

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年8月19日提出
【発行者名】	フィデリティ投信株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 デレック・ヤング
【本店の所在の場所】	東京都港区六本木七丁目7番7号
【事務連絡者氏名】	照沼 加奈子
【電話番号】	03 - 4560 - 6000
【届出の対象とした募集 （売出）内国投資信託受益 証券に係るファンドの名称】	フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド
【届出の対象とした募集 （売出）内国投資信託受益 証券の金額】	6兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2022年2月18日付けをもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するとともに、その他の情報について訂正すべき事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（略）

委託会社の概況（2021年12月末日現在）

（略）

<訂正後>

（略）

委託会社の概況（2022年6月末日現在）

（略）

3【投資リスク】

<訂正前>

（略）

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2017年1月～2021年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

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

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

※2017年1月～2021年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

代表的な資産クラスの指数

日本株 TOPIX (配当込)	東証株価指数 (TOPIX) は、株式会社東京証券取引所 (株) 東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) の商標に関するすべての権利は (株) 東京証券取引所 が有しています。なお、本商品は、(株) 東京証券取引所 により提供、保証又は販売されるものではなく、(株) 東京証券取引所 は、本商品の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCI コクサイ・インデックス (税引前配当金込/円ベース)	MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が開発した、日本を除く先進国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他知的財産権は MSCI Inc. に帰属しております。
新興国株 MSCI エマージング・マーケット・インデックス (税引前配当金込/円ベース)	MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が開発した、エマージング諸国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他知的財産権は MSCI Inc. に帰属しております。
日本国債 NOMURA-BPI 国債	NOMURA-BPI 国債は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公券利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI 国債の知的財産権およびその他一切の権利は野村證券に帰属します。なお、野村證券株式会社は NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて運用される当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLC により運営されている債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
新興国債 JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円ベース)	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルシー、が算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。当指数の著作権はジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属しております。指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は JPMorgan Chase & Co. 及び関係会社 (「JPモルガン」) に帰属しております。JPモルガンは、指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。JPモルガンは、指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドを推奨するものでもなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

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

< 訂正後 >

（略）

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2017年7月～2022年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

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

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

※2017年7月～2022年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

代表的な資産クラスの指数

日本株 TOPIX (配当込)	東証株価指数 (TOPIX) (以下「TOPIX」という。)の指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社 (以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCI コクサイ・インデックス (税引前配当金込/円ベース)	MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く先進国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他知的所有権はMSCI Inc.に帰属しております。
新興国株 MSCI エマージング・マーケット・インデックス (税引前配当金込/円ベース)	MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した、エマージング諸国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他知的所有権はMSCI Inc.に帰属しております。
日本国債 NOMURA-BPI 国債	NOMURA-BPI 国債は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI 国債の知的財産権およびその他一切の権利は野村證券に帰属します。なお、野村證券株式会社はNOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて運用される当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債 JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円ベース)	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー、が算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。当指数の著作権はジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属しております。指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利はJPMorgan Chase & Co.及び関係会社 (「JPモルガン」)に帰属しております。JPモルガンは、指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。JPモルガンは、指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドを推奨するものでもなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

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

4【手数料等及び税金】

（５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、2021年12月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更となる場合があります。

（略）

<訂正後>

（略）

上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、2022年6月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更となる場合があります。

（略）

5【運用状況】

原届出書「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

(2022年6月30日現在)

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	477,250,355,860	100.04
預金・その他の資産(負債控除後)	-	201,063,518	0.04
合計(純資産総額)		477,049,292,342	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・USハイ・イールド・マザーファンド

(2022年6月30日現在)

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	23,435,865,443	4.33
	ルクセンブルグ	1,072,440,485	0.20
	バミューダ	624,333,552	0.12
	ケイマン諸島	79,504,263	0.01
	小計	25,212,143,743	4.66
新株予約権証券	アメリカ	1,653,672,881	0.31
	ケイマン諸島	243,795,843	0.05
	小計	1,897,468,724	0.35
社債券	アメリカ	377,904,753,330	69.85
	カナダ	17,045,085,632	3.15
	オランダ	14,503,320,174	2.68
	ルクセンブルグ	8,315,990,009	1.54
	ケイマン諸島	6,125,596,314	1.13
	イギリス	5,068,864,230	0.94
	パナマ	4,965,507,518	0.92
	オーストラリア	4,423,369,756	0.82
	アイルランド	4,392,777,139	0.81
	マーシャル諸島	2,962,113,078	0.55
	フランス	2,782,515,872	0.51
	リベリア	2,739,694,083	0.51

	バミューダ	2,593,505,750	0.48
	ブラジル	1,774,275,883	0.33
	イギリス領バー ジン諸島	1,449,057,441	0.27
	国際機関	1,033,012,269	0.19
	フィンランド	455,131,532	0.08
	ポーランド	419,611,871	0.08
	スペイン	269,686,725	0.05
	モーリシャス	187,166,175	0.03
	小計	459,411,034,781	84.91
預金・その他の資産（負債控除後）	-	54,505,439,914	10.07
合計（純資産総額）		541,026,087,162	100.00

（注）投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他資産の投資状況

（2022年6月30日現在）

資産の種類	国・地域	時価合計 （円）	投資比率 （%）
為替予約取引（買建）	日本	299,136,098	0.06
為替予約取引（売建）	日本	1,946,262	0.00
貸付債権	アメリカ	21,528,889,290	3.97

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

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

（2022年6月30日現在）

順位	種類	銘柄名	国・地域	数量 （口数）	帳簿価 額単価 （円）	帳簿価額 金額 （円）	評価額 単価 （円）	評価額 金額 （円）	投資 比率 （%）
1	親投資 信託受 益証券	フィデリ ティ・U S ハイ・イ ールド・マ ザーファン ド	日本	108,394,548,107	4.4407	481,356,668,089	4.4029	477,250,355,860	100.04

種類別投資比率

（2022年6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・U Sハイ・イールド・マザーファンド

（2022年6月30日現在）

順位	銘柄名	通貨 地域	種類 業種	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	INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	アメリカ・ドル オランダ	社債券 -	68,027,000	13,121.28 8,926,013,145	13,295.55 9,044,561,757	7.000 2023/06/30	1.67
2	SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	44,955,000	17,176.98 7,721,913,894	16,377.41 7,362,463,604	8.750 2032/03/15	1.36
3	ALLY 8% GLOBAL	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	34,804,000	15,910.78 5,537,588,609	15,038.76 5,234,091,325	8.000 2031/11/01	0.97
4	TWITTER INC 5% 03/01/30 144A	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	38,105,000	13,326.30 5,077,986,615	12,989.66 4,949,708,860	5.000 2030/03/01	0.91
5	JPMORGAN CHASE 5.15% PERP	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	35,000,000	13,053.07 4,568,576,838	12,933.34 4,526,670,750	5.150 2049/12/31	0.84
6	PG&E 4.55% 07/01/30	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	36,411,500	12,492.55 4,548,725,571	12,061.19 4,391,660,167	4.550 2030/07/01	0.81
7	PG&E 4.95% 07/01/50	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	40,141,500	11,094.45 4,453,479,561	10,848.02 4,354,557,241	4.950 2050/07/01	0.80
8	DISH NETWK CV 3.375% 8/26 144A	アメリカ・ドル アメリカ	外国新 株予約 権付社 債(CB) -	45,366,000	10,162.15 4,610,164,598	9,232.73 4,188,522,106	3.375 2026/08/15	0.77
9	CHS/CMNTY HEALTH 8% 3/26 144A	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	29,005,000	13,372.49 3,878,692,998	12,552.01 3,640,709,862	8.000 2026/03/15	0.67
10	CHESAPEAKE ENERGY CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 エネル ギー	303,645	12,455.64 3,782,095,358	11,892.53 3,611,106,300	0.000 -	0.67
11	DISH DBS CORP 5.875% 7/22	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	26,265,000	13,685.08 3,594,387,575	13,665.27 3,589,182,219	5.875 2022/07/15	0.66
12	ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	23,520,000	15,955.20 3,752,663,773	15,242.69 3,585,080,753	8.000 2031/11/01	0.66
13	CAESARS E 8.125% 07/01/27	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	26,470,000	13,373.59 3,539,989,611	13,246.21 3,506,270,601	8.125 2027/07/01	0.65
14	SOUTHEASTERN GROCERS INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 小売	1,048,276	3,214.71 3,369,907,113	3,334.99 3,495,992,073	0.000 -	0.65
15	OCCIDENTAL PETE 7.5% 05/01/31	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	22,290,000	15,479.01 3,450,271,329	14,727.27 3,282,708,483	7.500 2031/05/01	0.61
16	CITIGROUP 5.35% PERP	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	25,370,000	13,117.58 3,327,932,491	12,737.76 3,231,568,676	5.350 2049/12/31	0.60
17	TRANSDIGM INC 5.5% 11/15/27	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	27,775,000	12,198.69 3,388,186,147	11,617.80 3,226,843,950	5.500 2027/11/15	0.60
18	ACRISURE LLC 7% 11/15/25 144A	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	25,675,000	12,956.71 3,326,637,161	12,359.43 3,173,282,543	7.000 2025/11/15	0.59

