/16	1,701,000.00	1,722,891.87	-
	GEORGIAN RAIL 7.75 7/11/22 144	750,000.00	813,750.00	-
	INSTITUTO COSTA 6.95 11/21 144	250,000.00	270,000.00	-
	MAGYAR EX-IM BK 5.5% 2/18 144A	275,000.00	273,625.00	-
	NAFTOGAZ OF UKR 9.5% 9/30/14	1,000,000.00	998,800.00	-
	PDVSA 12.75% 2/17/22 144A	2,525,000.00	2,537,625.00	-
	PDVSA PETR VENZ 5.375% 4/12/27	405,000.00	243,000.00	-
	PDVSA PETRO VENZ 8% 11/17/13	1,200,000.00	1,204,800.00	-
	PEMEX MASTER TR 6.625 6/15/38	200,000.00	220,000.00	-
	PEMEX PRO FDG 6.625% 6/15/35	1,425,000.00	1,567,500.00	-
	PERTAMINA 5.25% 5/23/21 144A	600,000.00	591,000.00	-
	PERTAMINA PT 4.3% 5/23 144A	600,000.00	544,500.00	-
	PERTAMINA PT 4.875 5/3/22 144A	800,000.00	764,000.00	-
	PERTAMINA PT 5.625% 5/43 144A	600,000.00	511,500.00	-
PERTAMINA PT 6% 5/3/42 144A	1,000,000.00	895,000.00	-	
PERTAMINA PT 6.5% 5/27/41 144A	450,000.00	423,000.00	-	
PERTAMINA PT 6.5% 5/27/41 REGS	425,000.00	399,500.00	-	
PERUSAHAAN LIST5.25%10/42 144A	225,000.00	184,500.00	-	

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	PERUSAHAAN LIST5.5% 11/21 144A	200,000.00	199,500.00	-
	PETROLEO DE VE 8.5% 11/17 144A	6,800,000.00	6,341,000.00	-
	PETROLEO DE VE 8.5% 11/17 REGS	1,025,000.00	955,812.50	-
	PETROLEOS DE VEN 4.9% 10/28/14	3,025,000.00	2,858,625.00	-
	PETROLEOS DE VENE 5% 10/28/15	1,425,000.00	1,268,250.00	-
	PETROLEOS MEX 3.5 1/30/23 144A	965,000.00	905,170.00	-
	PETROLEOS MEX 4.875% 1/22	700,000.00	733,250.00	-
	PETROLEOS MEX 5.5 1/21/21 WI	1,340,000.00	1,470,650.00	-
	PETROLEOS MEX 6.5% 6/02/41	1,150,000.00	1,243,725.00	-
	PETROLEOS MEX 6.5% 6/2/41 144A	250,000.00	270,000.00	-
	PETROLEOS MEX 6.625% PERP REGS	1,200,000.00	1,242,000.00	-
	PETROLEOS MEXICANOS 8% 5/3/19	950,000.00	1,169,925.00	-
	PETROLEOS MX 4.875 1/24 144A	440,000.00	452,100.00	-
	PETROLEOS MX 5.5% 6/27/44 WI	975,000.00	923,812.50	-
	PETROLEOS MX 6.625% PERP 144A	1,555,000.00	1,609,425.00	-
	PETROLEOS MX MTN 6% 3/05/20	500,000.00	567,500.00	-
	PETROLEOS VENEZ 8% 11/13 REGS	665,000.00	663,337.50	-
	PETROLEOS VENZ 9% 11/17/21 RGS	850,000.00	720,375.00	-
	PETROLEOS VENZ 9.75 5/35 144A	385,000.00	308,000.00	-
	PETROLEOS VENZ 9.75 5/35 REGS	1,225,000.00	980,000.00	-
	POWER SCTR A&L 7.39% 12/24 REG	150,000.00	184,500.00	-
	RSHB CAP SA 5.298% 12/17 144A	200,000.00	206,000.00	-
	RSHB CAP SA 7.75% 5/29/18 144A	200,000.00	225,000.00	-
	RSHB CAP(RUSS AGR)6% 6/21 144A	250,000.00	252,200.00	-
	RZD CAPITAL LTD 5.7% 4/22 REGS	225,000.00	232,875.00	-
	RZD CAPITAL PLC 5.739% 4/3/17	300,000.00	322,500.00	-
	STATE OIL AZER 4.75% 3/23 REGS	500,000.00	460,000.00	-
	STATE OIL AZER 5.45% 2/17 RGS	450,000.00	475,290.00	-
	TURK EXIMBNK 5.375% 11/16 144A	400,000.00	413,000.00	-
	TVA 5.5% 6/15/38	4,000.00	4,584.68	-
	TVA 5.88% 4/1/36	40,000.00	48,793.20	-
	UKRZALIZNYTSYA 9.5% 5/18 144A	225,000.00	208,417.50	-
	VEB FIN LTD 6.8% 11/22/25 144A	675,000.00	731,565.00	-
	VEB LPN VNESH 6.902% 7/20 144A	725,000.00	812,000.00	-
	VEB(VNESCIBK)LPN 6.025 7/22 144	400,000.00	420,520.00	-
アメリカ・ドル 小計		85,726,000.00	84,603,205.07 (8,458,628,443)	
イギリス・ポンド	KFW INTL FIN 6%	100,000.00	134,132.00	-
イギリス・ポンド 小計		100,000.00	134,132.00 (20,512,807)	
ユーロ	BAVARIAN SKY SA 1ML+24 6/20	1,000,000.00	1,005,550.00	-
	EXPORT IMP EMTN 2% 4/20 RGS	350,000.00	340,571.00	-
ユーロ 小計		1,350,000.00	1,346,121.00 (177,136,062)	

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
特殊債券 合計			8,656,277,312 (8,656,277,312)	
社債券				
アメリカ・ドル	AAR CORP 7.25% 01/15/2022 144A	2,000,000.00	2,125,000.00	-
	ABC SUPPLY CO 5.625 4/21 144A	115,000.00	115,287.50	-
	ACADEMY LTD/CRP 9.25 8/19 REGS	10,000.00	11,200.00	-
	ACCESS MID PARTNERS 4.875 5/23	145,000.00	142,825.00	-
	ACTUANT CORP 5.625% 6/22 WI	90,000.00	90,900.00	-
	ADARO INDONESIA7.625 10/19 144	750,000.00	783,750.00	-
	ADS WASTE HLD 8.25 10/1/20 144	3,000,000.00	3,127,500.00	-
	AEROPUERTO ARG 10.75 12/20 144	957,600.00	909,720.00	-
	AES CORP 4.875% 05/15/2023	1,135,000.00	1,115,137.50	-
	AES CORP 7.375% 7/01/21 WI	815,000.00	943,362.50	-
	AES CORP 8% 10/15/17	5,000.00	5,825.00	-
	AES CORP 8% 6/1/20	220,000.00	260,150.00	-
	AFFINIA GRP 7.75% 5/1/21 144A	85,000.00	87,975.00	-
	AHERN RENTLS 9.5% 6/15/18 144A	150,000.00	153,750.00	-
	AIR CANADA 5.375 11/15/22 144A	165,000.00	162,525.00	-
	AIR LEASE CORP 4.75% 3/01/2020	3,355,000.00	3,304,675.00	-
	AIRCASTLE LTD 6.25% 12/19 WI	95,000.00	100,700.00	-
	ALBEA BEAUTY 8.375% 11/19 REGS	200,000.00	203,000.00	-
	ALERE INC 6.5% 06/15/2020 144A	1,165,000.00	1,188,300.00	-
	ALFA BNK MTN 7.875% 9/17 REGS	200,000.00	221,000.00	-
	ALLIANCE CORP 5.25% 12/17 144A	500,000.00	520,000.00	-
	ALLIANCE CORP 6.375% 4/20 REGS	55,000.00	57,612.50	-
	ALLY FINANCIAL INC 8% 3/15/20	1,465,000.00	1,754,337.50	-
	ALLY FINL INC 3.5% 07/18/16	7,575,000.00	7,650,750.00	-
	ALLY FINL INC 3ML+268 7/18/16	5,845,000.00	5,874,225.00	-
	ALLY FINL INC 4.625% 6/26/15	35,000.00	36,418.55	-
	ALLY FINL INC 5.5% 2/15/17	60,000.00	63,900.00	-
	ALLY FINL INC 6.25% 12/01/17WI	15,000.00	16,387.50	-
	ALLY FINL INC 7.5% 9/15/20 WI	1,905,000.00	2,238,375.00	-
	ALLY LLC MTN 8% 12/31/18	5,640,000.00	6,570,600.00	-
	ALPHA HLDG CO 7.75% 11/17 WI	30,000.00	31,275.00	-
	ALPHA NAT RES 6% 6/01/19	40,000.00	35,400.00	-
	ALPHA NAT RES 6.25% 6/01/21	135,000.00	117,787.50	-
	ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18	770,000.00	793,100.00	-
	ALROSA FINANCE 7.75% 11/20REGS	800,000.00	878,000.00	-
	ALTICE FINCO 9.875 12/20 144A	545,000.00	588,600.00	-
	ALTICE FING 7.875% 12/19 144A	625,000.00	658,125.00	-
	AM FIN CORP/LLC 6.75% 5/20/20	10,000.00	10,525.00	-
	AM FIN CORP/LLC 7% 5/20/22	5,020,000.00	5,333,750.00	-
	AMC NETWORKS 7.75% 7/15/21 WI	25,000.00	28,187.50	-
	AMC NETWORKS INC 4.75% 12/15/2	60,000.00	59,250.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	AMER AIR 13-1A 4 7/25 144A	220,000.00	210,100.00	-
	AMER AIR 13-1B 5.625 1/21 144A	200,000.00	197,500.00	-
	AMERICAN ROCK 8.25% 5/18 REGS	5,000.00	4,812.50	-
	AMERISTAR CASIN 7.5% 4/15/21	330,000.00	353,100.00	-
	AMR CORP 9%	30,000.00	35,250.00	-
	AMSURG CRP 5.625 11/30/20 WI	300,000.00	305,250.00	-
	ANIXTER INC 5.625% 5/01/19	10,000.00	10,425.00	-
	ANTERO RES FIN 6% 12/1/20 WI	2,665,000.00	2,691,650.00	-
	ANTERO RES FIN 7.25% 8/19	1,000,000.00	1,065,000.00	-
	ARAMARK CORP 5.75 3/15/20 144A	270,000.00	283,500.00	-
	ARD FIN 11.125% 6/01/18 REGS	249,296.00	265,540.11	-
	ARDAGH FN/HLD 9.125 10/20 144A	180,000.00	195,300.00	-
	ARDAGH FN/HLD 9.125 10/20 REGS	200,000.00	217,000.00	-
	ARDAGH PACK 7% 11/15/20 144A	1,320,000.00	1,313,400.00	-
	ARDAGH PKG 4.875 11/15/22 144A	200,000.00	196,000.00	-
	ARDAGH PKG PLC 7.375 10/17 RGS	200,000.00	215,500.00	-
	ARDAGH PKG PLC 9.125 10/20 144	535,000.00	580,475.00	-
	ASBURY AUTO 8.375% 11/20 144A	615,000.00	687,262.50	-
	ASBURY AUTOMOTIVE 8.375% 11/15/20	5,000.00	5,550.00	-
	ASHLAND 3.875% 04/15/18 144A	500,000.00	510,000.00	-
	ASHLAND INC 3.0% 3/15/16 144A	500,000.00	505,000.00	-
	ASHTON WOOD 6.875 2/15/21 144A	645,000.00	657,900.00	-
	ASSOC MATERLS 9.125 11/17 144A	550,000.00	596,750.00	-
	ATLANTIC PWR 9% 11/15/18 WI	1,110,000.00	1,098,900.00	-
	ATLAS PIPE 6.625% 10/20 144A	70,000.00	71,750.00	-
	ATLAS PIPE LP 5.875 8/23 144A	160,000.00	152,000.00	-
	ATLAS PIPELINE 4.75 11/21 144A	335,000.00	309,875.00	-
	ATLAS PIPELINE 6.625 10/20 REGS	5,000.00	5,150.00	-
	ATWOOD-OCEANS INC 6.5% 2/01/20	5,000.00	5,325.00	-
	AUDATEX NA INC 6% 06/15/21 144	3,525,000.00	3,617,531.25	-
	AUDATEX NA INC 6.75% 06/15/18	35,000.00	37,362.50	-
	AURORA USA OIL 9.875 2/17 REGS	80,000.00	85,200.00	-
	AVAYA INC 10.5% 3/01/21 144A	21,903.00	17,412.88	-
	AVAYA INC 7% 4/01/19 144A	2,200,000.00	2,062,500.00	-
	AVAYA INC 7% 4/01/19 REGS	90,000.00	84,375.00	-
	AVAYA INC 9.0% 04/01/2019 144A	1,265,000.00	1,227,050.00	-
	AVIATION CAP 4.625% 1/18 144A	99,000.00	100,188.00	-
	AVIS BUDGET 4.875% 11/17 REGS	135,000.00	138,712.50	-
	AVIS BUDGET CAR 5.5% 4/23 144A	320,000.00	318,400.00	-
	AVIV HEALTHCARE 7.75% 2/15/19	525,000.00	561,750.00	-
	B&G FOODS INC 4.625% 6/01/21	605,000.00	592,900.00	-
	BALL CORP 4.0% 11/15/23	2,675,000.00	2,507,812.50	-
	BANCO DE BOGOTA 5.38 2/23 144A	200,000.00	196,750.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	BANCO DEL ESTD 3.875 2/22 REGS	175,000.00	170,320.50	-
	BANK OF AMERICA 5.2% PERP	5,075,000.00	4,770,500.00	-
	BANK OF GEORGIA 7.75 7/17 REGS	800,000.00	848,000.00	-
	BASIC ENERGY 7.75% 10/22 WI	840,000.00	842,100.00	-
	BASIC ENERGY 7.75% 2/15/19WI	1,540,000.00	1,559,250.00	-
	BBVA PARAGUAY 9.75 2/11/16 144	350,000.00	371,437.50	-
	BC MTN LLC/FIN 7% 2/1/21 144A	45,000.00	46,237.50	-
	BEAZER HOMES 7.25% 2/1/23 144A	110,000.00	113,850.00	-
	BERRY PLASTCS 9.75% 1/15/21	500,000.00	585,000.00	-
	BI-LO LLC/CORP 9.25% 2/19 OCT	25,000.00	27,625.00	-
	BIZ FIN (UKRXBK) 8.375 4/15RGS	1,110,000.00	1,079,475.00	-
	BLUESCOPE STL 7.125% 5/18 144A	90,000.00	92,700.00	-
	BNY MELLON 4.5 % PERP	555,000.00	521,700.00	-
	BOE INTER HLDG 9% 11/1/17 144A	155,000.00	150,678.60	-
	BOISE CASCAD CO 6.375% 11/1/20	10,000.00	10,350.00	-
	BOMBARDIER 4.25% 1/15/16 144A	460,000.00	478,400.00	-
	BON TON DEPT 8.0% 6/15/21 144A	340,000.00	351,900.00	-
	BOYD ACQ LLC/F 8.375 2/18 REGS	5,000.00	5,425.00	-
	BRIGGS & STRATT 6.875 12/15/20	10,000.00	11,100.00	-
	BRISTOW GROUP 6.25% 10/15/22	75,000.00	78,187.50	-
	BROCADE COMM 4.625% 1/23 144A	95,000.00	90,725.00	-
	BROOKFIELD RES 6.125 7/22 144A	455,000.00	464,100.00	-
	BROOKFIELD RESIDENTL PPTYS INC	50,000.00	53,000.00	-
	BRUNSWICK 4.BRUNSWICK CORP 4.6	605,000.00	588,362.50	-
	BUILDNG MATERLS 7% 2/15/20 144	575,000.00	621,000.00	-
	BUILDNG MATRLS 6.75% 5/21 144A	1,465,000.00	1,582,200.00	-
	BURLINGTON PIK 9.0% 2/18 144A	125,000.00	129,687.50	-
	CAESARS ENTMT 12.75 4/15/18 WI	25,000.00	16,875.00	-
	CAESARS LLC 9% 2/15/20 144A	1,000,000.00	953,750.00	-
	CAESARS LLC/ CO 9 8/15/20 REGS	30,000.00	28,612.50	-
	CAESARS LLC/CO 8.5% 2/15/20 WI	3,115,000.00	2,931,993.75	-
	CALCIPAR 6.875% 5/01/18 REGS	200,000.00	207,500.00	-
	CALPINE CORP 7.5% 2/15/21 144A	1,025,000.00	1,122,375.00	-
	CALPINE CORP 7.875% 1/23 144A	2,860,000.00	3,203,200.00	-
	CALPINE CORP 7.875% 1/23 REGS	64,000.00	71,680.00	-
	CARRIZO OIL&GAS 8.625% 10/15 WI	10,000.00	10,900.00	-
	CASELLA WASTE S 7.75% 2/15/19	75,000.00	72,750.00	-
	CATALENT PHAR 7.875 10/18 REGS	20,000.00	20,200.00	-
	CB RICHARD 6.625% 10/15/20	10,000.00	10,750.00	-
	CB RICHARD ELLIS 5.0% 3/15/23	465,000.00	454,537.50	-
	CBOM FIN PLC 8.25% 8/5/14	400,000.00	413,600.00	-
	CC HOLDINGS 2.381% 12/15/17 WI	1,000,000.00	986,740.00	-
	CC HOLDINGS 3.849% 4/15/23 WI	1,000,000.00	936,600.00	-
	CCO HLDGS LLC 5.125% 2/15/23	1,875,000.00	1,762,500.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	CCO HLDGS LLC 5.25% 3/21 144A	5,305,000.00	5,185,637.50	-
	CCO HLDGS LLC 5.75% 01/15/24	4,620,000.00	4,412,100.00	-
	CCO HLDGS LLC 5.75% 9/23 144A	210,000.00	203,700.00	-
	CCO HLDGS/CAP 5.25% 9/30/22	200,000.00	191,500.00	-
	CCO HLDGS/CAP 7.25% 10/30/17	30,000.00	31,912.50	-
	CCO HLDGS/CAP CORP 7% 1/01/19	10,000.00	10,625.00	-
	CCO HLDGS/CAP CRP 6.5% 4/30/21	750,000.00	791,250.00	-
	CDW LLC/CDW FIN 8.5% 4/01/19	35,000.00	38,762.50	-
	CEDAR FAIR 5.25% 3/15/21 144A	395,000.00	387,100.00	-
	CELANESE LLC 4.625% 11/15/22	60,000.00	58,950.00	-
	CEMEX FIN 9.375% 10/12/22 144A	1,150,000.00	1,273,625.00	-
	CEMEX FIN 9.375% 10/12/22 REGS	400,000.00	443,000.00	-
	CEMEX SAB 3ML+500 9/30/15 144A	945,000.00	963,900.00	-
	CEMEX SAB 5.875% 3/25/19 144A	1,535,000.00	1,519,650.00	-
	CENTENE CORP 5.75 6/1/17	250,000.00	264,375.00	-
	CEQUEL COMM 5.125% 12/21 144A	1,500,000.00	1,434,375.00	-
	CEQUEL LLC/CRP 6.375 9/20 144A	1,000,000.00	1,042,500.00	-
	CEQUEL LLC/CRP 6.375 9/20 REGS	10,000.00	10,425.00	-
	CERIDIAN CORP 11% 3/15/21 144A	150,000.00	171,750.00	-
	CERIDIAN CORP 8.875 7/19 REGS	15,000.00	17,100.00	-
	CEVA GROUP PLC 8.375 12/17 RGS	75,000.00	73,875.00	-
	CHAPARRAL ENE 7.625 11/22 WI	290,000.00	297,250.00	-