19	UBER TECH INC 4.5% 08/15/29 144A	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	27,145,000	11,754.48 3,190,753,596	11,259.02 3,056,259,621	4.500 2029/08/15	0.56
20	JONAH EGY LLC / JONAH EGY FIN	アメリカ・ドル アメリカ	株式 エネルギー	336,560	8,638.17 2,907,264,514	8,904.70 2,996,966,505	0.000 -	0.55
21	GEMS MENAS 7.125% 7/31/26 144A	アメリカ・ドル ケイマン諸島	社債券 -	21,875,000	13,189.62 2,885,229,375	12,858.99 2,812,904,298	7.125 2026/07/31	0.52
22	BRAND ENERGY 8.5% 7/25 144A	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	27,100,000	10,387.68 2,815,061,280	10,282.85 2,786,651,385	8.500 2025/07/15	0.52
23	BOMBARDIER 7.875% 04/27 144A	アメリカ・ドル カナダ	社債券 -	24,165,000	11,649.91 2,815,203,119	11,473.60 2,772,596,068	7.875 2027/04/15	0.51
24	ALLIANT HLDG 6.75% 10/27 144A	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	22,620,000	12,420.79 2,809,583,829	12,048.48 2,725,365,877	6.750 2027/10/15	0.50
25	DISH NETWK CV 2.375% 3/15/24	アメリカ・ドル アメリカ	外国新 株予約 権付社 債(CB) -	22,633,000	12,137.18 2,747,008,854	12,027.84 2,722,261,027	2.375 2024/03/15	0.50
26	DPL INC 4.35% 04/15/29	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	22,705,000	12,173.54 2,764,002,456	11,894.17 2,700,570,608	4.350 2029/04/15	0.50
27	INTELSAT JACKSN 6.5% 1/30 144A	アメリカ・ドル ルクセンブルグ	社債券 -	23,650,000	12,311.99 2,911,787,460	11,346.35 2,683,412,607	6.500 2030/03/15	0.50
28	EG GLOBAL FINANCE PLC 6.75% 02	アメリカ・ドル イギリス	社債券 -	20,670,000	13,121.28 2,712,168,576	12,887.28 2,663,801,569	6.750 2025/02/07	0.49
29	CALIFORNIA RES CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 エネルギー	481,229	5,739.19 2,761,866,204	5,393.39 2,595,457,023	0.000 -	0.48
30	CARNIVAL CORP 9.875% 08/01/27 144A	アメリカ・ドル パナマ	社債券 -	19,185,000	14,278.95 2,739,418,399	13,462.98 2,582,872,713	9.875 2027/08/01	0.48

（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・U Sハイ・イールド・マザーファンド

（2022年6月30日現在）

種 類	国内 / 外国	業種 / 種別	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	2.99
		消費者サービス	0.21
		小売	0.65
		食品・生活必需品小売り	0.02
		各種金融	0.00
		電気通信サービス	0.29
		公益事業	0.37
	メディア・娯楽	0.13	
	小計		4.66
新株予約権証券	外国	-	0.35
	小計		0.35
公社債券	外国	社債券	84.91
	小計		84.91
合計（対純資産総額比）			89.93

【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】

該当事項はありません。

（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・USハイ・イールド・マザーファンド

（2022年6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	2,189,250	299,130,407	299,136,098	0.06
	アメリカ・ドル	売建	14,240	1,938,107	1,946,262	0.00
貸付債権	アメリカ・ドル	-	172,016,903.28	21,883,203,830	21,528,889,290	3.97

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

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

2022年6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。

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11月22日 (第16特定期間)	445,728	452,208	0.4815	0.4885
2013年5月22日 (第17特定期間)	782,534	791,661	0.6001	0.6071
2013年11月22日 (第18特定期間)	1,062,525	1,076,226	0.5429	0.5499
2014年5月22日 (第19特定期間)	1,257,154	1,273,899	0.5255	0.5325
2014年11月25日 (第20特定期間)	1,278,775	1,294,616	0.5651	0.5721
2015年5月22日 (第21特定期間)	1,167,753	1,182,604	0.5504	0.5574
2015年11月24日 (第22特定期間)	1,036,492	1,051,404	0.4866	0.4936
2016年5月23日 (第23特定期間)	821,300	835,546	0.4036	0.4106
2016年11月22日 (第24特定期間)	855,660	866,703	0.3875	0.3925
2017年5月22日 (第25特定期間)	943,684	955,875	0.3871	0.3921
2017年11月22日 (第26特定期間)	970,210	978,047	0.3714	0.3744
2018年5月22日 (第27特定期間)	786,317	793,049	0.3504	0.3534
2018年11月22日 (第28特定期間)	672,164	678,190	0.3346	0.3376
2019年5月22日 (第29特定期間)	631,712	637,484	0.3283	0.3313
2019年11月22日 (第30特定期間)	596,234	601,977	0.3114	0.3144
2020年5月22日 (第31特定期間)	508,021	513,660	0.2703	0.2733
2020年11月24日 (第32特定期間)	509,942	513,610	0.2780	0.2800
2021年5月24日 (第33特定期間)	502,836	506,238	0.2957	0.2977
2021年11月22日 (第34特定期間)	493,552	496,748	0.3088	0.3108

2022年5月23日 (第35特定期間)	465,479	468,555	0.3027	0.3047
2021年6月末日	511,895	-	0.3045	-
2021年7月末日	501,010	-	0.3006	-
2021年8月末日	499,939	-	0.3025	-
2021年9月末日	501,149	-	0.3066	-
2021年10月末日	500,388	-	0.3104	-
2021年11月末日	487,071	-	0.3053	-
2021年12月末日	491,205	-	0.3108	-
2022年1月末日	475,294	-	0.3023	-
2022年2月末日	465,937	-	0.2975	-
2022年3月末日	486,977	-	0.3129	-
2022年4月末日	490,885	-	0.3178	-
2022年5月末日	482,169	-	0.3136	-
2022年6月末日	477,049	-	0.3115	-

【分配の推移】

期	1口当たりの分配金(円)
第16特定期間(第95期～第100期計算期間合計)	0.0420
第17特定期間(第101期～第106期計算期間合計)	0.0420
第18特定期間(第107期～第112期計算期間合計)	0.0420
第19特定期間(第113期～第118期計算期間合計)	0.0420
第20特定期間(第119期～第124期計算期間合計)	0.0420
第21特定期間(第125期～第130期計算期間合計)	0.0420
第22特定期間(第131期～第136期計算期間合計)	0.0420
第23特定期間(第137期～第142期計算期間合計)	0.0420
第24特定期間(第143期～第148期計算期間合計)	0.0400
第25特定期間(第149期～第154期計算期間合計)	0.0300
第26特定期間(第155期～第160期計算期間合計)	0.0280
第27特定期間(第161期～第166期計算期間合計)	0.0180
第28特定期間(第167期～第172期計算期間合計)	0.0180
第29特定期間(第173期～第178期計算期間合計)	0.0180
第30特定期間(第179期～第184期計算期間合計)	0.0180
第31特定期間(第185期～第190期計算期間合計)	0.0180
第32特定期間(第191期～第196期計算期間合計)	0.0130
第33特定期間(第197期～第202期計算期間合計)	0.0120
第34特定期間(第203期～第208期計算期間合計)	0.0120
第35特定期間(第209期～第214期計算期間合計)	0.0120

【収益率の推移】

期	収益率(%)
第16特定期間（第95期～第100期計算期間合計）	9.5
第17特定期間（第101期～第106期計算期間合計）	33.4
第18特定期間（第107期～第112期計算期間合計）	2.5
第19特定期間（第113期～第118期計算期間合計）	4.5
第20特定期間（第119期～第124期計算期間合計）	15.5
第21特定期間（第125期～第130期計算期間合計）	4.8
第22特定期間（第131期～第136期計算期間合計）	4.0
第23特定期間（第137期～第142期計算期間合計）	8.4
第24特定期間（第143期～第148期計算期間合計）	5.9
第25特定期間（第149期～第154期計算期間合計）	7.6
第26特定期間（第155期～第160期計算期間合計）	3.2
第27特定期間（第161期～第166期計算期間合計）	0.8
第28特定期間（第167期～第172期計算期間合計）	0.6
第29特定期間（第173期～第178期計算期間合計）	3.5
第30特定期間（第179期～第184期計算期間合計）	0.3
第31特定期間（第185期～第190期計算期間合計）	7.4
第32特定期間（第191期～第196期計算期間合計）	7.7
第33特定期間（第197期～第202期計算期間合計）	10.7
第34特定期間（第203期～第208期計算期間合計）	8.5
第35特定期間（第209期～第214期計算期間合計）	1.9