	CHASSIX INC 9.25% 8/1/18 144A	325,000.00	335,562.50	-
	CHECKOUT CRP 0% 11/15/15 REGS	10,000.00	7,950.00	-
	CHEMTURA CORP 5.75% 07/15/21	420,000.00	423,150.00	-
	CHESAPEAKE ENER 9.5% 2/15/15	20,000.00	22,150.00	-
	CHESAPEAKE ENERGY 3.25 3/15/16	1,510,000.00	1,517,550.00	-
	CHESAPEAKE ENERGY 5.75 3/15/23	365,000.00	380,056.25	-
	CHESAPEAKE ENERGY 6.125% 2/21	140,000.00	152,600.00	-
	CHESAPEAKE ENRGY 5.375 6/15/21	3,370,000.00	3,462,675.00	-
	CHESTER LLC/FIN 9.25 1/20 REGS	5,000.00	5,025.00	-
	CHOICE HOTELS 5.75% 7/01/22	5,000.00	5,275.00	-
	CHS/CMNTY HEALT 5.125% 8/15/18	20,000.00	20,550.00	-
	CHS/CMNTY HEALT 7.125% 7/15/20	20,000.00	20,300.00	-
	CHUKCHANSI ECON 9.75% 5/20 RGS	28,827.42	15,278.53	-
	CINEMARK 5.125% 12/15/22 WI	1,365,000.00	1,341,112.50	-
	CINEMARK USA 4.875% 6/23 144A	1,150,000.00	1,104,000.00	-
	CINEMARK USA 7.375% 6/15/21WI	5,000.00	5,512.50	-
	CIT 6.625% 4/01/18 REGS	35,000.00	38,850.00	-
	CIT GROUP NEW 4.25% 8/15/17	1,040,000.00	1,072,500.00	-
	CIT GROUP NEW 4.75 2/15 144A	19,481,000.00	20,162,835.00	-
	CIT GROUP NEW 4.75 2/15 REGS	500,000.00	517,500.00	-
	CIT GROUP NEW 5% 8/15/22	35,000.00	35,684.95	-
	CIT GROUP NEW 5.25% 3/15/18	35,000.00	37,012.50	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	CIT GROUP NEW 5.375% 5/15/20	35,000.00	37,237.20	-
	CIT GROUP NEW 5.5 2/15/19 REGS	600,000.00	641,250.00	-
	CITIGROUP 1.25% 1/15/16	5,000,000.00	4,967,850.00	-
	CITIGROUP 5.35% PERP	8,115,000.00	7,668,675.00	-
	CITIGROUP 5.95% PERP	85,000.00	85,000.00	-
	CITIGROUP INC 5.9 PFD	445,000.00	443,887.50	-
	CITIZENS COMM 7.875% 1/15/27	300,000.00	293,250.00	-
	CLAIRE'S STORES 6.125 03/15/20	2,260,000.00	2,293,900.00	-
	CLAIRE'S STORES 9% 3/19 144A	1,000,000.00	1,125,000.00	-
	CLAIRE'S STORES 9% 3/19 REGS	50,000.00	56,250.00	-
	CLAIRES STORE 9% SEP 3/19 REGS	120,000.00	135,000.00	-
	CLAIRES STORES 7.75% 6/20 144A	215,000.00	218,225.00	-
	CLAIRES STORES 8.875% 3/15/19	1,885,000.00	2,024,018.75	-
	CLEAN HARBORS 5.25% 8/20 WI	15,000.00	15,600.00	-
	CLEAN HARBORS INC 5.12% 6/1/21	50,000.00	51,750.00	-
	CLEAR CHANNEL 4.9% 5/15/15	3,530,000.00	3,379,975.00	-
	CLEAR CHANNEL 5.5 9/15/14	205,000.00	204,487.50	-
	CLEAR CHANNEL 7.625 3/20 WI	45,000.00	48,600.00	-
	CLEAR CHANNEL 7.625 3/20 WI	5,000.00	5,350.00	-
	CLEAR CHANNEL A 6.5% 11/22 WI	335,000.00	353,425.00	-
	CLEAR CHANNEL B 6.5% 11/22 WI	95,000.00	101,175.00	-
	CLEARWATER PAPER CRP 4.5% 2/23	150,000.00	143,250.00	-
	CLEARWIRE CORP 12% 12/15 144A	985,000.00	1,046,562.50	-
	CLEARWIRE CORP 12% 12/15 REGS	75,000.00	79,687.50	-
	CLEARWIRE ESCROW 12 12/15 REGS	40,000.00	42,500.00	-
	CLEARWR CM/FN 14.75 12/16 144A	1,746,000.00	2,400,750.00	-
	CLIFFS NATURL RES 4.875 4/1/21	100,000.00	91,655.00	-
	CNH CAP LLC 3.875% 11/01/15	3,040,000.00	3,116,000.00	-
	CNH CAPITAL 3.625 4/15/18 144A	4,070,000.00	4,039,475.00	-
	CNO FIN GROUP 6.375 10/20 REGS	10,000.00	10,650.00	-
	CODELCO 6.15% 10/36 144A	400,000.00	443,920.00	-
	CODELCO INC 3% 7/17/22 144A	200,000.00	185,586.00	-
	COGECO CABL 4.875% 5/1/20 144A	210,000.00	207,375.00	-
	COMMSCOPE PIK 6.625% 6/20 144A	275,000.00	273,625.00	-
	COMPUCOM SYSTEMS 7% 5/21 144A	80,000.00	78,400.00	-
	CONCHO RES INC 5.5% 4/01/23	590,000.00	607,700.00	-
	CONSOL ENERGY 6.375% 3/01/21WI	2,000,000.00	2,020,000.00	-
	CONSOL ENERGY 8.25 4/1/20 WI	620,000.00	663,400.00	-
	CONSOLIDATED 10.125% 7/20 REGS	10,000.00	10,550.00	-
	CONSTELLATION 6% 5/01/22	180,000.00	197,550.00	-
	CONSTELLATION BRANDS 3.75 5/21	150,000.00	143,445.00	-
	CONSTELLATION BRANDS 4.25 5/23	2,150,000.00	2,093,670.00	-
	CONTINENTAL 7.125% 4/1/21 WI	10,000.00	11,050.00	-
	CONTINENTAL AIR LINES INC 6.12	35,000.00	35,525.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	CONTINENTAL OK 5% 9/15/22 WI	185,000.00	191,012.50	-
	CONTINENTAL RES 4.5% 4/23 WI	575,000.00	575,000.00	-
	CONTL RUBBER 4.5% 9/15/19 REGS	150,000.00	151,935.00	-
	CORRECTIONS COR 4.125% 4/01/20	435,000.00	430,650.00	-
	CORRECTIONS COR 4.625% 5/01/23	485,000.00	481,362.50	-
	COSAN LUXEM 5.0% 03/14/23 144A	200,000.00	190,000.00	-
	COSAN OVERSEAS 8.25% PERP	350,000.00	360,937.50	-
	COVANTA HLDG 6.375% 10/01/22	10,000.00	10,374.70	-
	COVANTA HLDG 7.25% 12/01/20	10,000.00	10,840.80	-
	CRESTWOOD M P/F 7.75% 4/01/19	65,000.00	68,412.50	-
	CROWN AMER IV 4.5 1/15/23 144A	1,180,000.00	1,135,750.00	-
	CROWN AMERS/CAP 6.25% 2/01/21	20,000.00	21,200.00	-
	CROWN CASTLE IL 5.25 1/15/23	45,000.00	44,212.50	-
	CSC HLDGS LLC 6.75% 11/15/2021	3,815,000.00	4,272,800.00	-
	CSN ISLANDS XII 7% PERP REGS	1,180,000.00	1,005,950.00	-
	CST BRANDS INC 5% 5/1/23 144A	130,000.00	130,325.00	-
	CVR REF/COFFEY 6.5 11/22 REGS	115,000.00	113,562.50	-
	CYRUSONE LP/CYRUS 6.375% 11/22	40,000.00	41,600.00	-
	DAVITA INC 5.75% 8/15/22	20,000.00	20,750.00	-
	DAVITA INC 6.625% 11/01/20	15,000.00	16,012.50	-
	DELPHI CORP 5% 02/15/2023	195,000.00	204,750.00	-
	DELPHI CRP&WALS 5.875% 5/19 WI	20,000.00	21,475.00	-
	DELPHI CRP&WALS 6.125% 5/21 WI	20,000.00	22,000.00	-
	DENBURY RES DEL 8.25% 2/15/20	120,000.00	133,200.00	-
	DENBURY RESOURCE 4.625 7/15/23	4,590,000.00	4,349,025.00	-
	DIGICEL GROUP 8.25% 9/20 REGS	465,000.00	488,250.00	-
	DIGICEL LTD 6.0% 4/15/21 144A	4,985,000.00	4,860,375.00	-
	DIGITALGLOBE 5.25% 2/1/21 144A	750,000.00	723,750.00	-
	DISH CORP 5% 03/15/23 WI	2,235,000.00	2,162,362.50	-
	DISH DBS 4.25% 4/1/18 144A	7,215,000.00	7,215,000.00	-
	DISH DBS 5.125% 5/1/20 144A	1,190,000.00	1,190,000.00	-
	DISH DBS CORP 5.875% 7/22	5,040,000.00	5,191,200.00	-
	DISH DBS CORP 6.75% 6/01/21 WI	35,000.00	37,843.75	-
	DISNEY(WALT) MTN 1.1% 12/1/17	50,000.00	49,101.50	-
	DISNEY(WALT)MTN 2.35 12/01/22	100,000.00	93,627.00	-
	DISPENSING DYN 12.5 1/18 144A	455,000.00	462,962.50	-
	DJO FIN LLC/CO 8.75% 03/15/18	5,000.00	5,400.00	-
	DJO FIN LLC/CO 9.875% 4/15/18	10,000.00	10,550.00	-
	DNB BOLIGKRED 1.45 3/19 144A	250,000.00	244,475.00	-
	DR HORTON INC 3.625% 2/15/2018	1,000,000.00	997,500.00	-
	DR HORTON INC 4.375% 9/15/22	25,000.00	24,062.50	-
	EAGLE SPINCO 4.625 2/21 144A	75,000.00	74,062.50	-
	EHOSTAR DBS 6.625% 10/01/14	115,000.00	120,750.00	-
	EHOSTAR DBS 7.75 5/31/15	20,000.00	21,750.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	EDGEN MURRAY 8.75% 11/20 REGS	25,000.00	25,375.00	-
	EDISON MISSION 7% 5/15/17	5,000.00	3,100.00	-
	EL FONDO MIVI 3.5 1/31/23 144A	575,000.00	506,000.00	-
	EMP DIST 9.75% 10/25/22 144A	965,000.00	465,612.50	-
	ENERGY FUT 6.875 8/15/17 REGS	290,000.00	297,975.00	-
	ENERGY FUT 10% 12/1/20 144A	5,000,000.00	5,537,500.00	-
	ENERGY FUT 10% 12/1/20 WI REGS	940,000.00	1,041,050.00	-
	ENERGY FUT CO 10% 12/01/20	170,000.00	188,487.50	-
	ENERGY FUT CO 11% 10/01/21	81,000.00	88,087.50	-
	ENERGY FUT CO 11.75 3/22 144A	10,095,000.00	11,382,112.50	-
	ENERGY FUT CO 11.75 3/22 REGS	175,000.00	197,312.50	-
	ENERGY PART LTD 8.25% 2/15/18	160,000.00	170,000.00	-
	ENERGY TRANS EQ 7.5% 10/15/20	35,000.00	40,556.25	-
	ENERGY TRANSFER 9% 4/15/19	10,000.00	12,828.30	-
	ENTERTAINMENT 7.75% 7/15/20 WI	65,000.00	73,762.65	-
	ENVISION HEALTHCARE 8.125% 6/1/19	25,000.00	27,218.75	-
	EP ENERGY/EVER 7.75% 09/22 WI	15,000.00	16,612.50	-
	EPE HLDS PIK 8.125 12/17 144A	2,226,582.00	2,270,245.27	-
	EQUINIX INC 4.875% 4/1/20	270,000.00	271,350.00	-
	ESAL GMBH 6.25% 02/05/23 144A	4,400,000.00	4,037,000.00	-
	EUROCHEM 5.125% 12/12/17 144A	300,000.00	303,000.00	-
	EVEREST LLC/FIN 6.875% 5/19 WI	20,000.00	21,600.00	-
	EVEREST LLC/FIN 9.375% 5/20 WI	80,000.00	91,800.00	-
	EVRAZ GROUP 6.5% 4/22/20 144A	225,000.00	208,417.50	-
	EVRAZ GROUP 9.5 4/24/18 REGS	225,000.00	244,867.50	-
	EVRAZ GRP 8.25% 11/10/15 144A	1,150,000.00	1,230,500.00	-
	EXPRO FINANCE 8.5% 12/16 144A	290,000.00	305,950.00	-
	FELCOR LODGNG 5.625 03/23 WI	1,545,000.00	1,506,375.00	-
	FERRELLGAS LP 6.5% 5/1/21 WI	15,000.00	15,393.75	-
	FIDLT & GTY 6.375 4/1/21 144A	2,000,000.00	2,030,000.00	-
	FINANSBANK 5.15% 11/1/17 144A	820,000.00	802,575.00	-
	FINANSBANK AS 5.5% 5/11/16REGS	750,000.00	757,500.00	-
	FIRST DATA 10.625 6/15/21 144A	1,000,000.00	1,030,000.00	-
	FIRST DATA 11.25 1/15/21 144A	615,000.00	645,750.00	-
	FIRST DATA 11.75% 8/21 144A	695,000.00	679,362.50	-
	FIRST DATA 6.75% 11/1/20 144A	2,885,000.00	3,043,675.00	-
	FIRST DATA 6.75% 11/1/20 REGS	355,000.00	374,525.00	-
	FIRST DATA 6.75% 11/1/20 SEPT	50,000.00	52,750.00	-
	FIRST DATA 7.375% 6/15/19 144A	1,300,000.00	1,384,500.00	-
	FIRST DATA 7.375% 6/15/19 REGS	200,000.00	213,000.00	-
	FIRST QLT FN 4.625% 5/21 144A	130,000.00	126,100.00	-
	FIRSTENERGY CORP 2.75% 3/15/18	518,000.00	508,489.52	-
	FIRSTENERGY CORP 4.25% 3/15/23	334,000.00	318,686.10	-

次へ

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	FLEXTRONICS 4.625% 2/20 144A	195,000.00	195,000.00	-
	FMG RES 6% 4/1/17 REGS	120,000.00	120,900.00	-
	FMG RES 6.875% 4/01/22 144A	2,000,000.00	2,000,000.00	-
	FMG RES 6.875% 4/01/22 REGS	20,000.00	20,000.00	-
	FMG RES AUG 8.25% 11/1/19 144A	500,000.00	531,250.00	-
	FMG RES AUG LTD 6.375 2/16 144	20,000.00	20,400.00	-
	FMG RES AUG LTD 6.375 2/16REGS	85,000.00	86,700.00	-
	FMG RES AUG LTD 7% 11/15 144A	8,550,000.00	8,806,500.00	-
	FMG RES AUG LTD 7% 11/15 REGS	30,000.00	30,900.00	-
	FORBES ENERGY SERVS 9% 6/15/19	3,065,000.00	3,061,168.75	-
	FORD MOTOR 6.375%	15,000.00	16,507.80	-
	FORD MOTOR 6.625% 10/01/28	20,000.00	22,645.60	-
	FORD MOTOR 6.625% 2/15/28	25,000.00	27,681.25	-
	FORD MOTOR 7.45%	5,000.00	6,143.80	-
	FORD MOTOR CO 4.75% 1/15/43	1,000,000.00	912,060.00	-
	FORD MOTOR CR 6.625% 8/15/17	50,000.00	57,013.50	-
	FORD MTR CR LLC 2.375% 1/16/18	2,145,000.00	2,102,614.80	-
	FORD MTR CR LLC 4.25% 2/03/17	80,000.00	84,409.60	-
	FORD MTR CR LLC 5.75% 2/01/21	105,000.00	115,816.05	-
	FORD MTR CR LLC 5.875% 8/2/21	95,000.00	105,936.40	-
	FORD MTR CREDIT CO 8% 12/15/16	80,000.00	93,684.00	-
	FOREST OIL 7.25% 6/15/19	2,050,000.00	2,039,750.00	-
	FOREST OIL 7.5% 9/15/20 REGS	30,000.00	29,775.00	-
	FREESCALE SC 9.25 4/15/18 144A	15,000.00	16,200.00	-
	FREESCALE SC 9.25 4/15/18 REGS	195,000.00	210,600.00	-
	FREESCALE SEMI 5% 5/15/21 144A	2,000,000.00	1,950,000.00	-
	FREESCALE SEMI 10.125 3/18 REGS	30,000.00	32,625.00	-
	FRESENIUS MC II 6.5% 9/18 REGS	10,000.00	11,100.00	-
	FRESENIUS US FN II 9 7/15 REGS	15,000.00	16,725.00	-
	FRONTIER COMM 7.125% 1/15/23	3,195,000.00	3,230,943.75	-
	FRONTIER COMM 7.625% 4/15/24	610,000.00	631,350.00	-
	FRONTIER COMM MTN 8.125% 10/18	45,000.00	50,287.50	-
	FRONTIER COMM MTN 8.75% 4/22	155,000.00	172,243.75	-
	FTI CONSULTING 6 11/15/22 144A	500,000.00	513,750.00	-
	FTI CONSULTING 6 11/15/22 REGS	75,000.00	77,062.50	-
	GAJAH TUNGGAL 7.75 2/18 144A	400,000.00	403,000.00	-
	GARDA WORLD SEC 9.75% 03/15/17	2,000,000.00	2,110,000.00	-
	GAZ CAPITAL SA 9.25% 4/19 144A	750,000.00	922,500.00	-
	GENCORP 7.125% 3/15/21 144A	40,000.00	42,500.00	-
	GENERAL MTR 2.75% 5/15/16 144A	565,000.00	565,706.25	-
	GENERAL MTR 4.25% 5/15/23 144A	720,000.00	701,100.00	-
	GENERAL MTR 4.75% 8/15/17 REGS	305,000.00	321,393.75	-
	GENERAL MTRS 3.25% 5/18 144A	305,000.00	301,187.50	-
	GENERAL MTRS 6.75% 6/1/18	1,835,000.00	2,066,668.75	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	GENESIS ENR 5.75% 2/15/21	80,000.00	80,400.00	-
	GENON ENERGY INC 9.5% 10/18	820,000.00	951,200.00	-
	GENON ENERGY INC 9.875 10/20 WI	740,000.00	843,600.00	-
	GEO GROUP 5.125% 4/1/23 144A	115,000.00	115,000.00	-
	GEORGIA GULF 4.875 5/23 144A	45,000.00	43,987.50	-
	GEORGIAN OIL&G 6.875 5/17 144A	730,000.00	745,549.00	-
	GIBSON ENERGY 6.75% 7/21 144A	2,065,000.00	2,101,137.50	-
	GLOBO COMS PT 6.25% PERP 144A	790,000.00	831,475.00	-
	GMAC 8% GLOBAL	6,625,000.00	8,057,656.25	-
	GMAC LLC MTN 8% 11/01/31	16,894,000.00	20,821,855.00	-
	GOLD FLD OR 4.875% 10/20 144A	600,000.00	486,000.00	-
	GRAPHIC PACKAGING 4.75 4/15/21	110,000.00	106,700.00	-
	GRAPHIC PACKG 7.875% 10/1/18	10,000.00	10,800.00	-
	GRATON ECONOMC 9.625 9/19 REGS	20,000.00	22,400.00	-
	GRAY TELEVISION 7.5% 10/20 WI	160,000.00	166,400.00	-
	GRUMA SAB 7.75 PERP REGS	400,000.00	400,000.00	-
	GTB FINANCE BV 7.5 5/19/16	200,000.00	210,000.00	-
	GULFMARK OFFSHO 6.375% 3/15/22	160,000.00	160,000.00	-
	HALCON RES CORP 8.875% 5/21 WI	30,000.00	31,350.00	-
	HARBINGER GRP 7.875 07/19 144A	4,855,000.00	5,000,650.00	-
	HARRAHS OPER 11.25 6/01/17	75,000.00	79,031.25	-
	HARRON LP/FIN 9.125 4/20 144A	535,000.00	588,500.00	-
	HAWK ACQ 4.25% 10/15/20 144A	21,155,000.00	20,864,118.75	-
	HCA HLDGS INC 6.25% 2/15/21	2,870,000.00	3,035,025.00	-
	HCA HLDGS INC 7.75% 5/15/21	160,000.00	176,000.00	-
	HCA INC 4.75% 5/01/23	15,645,000.00	15,566,775.00	-
	HCA INC 5.875% 3/15/22	1,835,000.00	1,968,037.50	-
	HCA INC 5.875% 5/01/23	65,000.00	67,762.50	-
	HCA INC 6.5% 2/15/20	315,000.00	355,950.00	-
	HD SUPPLY INC 10.5% 1/15/21 WI	85,000.00	87,550.00	-
	HD SUPPLY INC 11% 4/15/2020	35,000.00	42,262.50	-
	HD SUPPLY INC 8.125% 4/19 WI	35,000.00	39,462.50	-
	HEALTHSOUTH 5.75% 11/01/24	3,102,000.00	3,074,857.50	-
	HEALTHSOUTH 7.25% 10/1/18	23,000.00	24,610.00	-
	HEALTHSOUTH 7.75% 9/15/22	22,000.00	23,650.00	-
	HERTZ CORP 4.25% 4/1/2018 144A	1,910,000.00	1,847,925.00	-
	HERTZ CORP 5.875% 10/15/2020	20,000.00	21,350.00	-
	HERTZ CORP 6.25% 10/15/22	15,000.00	16,237.50	-
	HEXION US 6.625% 4/15/20 144A	330,000.00	343,200.00	-
	HILAND PRTNRS 7.25 10/20 144A	140,000.00	147,350.00	-
	HILAND PRTNRS 7.25 10/20 REGS	10,000.00	10,525.00	-
	HOLOGIC INC 6.25% 8/01/20	20,000.00	21,325.00	-
	HORNBECK OFFS 5.875% 4/20 WI	15,000.00	15,300.00	-
	HORNBECK OFFSHORE 5% 3/21 144A	1,910,000.00	1,852,700.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	HOST HOTELS 4.75% 3/01/23	20,000.00	20,238.80	-
	HOT TOPIC 9.25% 06/15/21 144A	485,000.00	504,400.00	-
	HOVNANIAN K 7.25% 10/20 REGS	160,000.00	173,600.00	-
	HRVATSKA ELEK 6% 11/9/17 144A	200,000.00	200,000.00	-
	HSBK EUROPE BV 7.25 5/17 144A	500,000.00	530,100.00	-
	HUGHES SATELLIT 7.625% 6/21 WI	55,000.00	59,675.00	-
	HUNTINGTON INC 6.875% 3/18 WI	265,000.00	290,175.00	-
	HUNTSMAN INTL 4.875% 11/15/20	260,000.00	262,600.00	-
	IAC/INTERACTIV 4.75% 12/22 WI	5,135,000.00	4,891,087.50	-
	ICAHN ENT/FIN 8% 1/15/18 WI	15,000.00	15,862.50	-
	ICAHN ENTFIN 7.75% 1/15/16 WI	45,000.00	46,743.75	-
	ILFC 4.875% 4/01/15	15,000.00	15,600.00	-
	ILFC 5.875% 4/01/19	690,000.00	734,850.00	-
	ILFC 5.875% 8/15/22	6,755,000.00	6,957,650.00	-
	ILFC 8.25% 12/15/20	3,703,000.00	4,355,653.75	-
	ILFC 8.625% 1/15/22	4,331,000.00	5,175,545.00	-
	ILFC MTN 6.75% 9/1/16 REGS	20,000.00	22,100.00	-
	ILFC MTN 7.125% 9/1/18 REGS	65,000.00	73,937.50	-
	IMS HEALTH INC 6 11/01/20 REGS	20,000.00	20,750.00	-
	INDO ENERGY FIN 7% 5/07/18 RGS	400,000.00	393,000.00	-
	INDO ENERGY FIN 7% 5/18 144A	450,000.00	442,125.00	-
	INDO ENRGY 6.375% 1/24/23 144A	400,000.00	352,000.00	-
	INDOSAT PALAPA 7.375 7/20 144A	360,000.00	393,300.00	-
	INEOS FINANCE 7.5% 5/1/20 REGS	70,000.00	76,300.00	-
	INEOS FINANCE 8.375 2/19 REGS	200,000.00	222,000.00	-
	INERGY MID/NRGM 6% 12/20 144A	110,000.00	111,650.00	-
	INFOR US INC 9.375% 4/19 WI	10,000.00	11,100.00	-
	INTELSAT 6.625% 12/15/22 144A	7,560,000.00	7,711,200.00	-
	INTELSAT 6.625% 12/15/22 REGS	50,000.00	51,000.00	-
	INTELSAT J H SA 7.5% 4/01/21	45,000.00	49,162.50	-
	INTELSAT JACK 6.625 12/22 144A	3,000,000.00	3,060,000.00	-
	INTELSAT JACKSON 5.5 8/23 144A	1,795,000.00	1,781,537.50	-
	INTELSAT JH SA 7.25% 10/15/20	1,050,000.00	1,136,625.00	-
	INTELSAT SA 7.75% 6/1/21 144A	5,960,000.00	6,362,300.00	-
	INTELSAT SA 8.125% 6/1/23 144A	1,575,000.00	1,712,812.50	-
	INTERGAS FIN 6.375% 5/14/17RGS	550,000.00	591,250.00	-
	INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	4,160,000.00	4,191,200.00	-
	INTERLINE BRD INC 10 11/15/18	5,000.00	5,450.00	-
	INTL LEAS FIN CRP 8.75 3/15/17	15,000.00	17,325.00	-
	INTL LEASE FIN 3.875% 4/15/18	1,070,000.00	1,048,600.00	-
	INTL LEASE FIN 4.625% 4/15/21	1,495,000.00	1,446,412.50	-
	INTL LEASE FIN 5.65 6/1/14	70,000.00	71,925.00	-
	INTL LEASE FIN 5.75% 5/15/16	20,000.00	21,261.60	-
	INTL LEASE FIN 6.25% 5/15/19	750,000.00	814,687.50	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	INTL LEASE FIN 8.625% 9/15 WI	10,000.00	11,150.00	-
	INTL LEASE FINANCE 6.625 11/13	25,000.00	25,343.75	-
	INTL LEASE FN 3ML+ 195 6/15/16	1,405,000.00	1,397,975.00	-
	INTL LEASE MTN 5.625% 9/20/13	20,000.00	20,100.00	-
	IPALCO 7.25% 4/01/16 REGS	25,000.00	27,750.00	-
	IRON MOUNTAIN 5.75% 8/15/24	15,000.00	14,700.00	-
	ISTAR FINANCIAL 7.125% 2/15/18	275,000.00	292,187.50	-
	J2 GLOBAL INC 8% 8/01/20 WI	115,000.00	123,050.00	-
	JABIL CIRCUIT 5.625% 12/20	10,000.00	10,525.00	-
	JAGUAR CO/MERGE 9.5 12/19 REGS	5,000.00	5,650.00	-
	JAGUAR HD PIK 9.375 10/17 REGS	20,000.00	21,500.00	-
	JEFFERIES FIN 7.375% 4/20 144A	200,000.00	200,000.00	-
	JO ANN PIK 9.75% 10/15/19 REGS	25,000.00	26,250.00	-
	JPMORGAN CHASE 5.15% PERP	1,415,000.00	1,354,862.50	-
	K HOVNANIAN 9.125% 11/20 REGS	80,000.00	88,400.00	-
	KAZAGRO NT 4.625% 5/24/23 144A	200,000.00	186,000.00	-
	KAZAKHSTAN TEMIR 6.95 7/42 RGS	200,000.00	207,020.00	-
	KAZKOMMERTS 7.875% 4/7/14 REGS	550,000.00	551,375.00	-
	KAZMUNAIGAZ FIN 7% 5/05/20 144	550,000.00	632,500.00	-
	KAZMUNAIGAZ FIN9.125 7/18 144A	800,000.00	980,000.00	-
	KAZMUNAIGZ FI 6.375% 4/21 144A	500,000.00	555,000.00	-
	KAZMUNAYGAS 4.4% 04/30/23 144A	455,000.00	428,564.50	-