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

(4)【設定及び解約の実績】

下記計算期間中の設定および解約の実績ならびに当該計算期間末の発行済数量は次のとおりです。

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第16特定期間 (2012年5月23日～2012年11月22日)	139,476,286,412	164,940,003,639	925,660,897,574
第17特定期間 (2012年11月23日～2013年5月22日)	647,001,231,044	268,701,675,570	1,303,960,453,048
第18特定期間 (2013年5月23日～2013年11月22日)	881,557,016,214	228,273,593,055	1,957,243,876,207
第19特定期間 (2013年11月23日～2014年5月22日)	826,259,402,555	391,378,412,332	2,392,124,866,430
第20特定期間 (2014年5月23日～2014年11月25日)	507,253,208,668	636,487,275,924	2,262,890,799,174
第21特定期間 (2014年11月26日～2015年5月22日)	327,810,616,892	469,025,369,868	2,121,676,046,198
第22特定期間 (2015年5月23日～2015年11月24日)	302,980,254,448	294,445,401,205	2,130,210,899,441
第23特定期間 (2015年11月25日～2016年5月23日)	210,078,726,578	305,108,865,627	2,035,180,760,392
第24特定期間 (2016年5月24日～2016年11月22日)	362,745,045,542	189,491,873,918	2,208,433,932,016
第25特定期間 (2016年11月23日～2017年5月22日)	645,461,557,367	415,757,494,279	2,438,137,995,104
第26特定期間 (2017年5月23日～2017年11月22日)	523,998,513,106	349,927,775,660	2,612,208,732,550
第27特定期間 (2017年11月23日～2018年5月22日)	114,672,021,353	482,726,574,473	2,244,154,179,430
第28特定期間 (2018年5月23日～2018年11月22日)	78,862,703,922	314,344,371,249	2,008,672,512,103
第29特定期間 (2018年11月23日～2019年5月22日)	108,220,276,501	192,738,173,450	1,924,154,615,154
第30特定期間 (2019年5月23日～2019年11月22日)	134,124,907,760	143,779,462,933	1,914,500,059,981
第31特定期間 (2019年11月23日～2020年5月22日)	122,903,625,280	157,864,730,746	1,879,538,954,515
第32特定期間 (2020年5月23日～2020年11月24日)	105,883,397,875	151,305,089,011	1,834,117,263,379
第33特定期間 (2020年11月25日～2021年5月24日)	66,811,347,003	200,183,026,213	1,700,745,584,169
第34特定期間 (2021年5月25日～2021年11月22日)	59,713,905,811	162,346,282,038	1,598,113,207,942
第35特定期間 (2021年11月23日～2022年5月23日)	50,159,824,797	110,414,942,627	1,537,858,090,112

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

< 参考情報 >

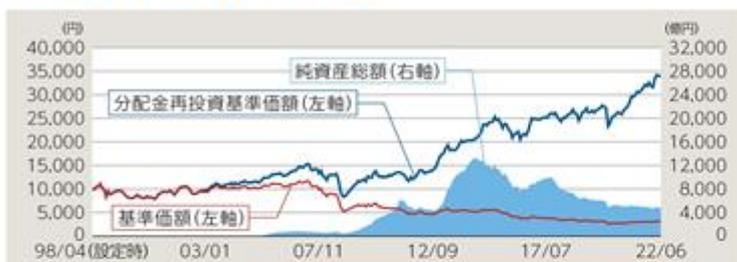
(2022年6月30日現在)

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

※下記データは過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

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

基準価額・純資産の推移



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

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

基準価額	3,115円
純資産総額	4,770.5億円

分配の推移

(1万口当たり/税引前)

決算期	分配金
2022年2月	20円
2022年3月	20円
2022年4月	20円
2022年5月	20円
2022年6月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	13,510円

主要な資産の状況(マザーファンド)

組入上位10銘柄						
銘柄	クーポン	償還日	業種	格付	比率	
1 インタージェン	7%	2023/6/30	公益	B	1.7%	
2 スプリント・キャピタル・コーポレーション	8.75%	2032/3/15	通信	BB/Ba	1.4%	
3 アリー	8%	2031/11/1	銀行	BBB/Baa	1.0%	
4 ツイッター	5%	2030/3/1	各種メディア	BB/Ba	0.9%	
5 JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	5.15%	2049/12/31	銀行	BBB/Baa	0.8%	
6 パシフィック・ガス&エレクトリック	4.55%	2030/7/1	公益	BBB/Baa	0.8%	
7 パシフィック・ガス&エレクトリック	4.95%	2050/7/1	公益	BBB/Baa	0.8%	
8 ディッシュ・ネットワーク	-	-	放送	-	0.8%	
9 CHS/コミュニティ・ヘルス・システムズ	8%	2026/3/15	ヘルスケア	B	0.7%	
10 チェサピーク・エナジー	-	-	エネルギー	-	0.7%	

資産別組入状況		格付別組入状況(対投資債券比率)		組入上位5業種(対投資資産比率)	
債券等	87.0%	A以上	-	エネルギー	17.1%
転換社債	1.9%	BBB/Baa	9.0%	ヘルスケア	7.9%
株式	4.7%	BB/Ba	39.5%	通信	7.2%
新株予約権証券(ワラント)	0.4%	B	35.6%	公益	6.9%
現金・その他	6.1%	CCC/Caa	14.3%	サービス	5.4%
		CC/Ca以下	-		
		格付なし	1.6%		

※別途記載がない限り、主要な資産の状況は対純資産総額比率です。

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

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

※クーポンは、銘柄属性として発行時に定められたものを表示しております。

※債券以外の銘柄は、クーポン・償還日・格付の属性を表示していません。

※2049/12/31は、永久債を表示しております。

※業種は原則としてICE BofAの分類によります。一部弊社の判断で分類しているものが含まれます。

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

※債券等には、金銭債権が含まれます。

年間収益率の推移



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

※2022年は年初以降6月末までの実績となります。

第2【管理及び運営】

2【換金（解約）手続等】

<訂正前>

（略）

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。

（略）

<訂正後>

（略）

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および既に受付けた一部解約の実行の請求の受付を取消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。

（略）

第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35特定期間（2021年11月23日から2022年5月23日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

1【財務諸表】

【フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第34特定期間 2021年11月22日現在	第35特定期間 2022年5月23日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	291,274,434	215,769,219
親投資信託受益証券	493,171,413,931	465,112,778,051
未収入金	4,715,382,851	4,327,975,667
流動資産合計	498,178,071,216	469,656,522,937
資産合計		
498,178,071,216		
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,196,226,415	3,075,716,180
未払解約金	673,901,914	372,279,933
未払受託者報酬	46,801,307	45,283,030
未払委託者報酬	692,659,481	670,188,922
その他未払費用	15,818,018	13,198,638
流動負債合計	4,625,407,135	4,176,666,703
負債合計		
4,625,407,135		
純資産の部		
元本等		
元本	1,598,113,207,942	1,537,858,090,112
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,104,560,543,861	1,072,378,233,878
(分配準備積立金)	-	16,922,909,809
元本等合計	493,552,664,081	465,479,856,234
純資産合計		
493,552,664,081		
負債純資産合計		
498,178,071,216		
469,656,522,937		

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第34特定期間 自 2021年5月25日 至 2021年11月22日	第35特定期間 自 2021年11月23日 至 2022年5月23日
営業収益		
有価証券売買等損益	46,178,569,442	13,407,333,678
営業収益合計	46,178,569,442	13,407,333,678
営業費用		
受託者報酬	276,225,632	264,099,179
委託者報酬	4,088,140,136	3,908,668,397
その他費用	15,939,795	13,296,348
営業費用合計	4,380,305,563	4,186,063,924
営業利益又は営業損失（ ）	41,798,263,879	9,221,269,754
経常利益又は経常損失（ ）	41,798,263,879	9,221,269,754
当期純利益又は当期純損失（ ）	41,798,263,879	9,221,269,754
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（ ）	577,260,701	155,134,280
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,197,908,720,704	1,104,560,543,861
剰余金増加額又は欠損金減少額	113,385,574,374	76,584,949,422
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	113,385,574,374	76,584,949,422
剰余金減少額又は欠損金増加額	41,545,469,935	34,741,753,519
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	41,545,469,935	34,741,753,519
分配金	19,712,930,774	18,727,021,394
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,104,560,543,861	1,072,378,233,878

（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当期末日が休日のため、2021年11月23日から2022年5月23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34特定期間 2021年11月22日現在	第35特定期間 2022年5月23日現在
1．元本の推移		
期首元本額	1,700,745,584,169 円	1,598,113,207,942 円
期中追加設定元本額	59,713,905,811 円	50,159,824,797 円
期中一部解約元本額	162,346,282,038 円	110,414,942,627 円
2．受益権の総数	1,598,113,207,942 口	1,537,858,090,112 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	1,104,560,543,861 円	1,072,378,233,878 円
4．1口当たり純資産額	0.3088 円	0.3027 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第34特定期間 自 2021年5月25日 至 2021年11月22日	第35特定期間 自 2021年11月23日 至 2022年5月23日
1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.33%以内の額	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
2．分配金の計算過程 （自2021年5月25日 至2021年6月22日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（2,043,953,171円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（111,142,684,621円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は113,186,637,792円（1口当たり0.067215円）であり、うち3,367,880,443円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。	2．分配金の計算過程 （自2021年11月23日 至2021年12月22日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（1,403,007,703円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（96,375,184,080円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は97,778,191,783円（1口当たり0.061799円）であり、うち3,164,410,796円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。

(自2021年6月23日 至2021年7月26日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(2,261,368,650円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(108,774,531,203円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は111,035,899,853円(1口当たり0.066577円)であり、うち3,335,584,909円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2021年7月27日 至2021年8月23日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(1,660,903,353円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(106,837,102,914円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は108,498,006,267円(1口当たり0.065584円)であり、うち3,308,658,709円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2021年8月24日 至2021年9月22日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(1,850,905,311円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(104,025,578,079円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は105,876,483,390円(1口当たり0.064719円)であり、うち3,271,867,824円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2021年9月23日 至2021年10月22日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(1,969,814,664円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(101,384,546,317円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は103,354,360,981円(1口当たり0.063943円)であり、うち3,232,712,474円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2021年12月23日 至2022年1月24日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(1,445,873,191円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(94,029,326,273円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は95,475,199,464円(1口当たり0.060722円)であり、うち3,144,662,208円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2022年1月25日 至2022年2月22日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(1,427,752,658円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(92,009,502,595円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は93,437,255,253円(1口当たり0.059637円)であり、うち3,133,548,888円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2022年2月23日 至2022年3月22日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(2,030,097,225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、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(89,835,717,706円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は91,865,814,931円(1口当たり0.058942円)であり、うち3,117,152,304円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2022年3月23日 至2022年4月22日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(2,317,048,582円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(19,150,764,232円)、信託約款に規定される収益調整金(88,027,490,992円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は109,495,303,806円(1口当たり0.070836円)であり、うち3,091,531,018円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2021年10月23日 至2021年11月22日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(1,533,433,117円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(98,999,563,788円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は100,532,996,905円(1口当たり0.062907円)であり、うち3,196,226,415円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2022年4月23日 至2022年5月23日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(1,810,188,968円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(87,677,840,045円)及び分配準備積立金(18,188,437,021円)より分配対象収益は107,676,466,034円(1口当たり0.070017円)であり、うち3,075,716,180円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