	KAZMUNAYGAS 5.75% 4/30/43 144A	655,000.00	595,264.00	-
	KENAN ADV 8.375% 12/15/18 144A	90,000.00	93,600.00	-
	KEY ENERGY SRVS 6.75% 3/1/21	10,000.00	9,675.00	-
	KODIAK OIL 5.5% 1/15/21 144A	55,000.00	56,237.50	-
	KRATON POLY 6.75% 3/1/19 WI	140,000.00	142,800.00	-
	LAMAR MEDIA CRP 5% 05/01/23	75,000.00	73,687.50	-
	LAMAR MEDIA CRP 5.875% 2/22	5,000.00	5,262.50	-
	LANDRYS HLDG 10.25 1/1/18 144A	1,585,000.00	1,695,950.00	-
	LANDRYS INC 9.375 5/1/20 144A	3,285,000.00	3,564,225.00	-
	LANDRYS INC 9.375 5/1/20 REGS	10,000.00	10,850.00	-
	LAUREATE ED 9.25% 9/1/19 NOV	180,000.00	194,400.00	-
	LBC TANK TRM 6.875 5/15/23 144	200,000.00	203,500.00	-
	LEAR CORP 4.75% 01/15/2023 144	135,000.00	131,962.50	-
	LEGACY RESVS 6.625% 12/21 144A	2,000,000.00	1,930,000.00	-
	LEGACY RSVS/FIN 8% 12/20 144A	750,000.00	761,250.00	-
	LEGEND ACQ SUB 10.75 8/20 REGS	50,000.00	40,250.00	-
	LENNAR CORP 4.125 12/1/18 144A	1,295,000.00	1,278,812.50	-
	LENNAR CORP 4.75 11/15/22 144A	3,000,000.00	2,910,000.00	-
	LENNAR CORP 4.75 11/15/22 REGS	140,000.00	135,800.00	-
	LENNAR CORP 4.75% 12/17 WI	100,000.00	103,750.00	-
	LENNAR CORP 5.6% 5/31/15	20,000.00	21,200.00	-
	LEVEL 3 COMM 8.875 6/1/19 WI	5,000.00	5,362.50	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	LEVEL 3 FIN 7% 6/01/20 WI	1,145,000.00	1,190,800.00	-
	LEVEL 3 FINANC 8.125% 7/19 WI	30,000.00	32,550.00	-
	LEVI STR 6.875% 5/01/22 WI	210,000.00	231,525.00	-
	LIN TELEVISION 6.375% 1/21 WI	150,000.00	156,000.00	-
	LINN ENERGY 6.25 11/1/19 144A	3,000,000.00	2,880,000.00	-
	LINN ENERGY 6.25 11/1/19 REGS	140,000.00	134,400.00	-
	LINN ENERGY LLC 7.75% 2/01/21	35,000.00	35,787.50	-
	LINN ENERGY LLC 8.625 4/20 WI	80,000.00	85,000.00	-
	LISTRINDO CAP BV 6.95 2/19 144	450,000.00	468,000.00	-
	LKQ CORP 4.75% 05/15/23 144A	115,000.00	111,550.00	-
	LREATE ED INC9.25% 9/1/19 144A	2,115,000.00	2,284,200.00	-
	LUCEENT TECH 6.5%	80,000.00	60,600.00	-
	LUCENT 6.45% GBL 3/15/29 (DT)	150,000.00	115,125.00	-
	LYNX I CORP 5.375% 2/21 144A	200,000.00	204,000.00	-
	LYNX II CORP 6.375% 4/23 144A	200,000.00	207,000.00	-
	MAGNESITA FIN 8.625% PERP 144A	250,000.00	243,750.00	-
	MAJAPAHIT HLDG 7.75% 1/20 144A	425,000.00	478,125.00	-
	MARKWEST EN PAR 5.5% 2/15/23	10,000.00	10,375.00	-
	MARKWEST ENER LP/ FN 4.5 7/23	920,000.00	906,200.00	-
	MASCO CORP 5.95% 3/15/22	35,000.00	36,750.00	-
	MASCO CORP MTN 7.125% 3/15/20	2,685,000.00	3,007,200.00	-
	MASSEY ENERGY CV 3.25% 8/1/15	10,000.00	9,400.00	-
	MASTEC INC 4.875% 03/15/2023	1,185,000.00	1,125,750.00	-
	MATTEL INC 1.7% 3/18	100,000.00	97,965.00	-
	MCE FINANCE 5.0% 2/15/21 144A	5,520,000.00	5,354,400.00	-
	MCGRAW-HILL GLB 9.75 4/21 144A	2,395,000.00	2,508,762.50	-
	MDC HLDGS INC 6.0% 01/15/2043	2,690,000.00	2,421,000.00	-
	MDC PARTNERS 6.75% 4/1/20 144A	255,000.00	262,650.00	-
	MEDIACOM BD 6.375% 4/23 WI	80,000.00	80,000.00	-
	MERCER INTL 9.5% 12/01/17 WI	2,000,000.00	2,120,000.00	-
	MET LIFE GLBL 3% 1/10/23 144A	100,000.00	95,765.00	-
	METINVEST BV 10.25 5/20/15 144	775,000.00	792,437.50	-
	METROPCS WIR 6.25% 4/1/21 144A	3,500,000.00	3,648,750.00	-
	METROPCS WIR 6.625 4/1/23 144A	965,000.00	1,006,012.50	-
	METROPCS WIREL 7.875% 9/1/18	55,000.00	60,087.50	-
	MGM MIRAGE INC 5.875%	790,000.00	807,775.00	-
	MGM RESORTS INT 6.625 12/15/21	85,000.00	91,162.50	-
	MGM RESORTS INT 7.75% 3/15/22	140,000.00	157,850.00	-
	MIRANT AMERICAS 8.5% 10/01/21	1,090,000.00	1,193,550.00	-
	MIRANT AMERICAS 9.125% 5/01/31	60,000.00	65,100.00	-
	MIZUHO CORP BK 1.85% 3/18 RGS	300,000.00	292,224.00	-
	MLCRN LLC/ FIN 7.75 2/21 144A	1,000,000.00	1,027,500.00	-
	MOMENTIVE PERF 8.875 10/20 WI	120,000.00	129,900.00	-
	MTS INTL FDG 8.625% 6/20 144A	1,225,000.00	1,454,687.50	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	MULTIPLAN IN 9.875% 9/1/18REGS	30,000.00	33,075.00	-
	MYLAN INC 7.625% 7/15/17 REGS	15,000.00	16,603.80	-
	MYLAN INC 7.875% 7/15/20 REGS	25,000.00	28,781.25	-
	MYRIAD INT HLDGS 6% 7/20 144A	440,000.00	455,400.00	-
	NAI ENTMT 8.25% 12/17 REGS	9,000.00	9,720.00	-
	NATIONAL CINEM 6% 4/22 WI	25,000.00	26,187.50	-
	NATIONAL CINEM 7.875% 7/15/21	15,000.00	16,425.00	-
	NAVIOS LOG/FIN 9.25 4/19 144A	80,000.00	86,800.00	-
	NAVIOS LOG/FIN 9.25% 4/15/19	5,000.00	5,425.00	-
	NAVIOS MARIT 8.875% 11/01/17	10,000.00	10,550.00	-
	NAVIOS MARITI 8.625% 11/17 WI	10,000.00	10,450.00	-
	NAVIOS MARITIME 8.125% 2/15/19	780,000.00	748,800.00	-
	NBCUNIVERSAL ENT 5.25 PRP 144A	490,000.00	485,100.00	-
	NCL CORP LTD 5.0% 2/15/18 144A	715,000.00	716,787.50	-
	NCR CORP 4.625% 2/15/21 WI	2,975,000.00	2,870,875.00	-
	NCR CORP 5% 7/15/22 WI	20,000.00	19,350.00	-
	NEENAH PAPER 5.25 5/15/21 144A	3,000,000.00	2,985,000.00	-
	NEIMAN MARCUS 7.125% 6/01/28	1,065,000.00	1,070,325.00	-
	NES RENTALS 7.875% 5/1/18 144A	130,000.00	134,225.00	-
	NESCO HLD 2LN 11.75% 4/17 REGS	10,000.00	11,100.00	-
	NETFLIX INC 5.375% 2/1/21 144A	140,000.00	141,400.00	-
	NEUSTAR INC 4.5% 1/15/23 144A	1,235,000.00	1,160,900.00	-
	NEW ACADEMY FIN 8% 6/18 144A	95,000.00	98,325.00	-
	NEW GOLD 6.25% 11/15/22 REGS	30,000.00	28,800.00	-
	NEW GOLD INC 7% 4/15/20 REGS	5,000.00	5,150.00	-
	NEWFIELD EXPL 5.75% 1/30/22	300,000.00	312,750.00	-
	NEXSTAR 6.875% 11/15/20 REGS	365,000.00	377,775.00	-
	NIELSEN FINANCE 4.5 10/20 144A	8,065,000.00	8,004,512.50	-
	NIELSEN FINANCE 4.5 10/20 REGS	35,000.00	34,737.50	-
	NIELSEN FINANCE 7.75% 10/15/18	60,000.00	65,325.00	-
	NIELSEN FINANCE VNU 11.625% 2/14	6,000.00	6,285.00	-
	NII INTL TELE 11.375 8/19 144A	195,000.00	217,912.50	-
	NORD GOLD 6.375% 5/7/18 144A	720,000.00	660,600.00	-
	NORTEK INC 8.5% 4/15/21 REGS	20,000.00	21,750.00	-
	NORTH TIER 7.125 11/15/20 REGS	25,000.00	25,250.00	-
	NOVA CHEMICALS 5.25% 8/23 144A	1,255,000.00	1,276,962.50	-
	NRG ENERGY 6.625% 3/15/23 REGS	55,000.00	58,025.00	-
	NV ENERGY INC 6.25% 11/15/20	25,000.00	29,413.00	-
	NXP BV 3.75% 6/1/18 144A	3,580,000.00	3,562,100.00	-
	NXP BV 5.75% 03/15/23 144A	200,000.00	205,000.00	-
	NXP BV FDG 5.75% 2/15/21 144A	245,000.00	253,575.00	-
	ODEBRECHT FIN 7.5% PERP 144A	2,030,000.00	2,050,300.00	-
	OFFSHORE GROUP 7.125 4/23 144A	1,860,000.00	1,878,600.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	OFFSHORE GROUP 7.5% 11/19 WI	1,430,000.00	1,530,100.00	-
	OIL STATES INT 5.125 1/23 144A	85,000.00	89,887.50	-
	OIL STATES INTE 6.5% 6/19 WI	20,000.00	21,100.00	-
	OMEGA HEALTHCA 5.875% 3/15/24	5,290,000.00	5,501,600.00	-
	OMEGA HLTHCAR 6.75% 10/15/22 WI	15,000.00	16,125.00	-
	ORION ENG 9.25% 8/1/19 144A	200,000.00	204,500.00	-
	OWENS BROCKWAY 01 7.375 5/16	50,000.00	56,500.00	-
	PACIFIC DRILL 7.25% 12/17 144A	400,000.00	430,000.00	-
	PACIFIC DRILL 8.25% 2/23/15	2,000,000.00	2,075,000.00	-
	PACIFIC DRL 5.375% 6/1/20 144A	3,000,000.00	2,947,500.00	-
	PACIFIC RUBIAL 7.25 12/21 144A	925,000.00	996,687.50	-
	PAN AM ENERGY 7.875% 5/21 144A	1,060,000.00	1,038,800.00	-
	PDC ENERGY 7.75% 10/22 REGS	55,000.00	58,300.00	-
	PEABODY ENERGY 6.25% 11/21	1,035,000.00	1,050,525.00	-
	PENSKE AUTO GR 5.75 10/1/22 WI	30,000.00	31,350.00	-
	PETCO ANIMAL 9.25% 12/1/18 RGS	30,000.00	32,775.00	-
	PETCO HLDG PIK 8.5% 10/17 REGS	10,000.00	10,275.00	-
	PETROBRAS BV 3ML+214 1/15/19	1,445,000.00	1,426,937.50	-
	PETROBRAS INTL 5.375% 1/27/21	950,000.00	976,771.00	-
	PETROBRAS INTL 6.875% 1/20/40	710,000.00	728,034.00	-
	PETROBRAS INTL 7.875% 3/15/19	500,000.00	584,220.00	-
	PETROHAWK ENERG 7.25% 8/18 WI	90,000.00	98,550.00	-
	PETROHAWK ENRG 7.875% 6/01/15	20,000.00	20,403.40	-
	PETROLEUM GEO 7.375 12/18 144A	500,000.00	548,750.00	-
	PETROLOGISTICS 6.25% 4/20 144A	230,000.00	226,550.00	-
	PETRONAS 7.625 10/15/26	200,000.00	258,000.00	-
	PINNACLE ENTERT 7.750% 4/1/22	5,000.00	5,275.00	-
	PLAINS EXPLORAT 6.5% 11/15/20	205,000.00	223,989.15	-
	PLY-GEM INDUSTR 8.25% 2/15/18	268,000.00	292,790.00	-
	POINDEXTER JB 9% 4/01/22 REGS	45,000.00	46,800.00	-
	POLYONE CORP 5.25 3/15/23 144A	240,000.00	238,200.00	-
	POLYUS GLD 5.625% 4/29/20 144A	535,000.00	525,637.50	-
	POST HLDGS 7.375% 2/15/22 144A	250,000.00	270,625.00	-
	POST HLDGS INC 7.375 2/22 WI	25,000.00	27,062.50	-
	POWER SECTOR 7.39% 12/24 144A	300,000.00	369,000.00	-
	PRECISION DRIL 6.625% 11/20 WI	15,000.00	15,825.00	-
	PRECISION DRILL 6.5% 12/15/21	5,000.00	5,250.00	-
	PRESTIGE BRAND 8.125 2/20 WI	5,000.00	5,525.00	-
	PRIDE INTL 6.875% 8/15/20	10,000.00	11,996.40	-
	PRINCE MINERAL 11.5 12/19 144A	30,000.00	32,325.00	-
	PSALM 7.25% 5/27/19 144A	350,000.00	416,500.00	-
	PUGET ENERGY INC 5.625% 7/22WI	1,015,000.00	1,104,979.75	-
	PUGET ENERGY INC 6% 9/01/21	20,000.00	22,244.60	-
	PVH CORP 4.5% 12/15/22	5,150,000.00	5,085,625.00	-