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

・金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第34特定期間 2021年11月22日現在	第35特定期間 2022年5月23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	501,820,545	22,554,244,189
合 計	501,820,545	22,554,244,189

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

（ア）株式

該当事項はありません。

（イ）株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	フィデリティ・USハイ・イールド・マ ザーファンド	109,593,020,276	465,112,778,051	
親投資信託受益証券	合計	109,593,020,276	465,112,778,051	
合計		109,593,020,276	465,112,778,051	

（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・USハイ・イールド・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・USハイ・イールド・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	2021年11月22日現在	2022年5月23日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	22,531,380,077	10,174,162,471
金銭信託	9,062,052	627,227,512
貸付債権	17,672,363,877	20,125,735,683
株式	33,433,514,598	26,110,135,202
新株予約権証券	2,049,328,492	1,941,719,835
社債券	485,720,145,747	462,097,443,800
派生商品評価勘定	6,922,724	71,702,383
未収入金	1,850,996,886	3,289,344,952
未収配当金	-	83,680,252
未収利息	6,323,610,885	7,172,467,293
前払費用	56,241,769	8,574,051
その他未収収益	176,930	-
流動資産合計	569,653,744,037	531,702,193,434
資産合計	569,653,744,037	531,702,193,434
負債の部		
流動負債		
未払金	10,194,478,194	1,416,786,306
未払解約金	5,668,513,272	4,835,137,173
その他未払費用	3,759	2,165
流動負債合計	15,862,995,225	6,251,925,644
負債合計	15,862,995,225	6,251,925,644
純資産の部		
元本等		
元本	134,169,229,116	123,809,121,637
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	419,621,519,696	401,641,146,153
元本等合計	553,790,748,812	525,450,267,790
純資産合計	553,790,748,812	525,450,267,790
負債純資産合計	569,653,744,037	531,702,193,434

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式、新株予約権証券</p> <p>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) 社債券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. 貸付債権の評価基準及び評価方法	<p>貸付債権</p> <p>原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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	2021年11月22日現在	2022年 5月23日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	149,641,802,470 円	134,169,229,116 円
期中追加設定元本額	1,766,690,918 円	2,003,225,115 円
期中一部解約元本額	17,239,264,272 円	12,363,332,594 円
2. 期末元本額及びその内訳		
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	119,481,396,921 円	109,593,020,276 円
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド （資産成長型）	10,470,762,801 円	10,386,267,891 円
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド （適格機関投資家専用）	3,976,211,070 円	3,449,808,136 円
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド （為替ヘッジあり）	25,076,107 円	234,143,969 円
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド （資産成長型）（為替ヘッジあり）	194,592,095 円	129,919,721 円
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド VA（適格機関投資家専用）	21,190,122 円	15,961,644 円
計	134,169,229,116 円	123,809,121,637 円
3. 受益権の総数	134,169,229,116 口	123,809,121,637 口
4. 1口当たり純資産額	4.1276 円	4.2440 円

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

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

・金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2021年11月22日現在	2022年5月23日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	7,612,997,324	255,928,719
新株予約権証券	828,093,486	353,312,546
社債券	571,414,509	61,492,283,005
合 計	9,012,505,319	61,589,666,832

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

種類	2021年11月22日 現在			2022年5月23日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年 超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	5,659,455,702	-	5,652,532,978	6,922,724	4,667,582,699	-	4,597,248,953	70,333,746
アメリカ・ドル	5,659,455,702	-	5,652,532,978	6,922,724	4,667,582,699	-	4,597,248,953	70,333,746
買建	-	-	-	-	459,670,444	-	461,039,081	1,368,637
アメリカ・ドル	-	-	-	-	459,670,444	-	461,039,081	1,368,637
合計	5,659,455,702	-	5,652,532,978	6,922,724	5,127,253,143	-	5,058,288,034	71,702,383

（注1）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

（注2）デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(ア) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	NRG ENERGY INC	94,200	45.72	4,306,824.00	
	SFL CORP LTD	74,260	11.09	823,543.40	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC A	11,185	479.03	5,357,950.55	
	VISTRA CORP	947,030	25.23	23,893,566.90	
	MESQUITE ENERGY INC	186,742	55.76	10,412,733.92	
	DENBURY INC	202,468	69.67	14,105,945.56	
	EP ENERGY CORP	566,555	9.28	5,257,630.40	
	CALIFORNIA RES CORP	481,229	41.99	20,206,805.71	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	303,945	91.13	27,698,507.85	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP PIPE	7,013	91.13	639,094.69	
	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC A	90,642	25.60	2,320,435.20	
	VALARIS LTD	84,683	55.98	4,740,554.34	
	FRONTIER COMMS PARENT INC	162,941	22.95	3,739,495.95	
	NOBLE CORP	17,908	31.91	571,444.28	
	NORTHEAST GROCERY INC PP	1,595,532	0.39	633,426.20	
	INTELSAT SA/LUXEMBOURG	196,159	39.01	7,652,162.59	
	CAESARS ENTERTAINMENT INC	206,998	50.11	10,372,669.78	
	SOUTHEASTERN GROCERS INC	1,048,276	23.52	24,655,451.52	
	PG&E CORP 5.5% PC 08/16/23	141,600	109.25	15,469,800.00	
	NEW COTAI LLC / CAP P/P	4,966,943	-	-	
	JONAH EGY LLC / JONAH EGY FIN	336,560	63.20	21,270,592.00	
NOBLE CORPORATION 144A	3,588	31.91	114,493.08		
PURE WEST ENERGY	7,789	12.00	93,506.94		
INTELSAT JACKSON CVR SER A RT	20,542	-	-		
INTELSAT JACKSON CVR SER B RT	20,542	-	-		

	PURE WEST ENERGY CVR	4,694	-	-	
アメリカ・ドル	小計	11,780,024		204,336,634.86 (26,110,135,202)	
合計		11,780,024		26,110,135,202 (26,110,135,202)	

(イ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	アメリカ・ドル	CALIFORNIA RES CRP WT 10/27/24	46,818.00	585,225.00	
		DENBURY INC WT 09/18/25	315,827.00	12,317,253.00	
		NOBLE CORPORATION TRANCHE 1 WT	72,804.00	1,237,668.00	
		NOBLE CORPORATION TRANCHE 2 WT	72,804.00	1,055,658.00	
	アメリカ・ドル	小計	508,253.00	15,195,804.00 (1,941,719,835)	
新株予約権証券	合計			1,941,719,835 (1,941,719,835)	
社債券	アメリカ・ドル	1011778 BC ULC 4% 10/15/30 144A	10,310,000.00	8,516,266.20	
		ACRISURE 10.125% 08/01/26 144A	5,055,000.00	5,072,490.30	
		ACRISURE LLC 7% 11/15/25 144A	25,675,000.00	24,338,873.00	
		ADTALEM GLOBA 5.5% 03/01/28 144A	10,160,000.00	9,013,444.00	
		ADVANCED DRAIN 5% 9/30/27 144A	1,210,000.00	1,131,350.00	
		AFFINTY GME 6.875% 12/15/27 144A	1,930,000.00	1,680,431.70	
		AHP HEALTH PAR 5.75% 7/29 144A	5,900,000.00	4,602,000.00	
		AIR CANADA 3.875% 08/15/26 144A	4,620,000.00	4,215,750.00	
		ALBERTSONS 3.5% 03/15/29 144A	3,395,000.00	2,815,134.00	
		ALBERTSONS 4.625% 1/15/27 144A	10,543,000.00	9,699,560.00	
		ALBERTSONS 4.875% 2/15/30 144A	15,497,000.00	13,623,412.70	
		ALCOA INC GLB 5.95 2/1/37	3,730,000.00	3,540,068.40	
		ALCOA NEDERLAND 4.125% 03/31/29 144A	6,035,000.00	5,544,595.90	

ALLEGHENY TECH 4.875% 10/01/29	2,540,000.00	2,180,894.80	
ALLEGHENY TECH 5.125% 10/01/31	1,780,000.00	1,500,006.00	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 5.8	5,860,000.00	5,481,385.40	
ALLEN MEDIA 10.5% 02/28 144A	13,850,000.00	10,214,236.50	
ALLIANT HLDG 5.875% 11/01/29 144A	6,220,000.00	5,247,814.00	
ALLIANT HLDG 6.75% 10/27 144A	22,620,000.00	20,555,925.00	
ALLIANT HLDG PEF A 9.75% PERP	3,000,000.00	2,535,000.00	
ALLIED UNV 6% 06/01/29 144A	2,375,000.00	1,801,793.75	
ALLY 8% GLOBAL	34,804,000.00	40,514,988.36	
ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31	23,520,000.00	27,455,836.80	
ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18 Escrow	6,605,000.00	-	
ALTICE FING 5% 01/15/28 144A	5,480,000.00	4,657,397.20	
ALTICE FING SA 5.75% 8/29 144A	15,990,000.00	13,548,007.20	
ALTICE FR 10.5% 5/15/27 144A	12,170,000.00	11,552,372.50	
ALTICE FR HLDS 6% 2/15/28 144A	6,000,000.00	4,717,500.00	
ALTICE FRANCE 5.125% 01/15/29 144A	4,690,000.00	3,810,625.00	
ALTICE FRANCE 5.125% 7/29 144A	9,920,000.00	8,000,281.60	
ALTICE FRANCE SA 5.5% 01/15/20	11,490,000.00	9,819,813.60	
AMWINS GROUP 4.875% 06/30/29 144A	3,035,000.00	2,701,150.00	
ANTERO MIDS 5.75% 1/15/28 144A	5,390,000.00	5,235,684.30	
ARCHES BUYER 4.25% 06/01/28 144A	3,285,000.00	2,824,278.75	
ARCHES BUYER 6.125% 12/01/28 144A	1,155,000.00	935,550.00	
ARCHROCK PR 6.25% 4/1/28 144A	5,800,000.00	5,481,000.00	
ARCONIC ROLLED 6% 5/15/25 144A	3,335,000.00	3,334,066.20	

ARCOSA INC 0% 03/31/29 144A	3,160,000.00	2,831,265.20	
ARD FIN SA 6.5% 06/30/27 144A	5,830,000.00	4,456,452.00	
ASBURY AUTOMO 4.625% 11/15/29 144A	3,075,000.00	2,686,781.25	
ASBURY AUTOMO 5% 02/15/32 144A	3,075,000.00	2,664,518.25	
ASBURY AUTOMOTI 4.5% 03/01/28	1,668,000.00	1,508,839.44	
ASBURY AUTOMOTI 4.75% 03/01/30	1,662,000.00	1,457,607.24	
ASGN INC 4.625% 05/15/28 144A	13,835,000.00	12,658,056.55	
ASHTON WO 6.625% 01/15/28 144A	85,000.00	79,262.50	
ASHTON WOODS US 4.625% 08/01/2	2,985,000.00	2,440,237.50	
ASSUREDPARTNE 5.625% 01/15/29 144A	2,965,000.00	2,460,950.00	
ATLANTICA SUS 4.125% 6/28 144A	2,790,000.00	2,461,868.10	
ATLAS LUX 4.625% 06/01/28 144A	3,000,000.00	2,535,000.00	
AVANTOR FUNDING 3.875% 11/01/29	4,710,000.00	4,125,065.10	
AVANTOR FUNDING 4.625% 07/15/28 144A	7,015,000.00	6,541,487.50	
AVIS BUDGET 5.375% 03/01/29 144A	3,385,000.00	3,036,378.85	
AVOLON HLD 4.375% 5/01/26 144A	18,000.00	17,274.42	
AVOLON HLDGS 2.528% 11/27 144A	9,509,000.00	8,125,440.50	
AVOLON HLDGS 3.95% 7/24 144A	25,000.00	24,394.00	
BANK OF AMERICA 6.1% VAR PERP	12,630,000.00	12,448,380.60	
BAUSCH HEALTH 9% 12/25 144A	5,565,000.00	4,452,000.00	
BELLRING BRANDS 7% 3/30 144A	4,755,000.00	4,570,791.30	
BERRY GBL ES 4.875% 7/26 144A	3,655,000.00	3,563,478.80	
BERRY GBL ES 5.625% 7/27 144A	3,000,000.00	2,925,240.00	

BIG RIV STL LLC 6.625% 01/31/2	12,541,000.00	12,462,618.75	
BK OF AMERCA CORP 4.3%/VAR PRP	6,295,000.00	5,502,081.80	
BLACK KNIGHT 3.625% 09/28 144A	5,650,000.00	5,155,625.00	
BOBOMBARDIER 7.125% 06/26 144A	7,380,000.00	6,251,893.20	
BOMBARDIER 7.875% 04/27 144A	24,165,000.00	20,597,037.75	
BOMBARDIER INC 6% 02/28 144A	7,710,000.00	6,013,800.00	
BOMBARDIER INC 7.5% 03/25 144A	11,871,000.00	10,980,675.00	
BOMBARDIER INC 7.5% 12/24 144A	8,651,000.00	8,131,940.00	
BOOZ ALLEN 3.875% 9/01/28 144A	5,080,000.00	4,570,425.20	
BRAND ENERGY 8.5% 7/25 144A	27,100,000.00	20,596,000.00	
BUILDERS F 4.25% 02/01/32 144A	12,090,000.00	10,305,032.40	
C AND S GRP 5% 12/15/28 144A	3,920,000.00	3,253,012.00	
C&W SR FIN 6.875% 9/15/27 144A	20,380,000.00	19,106,250.00	
CA MAGNUM HLD 5.375% 10/31/26 144A	1,565,000.00	1,385,025.00	
CABLEVS LHT 5.625% 09/15/28 144A	2,090,000.00	1,619,833.60	
CABLEVS LT LLC 3.875% 9/15/27 144A	2,645,000.00	2,248,382.25	
CAESARS E 8.125% 07/01/27	26,470,000.00	25,899,836.20	
CAESARS ENTERTA 4.625% 10/15/29 144A	6,000,000.00	4,852,200.00	
CALIFORNIA 7.125% 02/01/26 144A	8,730,000.00	8,740,912.50	
CAMELOT FIN SA 4.5% 11/26 144A	5,440,000.00	5,045,600.00	
CANPACK SA 3.125% 11/01/25 144A	3,435,000.00	3,177,375.00	
CARLYLE AVIAT 7% 10/15/24 144A	4,795,000.00	4,069,756.25	
CARLYLE AVIAT 7% 10/15/24 RGS	5,040,000.00	4,277,700.00	
CARNIVAL COR 5.75% 3/1/27 144A	11,865,000.00	10,174,949.40	

CARNIVAL CORP 4% 08/01/28 144A	10,645,000.00	9,260,298.40	
CARNIVAL CORP 9.875% 08/01/27 144A	19,185,000.00	20,042,569.50	
CCO HLDGS 4.75% 03/01/30 144A	12,395,000.00	10,932,637.90	
CCO HLDGS/ 4.25% 01/15/34 144A	8,000,000.00	6,380,000.00	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 04/33 144A	9,955,000.00	8,232,386.80	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 05/01/32	4,545,000.00	3,803,755.95	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 08/30 144A	12,200,000.00	10,480,532.00	
CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144	19,140,000.00	18,263,579.40	
CDI ESCROW ISSU 5.75% 04/01/30 144A	9,515,000.00	8,848,950.00	
CDK GLOBAL INC 4.875% 06/01/27	7,635,000.00	7,547,197.50	
CDK GLOBAL INC 5.25% 5/29 144A	2,910,000.00	2,895,450.00	
CDW LLC / CDW F 4.25% 04/01/28	7,050,000.00	6,531,966.00	
CEC ENT CO LLC 6.75% 5/26 144A	4,950,000.00	4,306,500.00	
CENTENE CORP 3.375% 2/15/30 WI	4,895,000.00	4,310,047.50	
CENTENE CORP 4.625% 12/15/29	9,050,000.00	8,631,437.50	
CENTRAL GARDEN 4.125% 10/15/30	3,435,000.00	2,902,575.00	
CENTURYLINK INC 4% 02/27 144A	9,745,000.00	8,671,783.15	
CF INDUS INC 5.375% 03/15/44	5,780,000.00	5,756,417.60	
CF INDUSTRI INC 5.15% 03/15/34	5,115,000.00	5,211,622.35	
CHARLES RIV 4.25% 5/1/28 144A	1,765,000.00	1,656,717.25	
CHARLES RIVER L 3.75% 03/15/29 144A	1,680,000.00	1,493,150.40	
CHARLES RIVER L 4% 03/15/31 144A	4,710,000.00	4,107,402.60	
CHEMOURS 4.625% 11/15/29 144A	4,800,000.00	4,164,000.00	
CHEMOURS CO 5.375% 05/15/2027	21,890,000.00	20,946,322.10	

CHEMOURS CO 5.75% 11/15/28 144A	13,765,000.00	13,043,989.30	
CHENIERE ENER 4.625% 10/15/28	6,660,000.00	6,277,050.00	
CHOBANI 7.5% 04/15/25 144A	2,345,000.00	2,186,712.50	
CHOBANI LLC/FIN 4.625% 11/15/28	2,990,000.00	2,637,329.50	
CHS/CMNTY HEA 6.875% 04/15/29 144A	6,570,000.00	4,837,162.50	
CHS/CMNTY HEALT 4.75% 02/15/31 144A	6,695,000.00	5,128,972.55	
CHS/CMNTY HEALT 5.25% 05/15/30 144A	10,895,000.00	8,772,980.85	
CHS/CMNTY HEALT 6% 01/15/29 144A	5,130,000.00	4,527,225.00	
CHS/CMNTY HEALT 6.125% 04/01/30 144A	12,790,000.00	8,837,378.40	
CHS/CMNTY HEALTH 8% 3/26 144A	33,240,000.00	32,521,351.20	
CHS/CMNTY HLT 5.625% 03/15/27 144A	5,130,000.00	4,639,059.00	
CITGO HLDG INC 9.25% 08/01/24 144A	6,335,000.00	6,208,300.00	
CITGO PETE COR 7% 6/15/25 144A	12,675,000.00	12,453,187.50	
CITGO PETROL 6.375% 06/26 144A	6,045,000.00	5,893,875.00	
CITIGROUP 5.35% PERP	25,370,000.00	24,348,350.10	
CITIGROUP INC 5%/VAR PERP	5,310,000.00	4,805,178.30	
CLEAR CHAN 7.75% 04/15/28 144A	3,180,000.00	2,588,901.60	
CLEAR CHAN IN 6.625% 08/01/25 144A	2,460,000.00	2,373,900.00	
CLEAR CHANNEL 7.5% 06/01/29 144A	5,830,000.00	4,655,080.10	
CLEARWY ENR 4.75% 3/15/28 144A	3,445,000.00	3,195,065.25	
CLEVELAND-CLIF 4.625% 3/1/29 144A	3,385,000.00	3,063,425.00	
CLEVELAND-CLIF 4.875% 3/1/31 144A	3,385,000.00	3,065,422.15	
CLYDESDALE ACQU 6.625% 3/29 144A	2,320,000.00	2,181,681.60	