次へ

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	QEP RESOURCES 5.25% 5/01/23	25,000.00	25,250.00	-
	QR ENENGY LP/FN 9.25% 8/20	15,000.00	15,525.00	-
	QUEBECOR MEDIA 5.75 1/15/23	40,000.00	40,000.00	-
	QUIKSILVER 7.875% 8/1/18 144A	800,000.00	836,000.00	-
	QVC INC 4.375% 3/15/2023 144A	2,000,000.00	1,925,260.00	-
	RADIATION TH 8.875% 1/15/17 WI	30,000.00	27,975.00	-
	RAIN CII CARB 8% 12/18 REGS	10,000.00	10,375.00	-
	RAIN CII CARBON 8.25 1/21 144A	200,000.00	203,500.00	-
	RDS ULTRADEEP 11.875 3/17 REGS	30,000.00	32,400.00	-
	REALOGY / SUN 3.375% 5/16 144A	10,795,000.00	10,848,975.00	-
	REALOGY CORP 7.625 1/20 144A	350,000.00	394,625.00	-
	REALOGY CORP 7.625 1/20 REGS	20,000.00	22,550.00	-
	REALOGY CORP 9% 1/15/20 144A	115,000.00	133,400.00	-
	REALOGY CORP 9% 1/15/20 REGS	10,000.00	11,600.00	-
	REGAL ENTERT 5.75 6/15/23	1,180,000.00	1,156,400.00	-
	REGAL ENTRMNT GRP 5.75% 2/1/25	40,000.00	38,400.00	-
	REGENCY ENGY 6.875% 12/18	20,000.00	21,600.00	-
	REGENCY ENGY P 5.5% 4/15/23	30,000.00	30,975.00	-
	RELIANCE INDUSTRIES LTD 5.88%	600,000.00	515,700.00	-
	RENT A CENTER 4.75 5/1/21 144A	2,000,000.00	1,910,000.00	-
	RESOLUTE ENERGY 8.5 5/20 WI	500,000.00	515,000.00	-
	REVLON CONS 5.75% 2/15/21 144A	4,180,000.00	4,169,550.00	-
	REYNOLDS GRP 5.75% 10/15/20 WI	3,497,000.00	3,628,137.50	-
	REYNOLDS GRP 6.875% 2/15/21 WI	5,768,000.00	6,193,390.00	-
	REYNOLDS GRP 7.875% 8/15/19 WI	100,000.00	110,500.00	-
	REYNOLDS GRP 9.875 8/15/19	100,000.00	110,500.00	-
	REYNOLDS GRP STEP 2/15/21 WI	100,000.00	104,750.00	-
	RHP HOTEL PPTYS 5.0% 4/21 144A	315,000.00	307,125.00	-
	RITE AID 6.875% 12/15/28 144A	625,000.00	592,187.50	-
	RITE AID CORP 6.75% 6/21 144A	5,045,000.00	5,120,675.00	-
	RITE AID CORP 7.7% 2/15/27	860,000.00	883,650.00	-
	RITE AID CORP 8% 8/15/20 W/I	45,000.00	50,512.50	-
	RITE AID CORP 9.25% 3/15/20 WI	2,975,000.00	3,369,187.50	-
	ROCKWOOD SPEC G 4.625 10/15/20	45,000.00	46,350.00	-
	ROSETTA RES INC 5.625% 5/1/21	420,000.00	423,150.00	-
	ROSNEFT INTL 4.199 3/6/22 144A	400,000.00	372,520.00	-
	ROYAL BK SC 6.1% 6/10/23	2,100,000.00	2,079,861.00	-
	ROYAL CARIBBEAN 5.25% 11/15/22	25,000.00	25,187.50	-
	RR DONNELLEY 7.875% 3/15/21	710,000.00	741,950.00	-
	RSC EQUIP RENT 8.25% 2/1/21WI	25,000.00	28,250.00	-
	RURAL/METRO C 10.125 7/19 REGS	10,000.00	5,900.00	-
	RYERSON INC 11.25% 10/18 144A	405,000.00	413,100.00	-
	RYERSON INC 9% 10/15/17 144A	720,000.00	727,200.00	-
	RYERSON INC 9% 10/15/17 REGS	35,000.00	35,350.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	RYLAND GROUP IN 5.375 10/01/22	10,000.00	9,650.00	-
	SABINE PASS 5.625% 2/1/21 144A	1,060,000.00	1,073,250.00	-
	SABINE PASS 5.625% 4/23 144A	700,000.00	696,500.00	-
	SABINE PASS 6.5% 11/1/20 REGS	35,000.00	36,400.00	-
	SABINE PASS LNG 7.5 11/30/16	355,000.00	394,050.00	-
	SABRA HLATH 8.125 11/01/18 WI	14,000.00	15,155.00	-
	SABRA HLTH /CPTL 5.375% 6/1/23	360,000.00	351,900.00	-
	SALLY HOLDINGS 5.75% 6/1/22	15,000.00	15,450.00	-
	SANDRIDGE ENERGY 7.5 3/15/21	15,000.00	15,112.50	-
	SANEAMENTO BAS 6.25 12/20 REGS	400,000.00	404,840.00	-
	SATELITES MEXIC 9.5% 5/15/17	30,000.00	32,175.00	-
	SAWGRASS MERG 8.75% 12/20 144A	145,000.00	149,350.00	-
	SBA COMMUNIC 5.625 10/19	35,000.00	35,350.00	-
	SCF CAP LTD 5.375% 10/17 144A	200,000.00	195,760.00	-
	SCHAEFFLER 4.75% 5/15/21 144A	465,000.00	455,700.00	-
	SCHAEFFLER PIK 6.875 8/18 144A	930,000.00	955,575.00	-
	SCIENTIFIC GAMES 6.25 9/20 WI	120,000.00	121,200.00	-
	SEAGATE CAYMAN 4.75% 6/23 144A	2,000,000.00	1,955,000.00	-
	SEALED AIR 5.25% 4/1/23 144A	145,000.00	143,550.00	-
	SEALED AIR 6.5% 12/01/20 144A	60,000.00	65,100.00	-
	SELECT MEDICAL 6.375 6/21 144A	2,800,000.00	2,702,000.00	-
	SEMGROUP CRP 7.5% 6/15/21 144A	540,000.00	557,550.00	-
	SENSATA 4.875% 10/15/23 144A	210,000.00	206,325.00	-
	SENSATA TECH 6.5% 5/15/19 REGS	300,000.00	319,500.00	-
	SERVICE CO INTL 4.5% 11/15/20	265,000.00	256,387.50	-
	SERVICE CORP 5.375% 1/22 144A	285,000.00	289,275.00	-
	SEVERSTAL COL 10.25% 2/15/18	1,598,000.00	1,705,865.00	-
	SHALE HLDG 8.75% 11/15/19 REGS	250,000.00	256,250.00	-
	SHEARERS FOODS 9% 11/1/19 REGS	10,000.00	10,650.00	-
	SHERIDAN GROUP 12.5% 4/15/14	316,102.83	316,102.83	-
	SHINGLE SPRINGS9.375 6/15 REGS	20,000.00	19,750.00	-
	SINCLAIR TV 5.375 4/1/21 WI	1,005,000.00	997,462.50	-
	SINOPEC GR OVER3.9% 5/22 144A	1,500,000.00	1,482,135.00	-
	SIRIUS XM 4.25% 5/15/20 144A	965,000.00	926,400.00	-
	SIWF MERGER 6.25% 6/1/21 144A	175,000.00	176,312.50	-
	SIX FLAGS ENTMT 5.25 1/21 144A	1,015,000.00	1,002,312.50	-
	SKY GROWTH AC 7.375 10/20 REGS	10,000.00	10,400.00	-
	SLM CORP 5.5% 12/31/23	4,715,000.00	4,549,975.00	-
	SLM CORP MEDIUM 3.875% 9/10/15	6,852,000.00	6,954,780.00	-
	SLM CORP MEDIUM 4.625% 9/25/17	235,000.00	239,112.50	-
	SLM CORP MEDIUM 8.45% 6/15/18	4,525,000.00	5,288,593.75	-
	SLM CORP MTN 8% 3/25/20	155,000.00	176,312.50	-
	SMITHFIELD FOOD 6.625% 8/15/22	20,000.00	21,650.00	-
	SOFTBANK CRP 4.5% 4/15/20 144A	8,000,000.00	7,840,000.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	SONIC AUTOMOTIVE 5% 5/23 WI	85,000.00	83,512.50	-
	SONIC AUTOMOTIVE INC 7 7/22	10,000.00	10,900.00	-
	SOTHEBYS 5.25% 10/01/22 REGS	35,000.00	34,300.00	-
	SOUTHERN COPPER 6.75% 4/16/40	60,000.00	60,292.20	-
	SOUTHERN PERU COPPER 7.5% 7/35	630,000.00	685,660.50	-
	SOUTHERN STAR 6.75% 3/16	500,000.00	503,750.00	-
	SPANSION LLC 7.875% 11/15/17	10,000.00	10,150.00	-
	SPECTRUM BRANDS 6.75% 03/15/20	140,000.00	150,500.00	-
	SPECTRUM ESCW 6.375 11/20 REGS	15,000.00	15,937.50	-
	SPECTRUM ESCW 6.625 11/22 REGS	15,000.00	16,125.00	-
	SPEEDWAY MOTORSP 6.75 2/1/19	910,000.00	964,600.00	-
	SPENCER SPRT PIK VAR 5/18 144A	225,000.00	222,750.00	-
	SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32	3,255,000.00	3,556,087.50	-
	SPRINT CAP CRP 6.875% 11/15/28	65,000.00	62,075.00	-
	SPRINT CAP GLBL 6.9% 5/01/19	915,000.00	988,200.00	-
	SPRINT NEXTEL 6% 11/15/22	10,375,000.00	10,375,000.00	-
	SPRINT NEXTEL 6% 12/01/16	930,000.00	999,378.00	-
	SPRINT NEXTEL 7% 3/1/20 144A	2,075,000.00	2,303,250.00	-
	SPRINT NEXTEL 7% 3/1/20 REGS	60,000.00	66,600.00	-
	SPRINT NEXTEL 9% 11/15/18 REGS	65,000.00	78,325.00	-
	STAR GAS PRNTR 8.875% 12/17 WI	10,000.00	10,350.00	-
	STARZ LLC/FIN 5% 09/15/19	410,000.00	413,075.00	-
	STEEL DYNAMICS 6.125 8/19 REGS	20,000.00	21,100.00	-
	STEEL DYNAMICS 6.375 8/22 REGS	15,000.00	15,787.50	-
	STEEL DYNMC 5.25% 4/15/23 144A	145,000.00	142,825.00	-
	STONE ENERGY CO 7.5% 11/15/22	205,000.00	215,250.00	-
	STUDIO CITY 8.5% 12/01/20 144A	1,740,000.00	1,892,250.00	-
	SUMMIT MID/FIN 7.5% 7/21 144A	280,000.00	289,100.00	-
	SUNGARD DATA 4.875 1/15/14	30,000.00	30,150.00	-
	SUNGARD DATA 6.625 11/19 144A	600,000.00	620,250.00	-
	SUNGARD DATA 6.625 11/19 REGS	60,000.00	62,025.00	-
	SWIFT ENERGY CO 7.875 3/1/22	150,000.00	150,000.00	-
	TARGA RES 5.25% 5/01/23 144A	25,000.00	25,000.00	-
	TARGA RES 5.25% 5/01/23 REGS	50,000.00	50,000.00	-
	TARGA RES LP/FI 6.875% 2/01/21	30,000.00	32,100.00	-
	TARGA RES/FIN 4.25% 11/23 144A	1,265,000.00	1,176,450.00	-
	TARGA RS LP/FI 6.375 8/22	9,000.00	9,540.00	-
	TEEKAY CORP 8.5% 1/15/20	1,370,000.00	1,489,875.00	-
	TEKNI-PLEX INC 9.75% 6/19 REGS	12,000.00	12,780.00	-
	TELEFONICA CEL 6.75 12/22 144A	350,000.00	364,437.50	-
	TELEMOVIL FIN 8% 10/01/17 144A	950,000.00	1,016,500.00	-
	TELESAT CDA 6% 5/15/17 OCT	25,000.00	25,593.75	-
	TENET HEALTH 4.5 4/01/21 144A	9,875,000.00	9,381,250.00	-
	TENET HEALTH 4.375% 10/21 144A	7,520,000.00	7,021,800.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	TENET HEALTH 4.75% 06/01/20	275,000.00	267,781.25	-
	TENET HEALTH 9.25%	816,000.00	891,480.00	-
	TENET HEALTH 9.875%	50,000.00	53,500.00	-
	TENET HEALTHCARE 8% 8/20 WI	35,000.00	37,800.00	-
	TENET HLTHCRE 6.75% 02/20 WI	520,000.00	529,100.00	-
	TENN GAS PIPELI 8% 2/1/16	5,000.00	5,795.45	-
	TENNECO INC 6.875% 12/15/20 WI	20,000.00	21,625.00	-
	TERVITA 9.75% 11/01/19 144A	90,000.00	87,300.00	-
	TERVITA 9.75% 11/01/19 REGS	35,000.00	33,950.00	-
	TERVITA CORP 8% 11/15/18 144A	165,000.00	169,950.00	-
	TESORO LP/FIN 5.875 10/20 REGS	5,000.00	5,050.00	-
	TEXAS INDUSTRIES 9.25% 8/20	2,000,000.00	2,155,000.00	-
	TITAN INTL 7.875% 10/1/17 144A	1,000,000.00	1,065,000.00	-
	TMK CAP(TMK)LPN 7.75 1/18 RGS	800,000.00	827,040.00	-
	TOLL BROS FIN CORP 4.375% 4/23	1,250,000.00	1,196,875.00	-
	TOPS HLDG 8.875% 12/15/17 144A	55,000.00	60,709.00	-
	TOWER AUTO 10.625% 9/1/17 REGS	7,000.00	7,420.00	-
	TRAC INTERMODAL 11% 8/15/19	15,000.00	16,837.50	-
	TRANSDIGM 5.5% 10/15/20 144A	2,410,000.00	2,397,950.00	-
	TRANSDIGM 7.5% 07/15/21 144A	2,180,000.00	2,332,600.00	-
	TRANSNET LTD 4% 7/26/22 144A	200,000.00	176,000.00	-
	TRANSPORTADORA 7.875 5/17 144A	1,490,000.00	1,311,200.00	-
	TRANSUNION 9.625% 6/15/18 PIK	10,000.00	10,900.00	-
	TRANSUNION PIK 8.125 6/15 REGS	35,000.00	37,537.50	-
	TRINSEO MATLS 8.75% 2/19 144A	3,400,000.00	3,425,500.00	-
	TRIUMPH GRP 4.875% 4/1/21 144A	295,000.00	297,950.00	-
	TRONOX FIN LLC 6.375 8/20 REGS	30,000.00	29,475.00	-
	TV AZTECA SAB 7.5 5/25/18 REGS	825,000.00	870,375.00	-
	TXU CORP 5.55% 11/15/14	601,000.00	429,715.00	-
	TXU CORP 6.5% 11/15/24	230,000.00	140,300.00	-
	TXU CORP 6.55% 11/15/34	500,000.00	302,500.00	-
	UBS (VIMPEL) 8.25 5/23/16 REGS	1,050,000.00	1,157,625.00	-
	ULTRAPETROL 8.875 6/15/21 144A	405,000.00	414,112.50	-
	UNICREDIT LUX 5.1875 10/15 144	695,000.00	703,687.50	-
	UNIT CORP 6.625% 5/15/21	65,000.00	67,437.50	-
	UNITED CONTL HLD 6.375% 6/1/18	100,000.00	100,625.00	-
	UNITED RENTALS 6.125% 6/15/23	40,000.00	42,100.00	-
	UNITYMEDIA HESN 5.5% 1/23 144A	200,000.00	195,260.00	-
	UNIVISION 5.125% 5/15/23 144A	2,000,000.00	1,975,000.00	-
	UNIVISION 7.875% 11/01/20 REGS	15,000.00	16,500.00	-
	UNIVISION COMM 6.875 5/19 REGS	20,000.00	21,350.00	-
	UPCB FIN III 6.625% 7/20 REGS	150,000.00	159,750.00	-
	US AIRWAYS 2012-2C 5.45 6/3/18	1,360,000.00	1,292,000.00	-
	US AWYS 12-2 A 4.625% 12/03/26	40,000.00	39,500.00	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	US AWYS 12-2 B 6.75% 12/3/22	30,000.00	31,200.00	-
	US AWYS 2013-1A 3.95 5/15/27	465,000.00	446,400.00	-
	US AWYS 2013-1B 5.375% 5/15/23	190,000.00	185,250.00	-
	US AWYS GROUP 6.125% 6/1/18	1,100,000.00	1,058,750.00	-
	US COAT/FLASH 7.375 5/21 144A	2,060,000.00	2,144,975.00	-
	US FOOD INC 8.5% 06/30/19	500,000.00	540,000.00	-
	USG 7.875% 3/30/20 REGS	10,000.00	10,900.00	-
	USG CORP 9.75 1/15/18	50,000.00	57,250.00	-
	USG MTN 6.3% 11/15/16	525,000.00	546,000.00	-
	USPI FIN CORP 9% 4/01/20 WI	10,000.00	11,050.00	-
	VALEANT PHAR 7.25 7/15/22 REGS	75,000.00	80,250.00	-
	VALEANT PHARM 6.75% 8/21 144A	1,885,000.00	1,979,250.00	-
	VALEANT PHARM 6.75% 8/21 REGS	115,000.00	120,750.00	-
	VALEANT PHARM 6.875% 12/18 144	475,000.00	502,906.25	-
	VALEANT PHARMA 7% 10/20 REGS	10,000.00	10,687.50	-
	VERISIGN 4.625% 5/1/23 144A	4,320,000.00	4,244,400.00	-
	VERSO PAPER 11.75% 01/19 WI	105,000.00	107,887.50	-
	VERSO PAPER 11.75% 1/19 WI	35,000.00	23,800.00	-
	VGRD HLTH HLD 7.75% 2/1/19	30,000.00	32,400.00	-
	VIASAT INC 6.875 6/15/20	30,000.00	32,025.00	-
	VIASYSTEMS INC 7.875 5/19 REGS	30,000.00	31,650.00	-
	VIDEOTRON LTEE 5% 7/15/22	3,000,000.00	3,000,000.00	-
	VIP FIN IREL 7.748% 2/21 144A	200,000.00	218,000.00	-
	VIRGIN MEDIA FI 4.875% 2/15/22	200,000.00	184,000.00	-
	VIVINT 6.375% 12/1/19 144A	2,760,000.00	2,732,400.00	-
	VIVINT 6.375% 12/1/19 REGS	155,000.00	153,450.00	-
	VIVINT 8.75% 12/1/20 144A	3,590,000.00	3,625,900.00	-
	VIVINT 8.75% 12/1/20 REGS	105,000.00	106,050.00	-
	VPI ESCROW CP 6.375 10/20 144A	25,000.00	26,437.50	-
	VPI ESCROW CP 6.375 10/20 REGS	50,000.00	52,875.00	-
	VPII ESCROW 7.5% 7/15/21 144A	4,390,000.00	4,779,612.50	-
	VPII ESCRW 6.75% 8/15/18 144A	2,850,000.00	3,056,625.00	-
	VWR FNDG INC 7.25% 9/15/17 WI	345,000.00	363,112.50	-
	W & T OFFSHORE 8.5 6/15/19	90,000.00	97,650.00	-
	WALT DISNEY COMPANY .45% 12/15	50,000.00	49,880.50	-
	WATERFORD GAME 8.625 9/14 REGS	19,276.00	5,915.80	-
	WEEKLEY HOMES 6% 2/1/23 144A	70,000.00	71,400.00	-
	WESTERN EXP 12.5% 4/15/15 REGS	10,000.00	6,550.00	-
	WESTERN REFIN 6.25 4/1/21 144A	140,000.00	138,950.00	-
	WIDOPENWEST 10.25% 7/19 WI	2,754,000.00	3,050,055.00	-
	WIDOPENWEST 13.375% 10/19 WI	115,000.00	133,112.50	-
	WILLIAM LYON 8.5 11/15/20	30,000.00	33,150.00	-
	WIND ACQ 12.25% PIK 7/17 144A	408,581.00	423,343.03	-
	WIND ACQ 12.25% PIK 7/17 REGS	8,832.00	9,151.09	-