CLYDESDALE ACQUI 8.75% 03/30 144A	13,965,000.00	11,740,235.85	
CNX RESOURCES C 6% 01/15/29 144A	2,465,000.00	2,329,425.00	
COGENT COMM 3.5% 05/01/26 144A	3,850,000.00	3,561,250.00	
COINBASE GLOBAL 3.375% 10/01/28 144A	21,040,000.00	15,008,042.40	
COINBASE GLOBAL 3.625% 10/01/31	12,770,000.00	8,555,900.00	
COLGATE ENERGY 5.875% 07/01/29	5,640,000.00	5,287,500.00	
COMMERCIAL META 3.875% 02/15/31	2,620,000.00	2,227,000.00	
COMSTOCK 5.875% 01/15/30 144A	3,545,000.00	3,208,225.00	
COMSTOCK RESO 6.75% 03/29 144A	7,995,000.00	7,707,819.60	
CONSLIDATED COM 5% 10/28 144A	2,990,000.00	2,332,170.10	
CORECIVIC INC 0% 04/30/26	8,245,000.00	8,270,559.50	
COVERT M 4.875% 12/01/29 144A	2,965,000.00	2,520,250.00	
CQP HOLDCO 5.5% 06/15/31 144A	16,265,000.00	14,962,824.10	
CRESTWOOD M P/F 6% 02/01/29 144A	17,165,000.00	16,006,362.50	
CRESTWOOD MID P/F 5.75% 4/1/25	8,145,000.00	7,961,737.50	
CROCS INC 4.125% 08/15/31 144A	5,425,000.00	4,126,960.25	
CROCS INC 4.25% 03/15/29 144A	3,365,000.00	2,659,460.45	
CROWDSTRIKE HOL 3% 02/15/29	6,125,000.00	5,344,062.50	
CROWNROCK LP / 5% 05/1/29 144A	1,855,000.00	1,759,968.35	
CSC HLDGS LLC 3.375% 02/15/31 144A	7,020,000.00	5,452,574.40	
CSC HLDGS LLC 4.125% 12/01/30 144A	5,315,000.00	4,359,894.50	
CSC HLDGS LLC 4.5% 11/15/31 144A	4,930,000.00	4,002,223.30	
CSC HLDGS LLC 4.625% 12/01/30 144A	12,335,000.00	8,965,571.40	

CSC HLDGS LLC 5% 11/15/31 144A	5,185,000.00	3,817,197.00	
CSC HLDGS LLC 5.375% 2/28 144A	2,325,000.00	2,095,778.25	
CSC HOLDINGS 5.75% 01/30 144A	8,985,000.00	6,985,837.50	
CSC HOLDINGS 7.5% 4/1/28 144A	20,300,000.00	17,559,500.00	
CVR ENERGY 5.25% 2/15/25 144A	11,525,000.00	10,974,220.25	
CVR ENERGY 5.75% 02/15/28 144A	11,525,000.00	10,568,425.00	
CVR PART LP/FIN 6.125% 06/15/28 144A	6,680,000.00	6,313,602.00	
DANA INC 4.25% 09/01/30	3,175,000.00	2,610,135.75	
DANA INC 5.625% 6/15/28	5,070,000.00	4,637,630.40	
DAVITA INC 0% 05/31/30 144A	14,645,000.00	12,022,226.95	
DAVITA INC 3.75% 02/15/31 144A	5,275,000.00	4,048,562.50	
DCP MIDSTR 5.85% 5/21/43 144A	5,575,000.00	4,919,937.50	
DCP MIDSTREAM 5.125% 05/15/29	9,305,000.00	8,906,746.00	
DELEK LOGISTIC 7.125% 06/01/28 144A	3,425,000.00	3,228,062.50	
DIAMOND SPORT 5.375% 08/15/26	6,430,000.00	2,105,825.00	
DIRECTV H 5.875% 08/15/27 144A	5,250,000.00	4,762,800.00	
DISH DBS 5.75% 12/01/28 144A	3,105,000.00	2,406,375.00	
DISH DBS CORP 5.875% 7/22	26,265,000.00	26,297,831.25	
DISH NETWK CV 2.375% 3/15/24	22,633,000.00	20,098,104.00	
DISH NETWK CV 3.375% 8/26 144A	45,366,000.00	33,729,621.00	
DPL INC 4.125% 07/01/25	17,145,000.00	16,207,168.50	
DPL INC 4.35% 04/15/29	22,705,000.00	20,222,435.30	
DT MIDSTREAM 4.125% 06/15/29 144A	5,735,000.00	5,075,475.00	
DT MIDSTREAM 4.375% 06/15/31 144A	5,735,000.00	5,068,306.25	

DUKE ENERGY FLD 8.125% 8/16/30	425,000.00	484,500.00	
EG GLOBAL 8.5% 10/30/25 144A	3,435,000.00	3,409,237.50	
EG GLOBAL FINANCE PLC 6.75% 02	20,670,000.00	19,843,200.00	
ELASTIC 4.125% 07/15/29 144A	2,790,000.00	2,332,467.90	
EMERGENT BIO 3.875% 08/15/30 144A	3,395,000.00	2,571,712.50	
ENDEAVOR 6.625% 7/15/25 144A	5,035,000.00	5,148,287.50	
ENDEAVOR ENERGY 5.75 1/28 144A	11,850,000.00	11,731,500.00	
ENLINK MID 5.625% 01/15/28 144A	2,255,000.00	2,192,987.50	
ENVIVA PT LP 6.5% 1/15/26 144A	14,850,000.00	14,627,250.00	
EQT CORP 3.125% 05/15/26 144A	3,875,000.00	3,631,107.50	
EQT CORP 3.625% 05/15/31 144A	3,875,000.00	3,469,675.00	
EQT CORP 5% 01/15/29	5,130,000.00	5,030,067.60	
ERO COPPER 6.5% 2/15/30 144A	16,530,000.00	14,091,825.00	
FERRELLGAS/FG 5.375% 04/01/26 144A	3,980,000.00	3,512,350.00	
FERTITTA ENTERT 4.625% 01/15/29 144A	6,405,000.00	5,572,350.00	
FERTITTA ENTERT 6.75% 07/15/30 144A	11,205,000.00	8,964,000.00	
FIRST QUANT 6.875% 10/27 144A	17,495,000.00	16,919,764.40	
FIRST QUANTUM 6.875% 3/26 144A	9,295,000.00	9,051,006.25	
FIRST QUANTUM 7.25% 4/23 144A	2,894,000.00	2,894,000.00	
FMG RES AG 5.875% 4/15/30 144A	9,275,000.00	8,763,576.50	
FMG RES AUG LTD 4.375% 04/01/31 144A	3,615,000.00	3,038,371.35	
FORD MOTOR 3.25% 02/12/32	9,450,000.00	7,483,455.00	
FORD MTR CR 5.125% 6/16/25	16,150,000.00	15,827,000.00	

FORD MTR CR LLC 2.9% 02/16/28	4,625,000.00	3,917,698.75	
FORD MTR CR LLC 3.625% 6/17/31	5,490,000.00	4,483,518.30	
FORD MTR CR LLC 4% 11/13/30	3,440,000.00	2,933,804.00	
FORD MTR CR LLC 4.95% 05/28/27	11,750,000.00	11,178,715.00	
FRONT RANGE BID 4% 3/1/27 144A	9,450,000.00	7,855,312.50	
FRONT RANGE BIDCO INC 6.125% 0	5,210,000.00	3,842,375.00	
FRONTIER 5.875% 11/01/29 144A	1,284,392.00	1,019,486.15	
FRONTIER COM 5.875% 10/15/27 144A	5,005,000.00	4,677,472.80	
FRONTIER COMM 5% 05/01/28 144A	5,150,000.00	4,583,500.00	
FRONTIER COMM 6% 01/31/30 144A	6,275,000.00	5,004,312.50	
FRONTIER COMM 6.75% 05/01/29 144A	5,810,000.00	4,727,364.60	
FRONTIER COMM 8.75% 05/15/30 144A	4,885,000.00	4,976,593.75	
GANNETT HOLDING 6% 11/01/26 144A	2,870,000.00	2,583,000.00	
GEMS MENAS 7.125% 7/31/26 144A	21,875,000.00	21,109,375.00	
GENESIS ENERGY LP 8% 01/15/27	5,905,000.00	5,482,792.50	
GEO GROUP 5.125% 4/1/23 WI	3,865,000.00	3,679,789.20	
GEO GROUP INC 5.875% 10/15/24	1,600,000.00	1,470,880.00	
GEO GROUP INC 6% 04/15/26	13,485,000.00	11,185,807.50	
GO DADDY OP 5.25% 12/1/27 144A	5,050,000.00	4,902,641.00	
GPC MERGER SU 7.125% 8/15/28 144A	3,040,000.00	2,572,752.00	
GRAPHIC PACK 3.75% 02/30 144A	2,510,000.00	2,156,617.10	
GREAT LAKE 5.25% 06/01/29 144A	3,140,000.00	2,888,800.00	
GRIFOLS ES 4.75% 10/15/28 144A	2,255,000.00	2,005,642.10	
H&E EQUIPMENT S 3.875% 12/15/28	8,460,000.00	7,042,950.00	
HARVEST MIDSTRE 7.5% 9/28 144A	12,085,000.00	12,160,531.25	

HAWAIIAN BRAND 5.75% 01/20/26 144A	5,095,000.00	4,845,090.25	
HCA INC 5.625% 09/01/28	8,770,000.00	8,972,762.40	
HCA INC 5.875% 02/01/2029	3,820,000.00	3,925,050.00	
HEALTH EQUITY INC 4.5% 10/01/29 144A	2,085,000.00	1,813,950.00	
HERTZ 4.625% 12/01/26 144A	3,580,000.00	3,051,950.00	
HERTZ 5% 12/01/29 144A	4,675,000.00	3,872,209.00	
HERTZ 5.5% 10/15/24 144A	6,520,000.00	8,150.00	
HERTZ CORP 6% 01/15/2028 144A	8,095,000.00	475,581.25	
HERTZ CORP 6.25% 10/15/22	5,980,000.00	7,475.00	
HERTZ CORP 7.125% 08/01/2026 1	8,230,000.00	473,225.00	
HESS INFRA/FI 4.25% 02/30 144A	3,345,000.00	2,968,687.50	
HESS MIDST 5.125% 6/15/28 144A	6,815,000.00	6,423,137.50	
HESS MIDSTREAM 5.5% 10/30 144A	1,990,000.00	1,890,500.00	
HIGHTOWER 6.75% 04/15/29 144A	2,160,000.00	1,878,703.20	
HILTON DOMEST 3.625% 02/15/32 144A	3,430,000.00	2,854,446.00	
HILTON DOMESTIC 3.75% 05/01/29	3,440,000.00	3,044,400.00	
HILTON DOMESTIC 4% 05/01/31 144A	3,440,000.00	2,988,500.00	
HOLOGIC INC 3.25% 02/15/29 144A	5,215,000.00	4,612,928.25	
HUB INTE 5.625% 12/01/29 144A	4,185,000.00	3,755,451.60	
HUB INTEL LTD 7% 5/01/26 144A	7,640,000.00	7,454,653.60	
HUBBAY MINERAL 6.125% 4/01/29 144A	9,850,000.00	8,535,222.00	
ICAHN LP/FN CO 4.375% 02/01/29	5,925,000.00	5,125,125.00	
ICAHN LP/FN COR 5.25% 05/15/27	13,520,000.00	12,759,500.00	
ICAHN LP/FN COR 6.25% 05/15/26	9,980,000.00	9,755,450.00	

ICAHN LP/FN COR 6.375% 12/15/2	13,815,000.00	13,526,680.95	
II-VI INC 5% 12/15/29 144A	3,060,000.00	2,756,937.60	
IMS HEALTH 5% 10/15/26 144A	5,060,000.00	4,985,112.00	
INFRABUILD AUST 12% 10/24 144A	13,890,000.00	14,028,900.00	
INTELSAT J H SA 5.5% 08/01/23	17,015,000.00	-	
INTELSAT JACKS 8.5% 10/24 144A	3,835,000.00	-	
INTELSAT JACKSN 6.5% 1/30 144A	23,650,000.00	21,303,683.50	
INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	68,027,000.00	65,305,920.00	
INTERTAPE POLYM 4.375% 06/15/29 144A	3,220,000.00	3,284,367.80	
ION TRADIN 5.75% 05/15/28 144A	5,715,000.00	5,136,356.25	
JACOBS ENT 6.75% 02/15/29 144A	2,750,000.00	2,461,855.00	
JAZZ SECU DAC 4.375% 01/15/29	4,460,000.00	4,098,918.40	
JBS USA LLC 6.5% 4/15/29 144A	7,880,000.00	7,958,800.00	
JBS USA/FIN 6.75% 02/28 144A	18,470,000.00	18,953,914.00	
JBS USA/LUX/FI 5.5% 01/30 144A	10,595,000.00	10,257,231.40	
JOSEPH T RYER 8.5% 8/1/28 144A	2,972,000.00	3,099,885.16	
JPMORGAN CHASE 5.15% PERP	35,000,000.00	33,425,350.00	
KEHE DISTR LLC / KEHE FIN COR	4,048,000.00	4,215,911.04	
KENNEDY-WILSON 4.75% 03/01/29	5,095,000.00	4,483,600.00	
KENNEDY-WILSON 5% 03/01/31	5,095,000.00	4,407,175.00	
KFC CO/PIZZA 4.75% 6/1/27 144A	7,630,000.00	7,478,010.40	
KLX ENERGY 11.5% 11/1/25 144A	7,250,000.00	4,567,500.00	
KOBE US MID PIK VAR 11/26 144A	12,375,000.00	12,003,750.00	
KRAFT HEINZ CO 4.375% 6/1/46	1,500,000.00	1,284,060.00	

KRAFT HEINZ FD 4.875% 10/01/49	7,485,000.00	6,832,233.15	
KRAFT HEINZ FD 5.5% 06/01/50	1,990,000.00	1,978,079.90	
KRONOS ACQ 7% 12/31/27 144A	1,485,000.00	1,150,875.00	
KRONOS ACQ K 5% 12/31/26 144A	1,170,000.00	1,023,750.00	
L BRANDS INC 6.625% 10/01/30 144A	10,425,000.00	9,683,678.25	
LAMAR MEDIA CRP 4.875% 01/15/2	4,330,000.00	4,084,748.80	
LAMB WESTON 4.125% 01/30 144A	4,710,000.00	4,171,599.90	
LCM INVESTMENTS 4.875% 05/01/29 144A	5,860,000.00	4,834,500.00	
LCPR SENIOR 5.125% 7/29 144A	5,635,000.00	4,903,407.95	
LCPR SR 6.75% 10/15/27 144A	5,264,000.00	5,133,821.28	
LEGENDS HOSPITAL 5% 02/01/26 144A	2,985,000.00	2,716,350.00	
LEVEL 3 FIN 3.75% 07/15/29 144A	8,720,000.00	6,932,400.00	
LEVEL 3 FINANCI 4.25% 07/01/28	7,065,000.00	5,810,962.50	
LINDBLAD E 6.75% 02/15/27 144A	4,725,000.00	4,479,678.00	
LIVE NATIN 4.75% 10/15/27 144A	7,085,000.00	6,368,989.90	
LSB INDUS 6.25% 10/15/28 144A	580,000.00	554,636.60	
MACYS RTL HLDG 5.875% 03/15/30	2,010,000.00	1,692,178.80	
MACYS RTL HLDG 6.125% 03/15/32	2,345,000.00	1,948,554.30	
MADISON IAQ 4.125% 06/28 144A	3,975,000.00	3,408,562.50	
MADISON IAQ 5.875% 6/29 144A	6,155,000.00	4,508,537.50	
MAGIC MERG 5.25% 05/1/28 144A	5,220,000.00	4,135,179.60	
MAGIC MERG 7.875% 05/1/29 144A	7,910,000.00	5,309,824.80	
MATCH GROUP INC 4.125% 08/01/2	5,750,000.00	4,997,497.50	
MATCH GROUP INC 5% 12/27 144A	7,545,000.00	7,196,043.75	

MATCH GRP 5.625% 02/15/29 144A	5,645,000.00	5,348,637.50	
MATTEL INC 3.375% 04/01/26 144A	1,685,000.00	1,594,566.05	
MATTEL INC 3.75% 04/01/29 144A	1,685,000.00	1,552,306.25	
MC BRAZIL DWNST 7.25% 06/31 144A	16,050,000.00	13,856,767.50	
MEG ENERGY CRP 5.875% 02/01/29 144A	7,390,000.00	7,056,415.40	
MERCER INTL 5.125% 02/01/29	5,195,000.00	4,660,746.20	
MESQUITE 15% PIK CONV 7/23 PP	1,469,441.00	7,582,315.56	
MESQUITE 15% PIK CONV 7/23 PP	2,536,305.00	11,793,818.25	
MGM RESORTS INTERNATIONAL 6.75	7,465,000.00	7,492,993.75	
MICROSTRATEGY 6.125% 06/15/28	17,355,000.00	14,187,712.50	
MINERAL RES 8.5% 5/1/30 144A	1,465,000.00	1,448,518.75	
MINERAL RES LT 8% 11/1/27 144A	6,125,000.00	6,120,161.25	
MINERVA MERGE 6.5% 02/15/30 144A	18,835,000.00	16,103,925.00	
MIWD HOLDCO II 5.5% 02/01/30 144A	1,300,000.00	1,079,000.00	
MOLINA HEA 4.375% 6/15/28 144A	3,800,000.00	3,553,342.00	
MOLINA HEALTHCA 3.875% 05/15/32 144A	6,725,000.00	5,885,787.25	
MOLINA HEALTHCA 3.875% 11/15/30 144A	4,985,000.00	4,412,123.80	
MOOG INC 4.25% 12/15/2027 144A	1,720,000.00	1,586,700.00	
MOZART DEBT 3.875% 04/01/29 144A	9,715,000.00	8,262,704.65	
MPT OPER PARTNER 5% 10/15/27	8,695,000.00	8,281,987.50	
MPT OPER PARTNERSHP 5.25% 8/26	8,675,000.00	8,544,875.00	
MSCI INC 4% 11/15/29 144A	13,690,000.00	12,513,344.50	
MURPHY OIL USA 3.75% 02/15/31 144A	2,245,000.00	1,922,281.25	