種類 / 通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	WIND ACQ 6.5% 04/30/20 144A	1,000,000.00	1,032,500.00	-
	WMG ACQUISITION 6% 1/15/21 REGS	13,000.00	13,682.50	-
	WOLVERINE WRD 6.125 10/20 REGS	15,000.00	15,750.00	-
	WP ROCKET MRGR 10.125 7/19 REG	15,000.00	10,125.00	-
	WYNN LAS VEGAS 4.25% 5/23 144A	1,070,000.00	1,016,500.00	-
	XERIUM TECHNOLO 8.875% 6/15/18	2,000,000.00	2,010,000.00	-
	XTERRAN PR/EXLP 6% 4/1/21 144A	2,000,000.00	2,030,000.00	-
	YAPI VE KREDI 5.5% 12/22 144A	200,000.00	179,000.00	-
	ZHAIKMUNAI FIN 10.5 10/15 144A	700,000.00	742,000.00	-
	ZHAIKMUNAI INTL 7.125 11/19/144	950,000.00	978,500.00	-
アメリカ・ドル 小計		761,169,000.25	780,285,314.11 (78,012,925,705)	
イギリス・ポンド	BARCLAYS BK EMTN 4.25% 1/12/22	1,000,000.00	1,099,930.00	-
	INTU PPTY PLC 3.875% 3/17/23	150,000.00	153,261.00	-
	LLOYDS TSB EMTN 5.125% 3/07/25	1,000,000.00	1,137,380.00	-
	MANCHESTER UNIV 4.25% 7/53	500,000.00	513,935.00	-
	ROYAL BK SCOTLD 5.125% 1/13/24	1,000,000.00	1,138,250.00	-
	SCOTTISH WIDOW 5.5% 6/16/23	350,000.00	349,489.00	-
イギリス・ポンド 小計		4,000,000.00	4,392,245.00 (671,706,028)	
ユーロ	AQUARIUS ZURICH 4.25/VAR 10/43	100,000.00	99,799.00	-
	BP CAPITAL PLC EMTN 3.83 10/17	200,000.00	221,568.00	-
	CHANNEL LINK @EURIBR6+325 6/50	550,000.00	511,500.00	-
	COCA COLA HBC EMTN2.375 6/20	500,000.00	501,560.00	-
	DEUTSCHE EMTN 3.75% 2/12/14	250,000.00	254,875.00	-
	FCE BANK EMTN 1.875% 5/12/16	100,000.00	101,243.00	-
	NASDAQ OMX 3.875% 6/07/21	350,000.00	361,469.50	-
	ROBERT BOSCH 2.979% 5/27/33	300,000.00	297,906.00	-
	SABMILLER HLDG 1.875% 1/20 RGS	100,000.00	99,737.00	-
	VIER GAS EMTN 3.125 7/23RGS	700,000.00	722,414.00	-
	VIER GAS TRA 2.875 6/25 RGS	250,000.00	248,750.00	-
	WURTH FIN INTL EMTN 1.75 5/20	200,000.00	199,024.00	-
ユーロ 小計		3,600,000.00	3,619,845.50 (476,335,469)	
社債券 合計			79,160,967,202 (79,160,967,202)	
合計			186,924,420,407 (182,305,109,183)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 8 銘柄	0.21%	-	86.02%
	国債証券 229 銘柄	-	44.60%	
	地方債証券 2 銘柄	-	0.14%	
	特殊債券 71 銘柄	-	5.38%	
	社債券 840 銘柄	-	49.66%	
イギリス・ポンド	国債証券 3 銘柄	-	85.80%	2.67%
	特殊債券 1 銘柄	-	0.42%	
	社債券 6 銘柄	-	13.78%	
カナダ・ドル	国債証券 5 銘柄	-	100.00%	2.73%
ナイジェリア・ナイラ	国債証券 1 銘柄	-	100.00%	0.05%
ニュージーランド・ドル	国債証券 1 銘柄	-	100.00%	0.29%
ユーロ	国債証券 15 銘柄	-	95.66%	8.24%
	特殊債券 2 銘柄	-	1.18%	
	社債券 12 銘柄	-	3.17%	

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。

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)

(2013年8月30日現在)

種 類	金 額	単 位
資産総額	211,884,546,109	円
負債総額	1,154,850,194	円
純資産総額(-)	210,729,695,915	円
発行済数量	276,594,646,476	口
1単位当たり純資産額(/)	0.7619	円

Bコース(為替ヘッジなし)

(2013年8月30日現在)

種 類	金 額	単 位
資産総額	8,960,526,215	円
負債総額	31,107,884	円
純資産総額(-)	8,929,418,331	円
発行済数量	12,251,520,046	口
1単位当たり純資産額(/)	0.7288	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

(2013年8月30日現在)

種 類	金 額	単 位
資産総額	240,587,388,408	円
負債総額	13,181,857,104	円
純資産総額(-)	227,405,531,304	円
発行済数量	111,028,607,591	口
1単位当たり純資産額(/)	2.0482	円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

名義書換は行ないません。

ファンドの受益権は、振替受益権となり、委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(2) 受益者名簿

作成しません。

(3) 受益者に対する特典

該当するものではありません。

(4) 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

ファンドの受益権の譲渡制限は設けておりません。

受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

受益権の再分割

委託会社は、受益権の再分割を行ないません。ただし、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として扱います。）に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【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】

(1) 資本金等

(2013年8月末日現在)

資本金の額	金10億円
発行する株式の総数	80,000株
発行済株式総数	20,000株
最近5年間における資本金の額の増減	該当事項はありません。

(2) 委託会社等の機構

経営体制

委託会社は、委員会設置会社であり、指名委員会、監査委員会、報酬委員会を設けています。各委員会を構成する取締役は、取締役会において選任されます。

取締役会は、委託会社の経営管理の意思決定機関として法定事項を決議するとともに、経営の基本方針および経営業務執行上の重要な事項を決定あるいは承認し、取締役および執行役の職務を監督します。

取締役は8名以内とし、株主総会の決議によって選任されます。取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員により選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了すべき時までとします。

執行役は取締役会の決議に基づき委任を受けた事項の決定を行ない、当社の業務を執行します。執行役は10名以内とし、取締役会において選任されます。執行役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結後最初に招集される取締役会の終結の時までとし、補欠または増員により選任された執行役の任期は、他の現執行役の任期の満了すべき時までとします。

運用体制

投資信託の運用の流れは以下の通りです。

1. 個別企業の訪問調査等により、内外の経済動向や株式および債券の市場動向の分析を行います。委託会社は、日本国内に専任のアナリストを擁し綿密な企業調査を行なうのみならず、世界の主要拠点のアナリストより各国の企業調査結果が入手できる調査・運用体制を整えています。
2. ポートフォリオ・マネージャーは投資判断に際し、投資信託約款等を遵守し、運用方針、投資制限、リスク許容度、その他必要な事項を把握したうえで投資戦略を策定し、自身の判断によって投資銘柄を決定するとともに、投資環境等の変化に応じて運用に万全を期します。
3. ポートフォリオ・マネージャーの運用に係るリスク管理および投資行動のチェックについては、運用部門において部門の担当責任者とポートフォリオ・マネージャーによるミーティング等を実施し、さまざまなリスク要因について協議しています。また、運用に関するコンプライアンス部門においては、ファンドが法令および各種運用規制等を遵守して運用されているかがチェックされ、モニタリングの結果を運用部門および必要に応じて適宜関係部門にフィードバックしています。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。

2013年8月30日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、追加型株式投資信託149本、親投資信託57本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,633,431,177,231円です。

3【委託会社等の経理状況】

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。

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。

当社の財務諸表は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により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26期 （平成24年3月31日）	第27期 （平成25年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	414,307	423,130
立替金	178,632	181,961
前払費用	134,826	143,816
未収委託者報酬	3,608,767	4,228,278
未収収益	551,604	450,497
未収入金	* 1 626,527	541,967
繰延税金資産	1,198,455	1,044,008
流動資産合計	6,713,120	7,013,659
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		
投資有価証券	989,129	1,431,173
長期貸付金	* 1 11,466,000	12,550,000
長期差入保証金	143,331	83,374
会員預託金	1,030	830
投資その他の資産合計	12,599,490	14,065,377
固定資産合計	12,606,977	14,072,864
資産合計	19,320,098	21,086,524
負債の部		
流動負債		
預り金	1,883	204
未払金	* 1	
未払手数料	1,537,315	1,801,025
その他未払金	944,060	1,209,146
未払費用	993,613	959,644
未払法人税等	80,118	72,987
未払消費税等	125,882	125,710
賞与引当金	2,250,852	1,967,731
その他流動負債	31,605	41,180
流動負債合計	5,965,331	6,177,632
固定負債		
長期賞与引当金	111,943	211,868
退職給付引当金	4,900,549	5,099,781
関係会社引当金	1,017,255	1,255,160
預り保証金	-	19,485
繰延税金負債	35,453	192,642
固定負債合計	6,065,202	6,778,937
負債合計	12,030,534	12,956,569
純資産の部		
株主資本		
資本金	1,000,000	1,000,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	6,225,540	6,782,075
利益剰余金合計	6,225,540	6,782,075
株主資本合計	7,225,540	7,782,075
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	64,023	347,879
評価・換算差額等合計	64,023	347,879
純資産合計	7,289,564	8,129,955
負債純資産合計	19,320,098	21,086,524

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第26期 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	第27期 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	27,120,569	27,274,905
その他営業収益	3,969,358	3,535,840
営業収益計	31,089,927	30,810,745
営業費用		
支払手数料	12,373,051	12,411,728
広告宣伝費	733,745	566,037
調査費		
調査費	416,155	387,990
委託調査費	5,138,531	5,240,618
営業雑経費		
通信費	40,901	36,232
印刷費	53,035	61,980
協会費	28,950	28,856
諸会費	7,389	10,181
営業費用計	18,791,762	18,743,625
一般管理費		
給料		
給料・手当	3,169,469	2,914,666
賞与	1,995,958	2,109,995
福利厚生費	752,276	691,175
交際費	29,381	32,115
旅費交通費	206,717	220,832
租税公課	62,099	51,604
弁護士報酬	9,860	1,831
不動産賃貸料・共益費	519,096	495,837
退職給付費用	630,143	456,463
消耗器具備品費	50,133	49,203
事務委託費	3,031,558	3,176,343
諸経費	318,269	291,075
一般管理費計	10,774,963	10,491,145
営業利益	1,523,201	1,575,974
営業外収益	* 1	
受取利息	69,296	69,342
保険配当金	11,946	12,407
雑益	55	1,038
営業外収益計	81,298	82,788
営業外費用		
寄付金	1,460	300
為替差損	102,563	291,333
営業外費用計	104,024	291,633
経常利益	1,500,475	1,367,129
特別損失		
特別退職金	200,450	105,104
事務過誤損失	718	-
特別損失計	201,168	105,104
税引前当期純利益	1,299,307	1,262,024
法人税、住民税及び事業税	604,564	551,042
法人税等調整額	151,672	154,447
法人税等合計	756,237	705,489
当期純利益	543,070	556,534

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	第26期		第27期	
	（自	平成23年4月1日	（自	平成24年4月1日
	至	平成24年3月31日）	至	平成25年3月31日）
株主資本				
資本金				
当期首残高		1,000,000		1,000,000
当期変動額				
当期変動額合計				
当期末残高		1,000,000		1,000,000
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金				
当期首残高		5,682,470		6,225,540
当期変動額				
当期純利益		543,070		556,534
当期変動額合計		543,070		556,534
当期末残高		6,225,540		6,782,075
株主資本合計				
当期首残高		6,682,470		7,225,540
当期変動額				
当期純利益		543,070		556,534
当期変動額合計		543,070		556,534
当期末残高		7,225,540		7,782,075
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金				
当期首残高		10,207		64,023
当期変動額				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）		53,815		283,856
当期変動額合計		53,815		283,856
当期末残高		64,023		347,879
評価・換算差額等合計				
当期首残高		10,207		64,023
当期変動額				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）		53,815		283,856
当期変動額合計		53,815		283,856
当期末残高		64,023		347,879
純資産合計				
当期首残高		6,692,678		7,289,564
当期変動額				
当期純利益		543,070		556,534
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）		53,815		283,856
当期変動額合計		596,886		840,390
当期末残高		7,289,564		8,129,955

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法を採用しております。

2. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき、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。

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

数理計算上の差異については、発生年度に全額費用処理しております。

(3) 賞与引当金、長期賞与引当金

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

(4) 関係会社引当金

親会社により負担された当社のインセンティブ・シェア・プランによる業績連動型特別賞与について、将来親会社に対し支払いを行う可能性が高いため、親会社との契約に基づき当期末において発生していると認められる額を計上しております。

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税および地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

*1 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。

	第26期 (平成24年3月31日)	第27期 (平成25年3月31日)
未収入金	527,772 千円	454,599 千円
その他未払金	686,666 千円	941,766 千円
長期貸付金	11,466,000 千円	12,550,000 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26期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第27期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
関係会社からの 受取利息	69,296 千円	69,342 千円

（株主資本等変動計算書関係）

第26期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

第27期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

(リース取引関係)

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

預金に係る銀行の信用リスクに関しては、口座開設時及びその後も継続的に銀行の信用力を評価し、格付けの高い金融機関でのみで運用し、預金に係る信用リスクを管理しております。

未収委託者報酬及び未収収益は、投資信託または取引相手ごとに残高を管理し、当社が運用している資産の中から報酬を徴収するため、信用リスクは僅少であります。

また、未収入金は、概ね、海外の関連会社との取引により生じたものであり、原則、翌月中に決済が行われる事により、回収が不能となるリスクは僅少であります。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません。（（注2）参照）

第26期（平成24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	414,307	414,307	-
(2) 未収委託者報酬	3,608,767	3,608,767	-
(3) 未収入金	626,527	626,527	-
(4) 投資有価証券	987,367	987,367	-
(5) 長期貸付金	11,466,000	11,466,000	-
資産計	17,102,970	17,102,970	-
(1) 未払手数料	1,537,315	1,537,315	-
(2) その他未払金	944,060	944,060	-
負債計	2,481,375	2,481,375	-

第27期(平成25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	423,130	423,130	-
(2) 未収委託者報酬	4,228,278	4,228,278	-
(3) 未収入金	541,967	541,967	-
(4) 投資有価証券	1,429,412	1,429,412	-
(5) 長期貸付金	12,550,000	12,550,000	-
資産計	19,172,788	19,172,788	-
(1) 未払手数料	1,801,025	1,801,025	-
(2) その他未払金	1,209,146	1,209,146	-
負債計	3,010,172	3,010,172	-

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収入金

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

(4) 投資有価証券

時価について、当社が算定し、公表している基準価額によっております。

(5) 長期貸付金

変動金利によるものであり、時価は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。

負債

(1) 未払手数料、(2) 未払金

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

(注) 2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	第26期 (平成24年3月31日)	第27期 (平成25年3月31日)
非上場株式	1,761	1,761

非上場株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

(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26期(平成24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	414,307	-	-	-
未収委託者報酬	3,608,767	-	-	-
未収入金	626,527	-	-	-
合計	4,649,601	-	-	-

金銭債権のうち長期貸付金(11,466,000千円)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27期(平成25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	423,130	-	-	-
未収委託者報酬	4,228,278	-	-	-
未収入金	541,967	-	-	-
合計	5,193,376	-	-	-

金銭債権のうち長期貸付金(12,550,000千円)については、契約上返済期限の定めがないため、上記に含めておりません。

(有価証券関係)

第26期（平成24年3月31日）

1. その他有価証券

区分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額 （千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	887,890	987,367	99,477
小計	887,890	987,367	99,477
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,761	1,761	-
小計	1,761	1,761	-
合計	889,651	989,129	99,477

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
-	-	-

第27期（平成25年3月31日）

1. その他有価証券

区分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額 （千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	888,890	1,429,412	540,522
小計	888,890	1,429,412	540,522
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,761	1,761	-
小計	1,761	1,761	-
合計	890,651	1,431,173	540,522

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
-	-	-

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

（退職給付関係）

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・確定拠出型年金制度を採用しております。

2．退職給付債務に関する事項

	第26期 (平成24年3月31日)	第27期 (平成25年3月31日)
(1) 退職給付債務	4,879,424千円	5,085,499千円
(2) 未積立退職給付債務	4,879,424千円	5,085,499千円
(3) 未認識過去勤務債務	21,125千円	14,282千円
(4) 退職給付引当金	4,900,549千円	5,099,781千円

3．退職給付費用に関する事項

	第26期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第27期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
(1) 勤務費用	549,814千円	121,553千円
(2) 利息費用	25,342千円	31,654千円
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	49,210千円	274,007千円
(4) 過去勤務債務の費用処理額	6,843千円	6,843千円
(5) 退職給付費用の額（注1）	617,523千円	420,371千円

（注1）従業員出向に伴う配賦額控除前の数値です。

（注2）上記退職給付費用以外に下記項目を計上しております。

	第26期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第27期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
(1) 臨時に支払った割増退職金	200,450千円	105,104千円
(2) 確定拠出年金等の退職給付費用	103,449千円	95,531千円

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

(2) 割引率

第26期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第27期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
1.4%	1.0%

(3) 過去勤務債務の処理年数

10年

（ストック・オプション等関係）

該当事項はありません。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第26期 (平成24年3月31日)	第27期 (平成25年3月31日)
繰延税金資産		(千円)
退職給付引当金損金算入限度超過額	1,746,450	1,817,562
賞与引当金	1,178,886	1,270,783
未払費用否認	497,504	364,760
繰越欠損金	293,669	241,451
その他	75,122	87,467
繰延税金資産小計	3,791,632	3,782,025
評価性引当額	2,593,177	2,738,017
繰延税金資産計	1,198,455	1,044,008
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	35,453	192,642
繰延税金負債計	35,453	192,642

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26期 (平成24年3月31日)	第27期 (平成25年3月31日)
法定実効税率 (調整)	40.69	38.01
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.82	3.22
評価性引当額	17.19	12.40
過年度法人税等	2.59	1.26
税率変更差異	34.55	0.56
その他	0.07	0.45
税効果会計適用後の法人税等の負担率	58.20	55.92

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(企業結合等関係)

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

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

(賃貸等不動産関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

セグメント情報

第26期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）及び第27期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）当社は資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第26期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

1. サービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託の運用	投資顧問業	合計
外部顧客への売上高	27,120,569	2,084,211	29,204,780

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客への売上高が損益計算書の売上高の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

投資信託の名称	委託者報酬	関連するサービスの種類
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	7,712,569	投資信託の運用
フィデリティ・USリート・ファンドB（為替ヘッジなし）	7,049,398	投資信託の運用
フィデリティ・日本成長株・ファンド	3,390,798	投資信託の運用

第27期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. サービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託の運用	投資顧問業	合計
外部顧客への売上高	27,274,905	1,551,186	28,826,092

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客への売上高が損益計算書の売上高の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

投資信託の名称	委託者報酬	関連するサービスの種類
フィデリティ・USリート・ファンドB（為替ヘッジなし）	7,858,776	投資信託の運用
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	6,994,036	投資信託の運用
フィデリティ・日本成長株・ファンド	3,552,348	投資信託の運用

関連当事者情報

第26期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称	会社等の所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
親会社	FIL Limited	英領バミューダ、ペンブローク市	千米ドル 2,832	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	金銭の返済（注1） 利息の受取（注1） 委託調査等報酬（注3） 共通発生経費負担額（注4） 共通発生経費負担額（注4）	千円 9,270,000 9,786 188,913 4,833,970 -	長期貸付金 未収入金 未収入金 未払金 関係会社引当金	千円 - - 241,786 503,816 1,017,255
親会社	フィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社	東京都港区	千円 4,510,000	グループ会社経営管理	被所有 直接100 %	当社事業活動の管理等役員の兼任	金銭の貸付（注1） 利息の受取（注1） 共通発生経費負担額（注4） 連結法人税の個別帰属額	千円 11,339,000 59,510 76,291 -	長期貸付金 未収入金 未払金 未払金	千円 11,466,000 23,956 7,932 431,573
親会社	FIL Asia Holdings Limited	シンガポール、ブルバード市	千米ドル 176,907	グループ会社経営管理	被所有 間接56 %	営業取引	共通発生経費負担額（注4）	千円 984,159	未払金	千円 5,374

(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 5,207,500	証券業	なし	当社設定投資信託の募集・販売	共通発生経費負担額（注4） 投資信託販売に係る代行手数料（注5）	千円 935,172 420,578	未払金 未払金	千円 39,208 27,599

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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

第27期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称	会社等の所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
親会社	FIL Limited	英領バ ミュー ダ、ペン ブロー ク市	千米ドル	投資顧 問業	被所有 間接100 %	投資顧問 契約の再 委任等役 員の兼任	委託調査 等報酬 （注3）	千円	未収入金	千円
			2,957				共通発生 経費負担額 （注4）	4,943,011	未払金	185,790
			-				共通発生 経費負担額 （注4）	-	関係会社 引当金	1,255,160
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	グルー プ会社 経営 管理	被所有 直接100 %	当事業 活動の管 理等役員 の兼任	金銭の貸付 （注1）	千円	長期 貸付金	千円
			4,510,000				利息の受取 （注1）	1,084,000	未収入金	12,550,000
			-				共通発生 経費負担額 （注4）	69,342	未収入金	22,834
			-				連結法人税の 個別帰属額	55,472	未払金	7,008
親会社	FIL Asia Holdings Limited	シンガ ポール、 ブルバ ード市	千米ドル	グルー プ会社 経営 管理	被所有 間接61 %	営業取引	共通発生 経費負担額 （注4）	千円	未払金	千円
176,907	1,003,209	107,176								

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

属性	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
同一の 親会社 をもつ 会社	フィデリ ティ 証券株 式会社	東京都港区	千円	証券業	なし	当社設定 投資信託 の募集・ 販売	共通発生 経費負担額 （注4）	千円	未収入金	千円
			5,957,500				投資信託販売 に係る代行手 数料 （注5）	597,370	未収入金	8,738
								503,303	未払金	43,715

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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

(1株当たり情報)

	第26期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第27期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	364,478円20銭	406,497円75銭
1株当たり当期純利益	27,153円51銭	27,286円73銭

(注1)1. なお潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
2. 1株当たり当期純損失金額又は1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第26期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第27期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
当期純利益(千円)	543,070	556,534
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	543,070	556,534
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。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）（５）において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記（３）（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 事業譲渡または事業譲受

該当ありません。

(3) 出資の状況

該当ありません。

(4) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社に関し、訴訟事件その他委託会社に重要な影響を与えた事実および重要な影響を与えることが予想される事実は存在していません。

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】

ファンドの運営における役割	名称	資本金の額 (2013年3月末日現在)	事業の内容
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。
<参考情報> 再信託受託会社	日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	51,000百万円	
販売会社	カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
	大和証券株式会社	100,000百万円	
	野村證券株式会社	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	5,957百万円	
	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	47,937百万円	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	
	ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
	楽天証券株式会社	7,495百万円	
	マネックス証券株式会社	7,425百万円	
	S M B C フレンド証券株式会社	27,270百万円	
	高木証券株式会社	11,069百万円	
	静銀ティーエム証券株式会社（注）	3,000百万円	

ファンドの運営における役割	名称	資本金の額 (2013年3月末日現在)	事業の内容
	三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。
	株式会社名古屋銀行	25,090百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
	株式会社京都銀行	42,103百万円	
	株式会社三重銀行	15,295百万円	
	株式会社三菱東京UFJ銀行	1,711,958百万円	
	株式会社北越銀行	24,538百万円	
	株式会社イオン銀行	51,250百万円	
	株式会社新生銀行	512,204百万円	
	株式会社池田泉州銀行	50,710百万円	
	日本生命保険相互会社	1,250,000百万円* * 相互会社であるため、「基金」の額です。	
	明治安田生命保険相互会社	620,000百万円* * 相互会社であるため、「基金」の額です。	
運用の委託先	FILインベストメンツ・インターナショナル	225,365英ポンド (約31百万円*) * 1英ポンド139.52円で換算 (2012年12月末日現在)	主として英国およびヨーロッパにおいて投資信託の販売および投資信託会社に対する投資運用業務を営んでいます。
	フィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニー	7,950米ドル (約0.68百万円*) * 1米ドル86.58円で換算 (2012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。

(注) 静銀ティーエム証券株式会社は、2013年10月22日より取扱開始予定です。

2 【関係業務の概要】

- (1) 受託会社： ファンドの受託銀行として、委託会社との信託契約の締結、信託財産の保管・管理、信託財産の計算（ファンドの基準価額の計算）、外国証券を保管・管理する外国の金融機関への指示および連絡等を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。
- (2) 販売会社： ファンドの販売会社として、ファンドの募集・販売の取扱い、目論見書・運用報告書の交付、信託契約の一部解約に関する事務、受益者への収益分配金・一部解約金・償還金の支払に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、所得税・地方税の源泉徴収、取引報告書・計算書等の交付等を行ないます。

(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 ケント)	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。
フィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニー (所在地：米国 マサチューセッツ州)	委託会社より運用の指図に関する権限の委託を受け、マザーファンドのアセット・アロケーション、米国国債／政府機関債、米国高利回り社債（ハイ・イールド・ボンド）、エマージング諸国等に関する運用の指図を行ないます。

3【資本関係】

- (1) 受託会社：該当事項はありません。
- (2) 販売会社：該当事項はありません。
- (3) 運用の委託先：該当事項はありません。

第3【参考情報】

当計算期間において、下記の書類が関東財務局長に提出されております。

2013年2月27日 臨時報告書
2013年4月19日 有価証券報告書
2013年4月19日 有価証券届出書
2013年5月27日 臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成25年9月4日

フィデリティ投信株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているフィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）の平成25年1月22日から平成25年7月22日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

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

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）の平成25年7月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

フィデリティ投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年9月4日

フィデリティ投信株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているフィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）の平成25年1月22日から平成25年7月22日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

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

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）の平成25年7月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

フィデリティ投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月24日

フィデリティ投信株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 梅木 典子
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているフィデリティ投信株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

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

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ投信株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注) 1．上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。