NABORS IND 5.75% 02/01/25	8,875,000.00	8,253,750.00	
NAVIOS LOG/FI 10.75% 7/25 144A	10,515,000.00	10,626,669.30	
NAVIOS MARIT 11.25% 8/22 144A	1,314,000.00	1,299,217.50	
NCL CORP 5.875% 02/15/27 144A	6,415,000.00	5,869,725.00	
NCL CORP 7.75% 02/15/29 144A	5,710,000.00	4,996,250.00	
NCL CORP LTD 5.875 03/15/26 144A	1,680,000.00	1,444,800.00	
NCL FINANCE LTD 6.125% 03/15/28 144A	2,075,000.00	1,708,866.25	
NESCO HOLDING 5.5% 04/15/29 144A	3,975,000.00	3,543,712.50	
NEW COTAI LLC CONV 5% 2/24/27	5,702,921.59	5,623,080.68	
NEW FORTRESS EN 6.75% 09/15/25	5,280,000.00	5,028,777.60	
NEW HOME CO 7.25% 10/15/25 144A	3,440,000.00	3,164,765.60	
NEXSTAR 5.625% 7/15/27 144A	6,745,000.00	6,499,616.90	
NEXTERA ENERGY 4.25% 9/24 144A	601,000.00	587,477.50	
NGL ENERGY OP 7.5% 02/01/26 144A	17,125,000.00	15,455,312.50	
NIELSEN FIN 5.875% 10/01/30 144A	5,245,000.00	4,969,637.50	
NIELSEN FINAN 5.625% 10/01/28 144A	5,245,000.00	4,972,312.45	
NORTHWEST FIN 10.75% 06/01/28 144A	2,995,000.00	2,785,350.00	
NORTHWEST FIN 4.75% 04/30/27 144A	3,525,000.00	3,040,312.50	
NORTHWEST FIN 6% 02/15/28 144A	1,825,000.00	1,418,244.00	
NOVA CHEM CORP 4.25% 05/15/29 144A	6,005,000.00	5,014,175.00	
NRG ENERGY 5.25% 06/15/29 144A	5,385,000.00	5,055,761.10	
NRG ENERGY INC 3.875% 02/15/32 144A	2,945,000.00	2,456,719.00	

NTH OIL & GAS 8.125% 03/01/28 144A	7,995,000.00	7,855,087.50	
OCCIDENTAL PETE 4.5% 07/15/44	1,985,000.00	1,755,692.80	
OCCIDENTAL PETE 5.55% 03/15/26	6,554,000.00	6,805,542.52	
OCCIDENTAL PETE 5.875% 9/01/25	3,520,000.00	3,687,200.00	
OCCIDENTAL PETE 6.2% 03/15/40	2,405,000.00	2,465,125.00	
OCCIDENTAL PETE 6.45% 09/15/36	4,200,000.00	4,490,304.00	
OCCIDENTAL PETE 6.6% 03/15/46	5,365,000.00	5,861,262.50	
OCCIDENTAL PETE 6.625% 9/1/30	17,605,000.00	19,011,815.55	
OCCIDENTAL PETE 6.95% 07/01/24	5,975,000.00	6,303,625.00	
OCCIDENTAL PETE 7.5% 05/01/31	22,290,000.00	25,243,425.00	
OCCIDENTAL PETR 6.375% 9/01/28	5,280,000.00	5,544,000.00	
OCCIDENTAL PETRO 4.3% 08/15/39	2,145,000.00	1,875,459.30	
OCCIDENTAL PETRO 6.125% 01/01/31	12,810,000.00	13,478,682.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM 4.4% 4/46	4,275,000.00	3,774,525.75	
OCCIDENTL PETE 8.875% 07/15/30	14,070,000.00	16,848,825.00	
ON SEMICONDUCT 3.875% 09/01/28 144A	6,575,000.00	6,097,786.50	
OPEN TEXT 4.125% 2/15/30 144A	7,655,000.00	6,851,225.00	
OPEN TEXT CORP 3.875% 12/01/29 144A	4,655,000.00	4,131,312.50	
OPEN TEXT HOLDI 4.125% 12/01/31 144A	4,655,000.00	4,036,909.10	
OPTION CARE HEA 4.375% 10/31/29	2,165,000.00	1,906,066.00	
ORGANON F 4.125% 04/30/28 144A	6,615,000.00	6,070,916.25	
ORGANON FINAN 5.125% 04/30/31 144A	6,600,000.00	5,953,530.00	

ORTHO-CLI 7.25% 02/01/28 144A	1,407,000.00	1,408,758.75	
ORTHO-CLI D 7.375% 6/1/25 144A	2,682,000.00	2,708,820.00	
OWENS MINOR INC 6.625% 04/30 144A	11,340,000.00	10,769,711.40	
PACIFIC GAS & ELEC 3.95% 12/47	5,170,000.00	3,657,826.70	
PACIFIC GAS & ELE 3.75% 8/15/42	855,000.00	605,938.50	
PAPA JOHNS IN 3.875% 09/15/29 144A	1,830,000.00	1,502,905.80	
PBF HLD LL 9.25% 05/15/25 144A	4,390,000.00	4,488,775.00	
PBF HLD LLC/FIN 6% 02/15/28	13,275,000.00	11,250,031.50	
PBF HLDG / FIN 7.25% 06/15/25	7,150,000.00	6,667,375.00	
PECF USS INTERM 8% 11/29 144A	1,765,000.00	1,470,986.30	
PENINSULA 8.5% 11/15/27 144A	6,365,000.00	6,874,200.00	
PERFORMANCE 5.5% 10/15/27 144A	13,405,000.00	12,600,700.00	
PERFORMANCE FO 4.25% 08/01/29 144A	2,925,000.00	2,493,211.50	
PG&E 4.55% 07/01/30	36,411,500.00	33,280,111.00	
PG&E 4.95% 07/01/50	40,141,500.00	32,583,256.96	
PG&E CORP 5% 07/01/28	7,060,000.00	6,425,306.00	
PG&E CORP 5.25% 07/01/30	19,645,000.00	17,533,162.50	
PIKE CORP 5.5% 9/01/28 144A	13,695,000.00	11,238,117.00	
POST HLDGS 5.625% 01/28 144A	13,375,000.00	12,752,795.00	
POST HLDGS IN 4.625% 4/30 144A	8,355,000.00	7,185,300.00	
QORVO INC 4.375% 10/15/29	3,915,000.00	3,550,435.20	
RACKSPACE INC 5.375% 12/01/28 144A	2,980,000.00	2,214,378.40	
RADIATE HOLDC 4.5% 9/15/26 144A	14,100,000.00	12,697,473.00	
RADIATE HOLDC 6.5% 9/15/28 144A	10,430,000.00	8,526,525.00	
RADIOLOGY PAR 0% 01/31/28 144A	11,765,000.00	9,470,825.00	

REAL HERO 6.25% 02/01/29 144A	1,595,000.00	1,140,313.35	
REALOGY GR 5.25% 04/15/30 144A	7,925,000.00	6,300,375.00	
REALOGY GROUP 5.75% 01/15/29 144A	2,725,000.00	2,234,500.00	
RIVIAN 6ML+600 10/15/26 144A	20,480,000.00	19,456,000.00	
ROBLOX CO 3.875% 05/01/30 144A	12,315,000.00	10,490,286.45	
ROLLER BEARING 4.375% 10/15/29 144A	1,440,000.00	1,243,800.00	
ROYAL CARI 11.5% 06/01/25 144A	2,795,000.00	3,018,600.00	
ROYAL CARI 5.375% 7/15/27 144A	4,325,000.00	3,592,474.75	
ROYAL CARIBBEAN 4.25% 07/01/26 144A	9,705,000.00	8,200,725.00	
ROYAL CARIBBEAN 5.5% 08/31/26	9,590,000.00	8,379,262.50	
RP ESCROW ISS 5.25% 12/15/25 144A	4,700,000.00	4,113,863.00	
RURAL/METRO C 10.125 7/19 144A	4,985,000.00	-	
SABRE GLBL 9.25% 04/15/25 144A	4,215,000.00	4,267,687.50	
SABRE GLBL INC 7.375% 09/01/25 144A	5,275,000.00	5,103,562.50	
SBA COMMUNICATI 3.875% 02/27	10,425,000.00	9,799,500.00	
SBP LLC/C 6.375% 09/30/26 144A	2,480,000.00	2,256,800.00	
SCIH SALT 4.875% 05/01/28 144A	5,850,000.00	5,133,316.50	
SCIH SALT 6.625% 05/01/29 144A	3,900,000.00	3,208,257.00	
SCOTTS MIRACLE 4% 04/01/31	3,370,000.00	2,729,700.00	
SCRIPPS ESC I 3.875% 01/15/29 144A	4,720,000.00	4,082,800.00	
SCRIPPS ESC II 5.375% 01/15/31 144A	2,450,000.00	2,088,625.00	
SCRIPPS ESCRO 5.875% 7/27 144A	5,375,000.00	4,971,875.00	
SEASPAN CORPORA 5.5% 08/01/29 144A	8,005,000.00	6,984,362.50	

SEASPAN CORPORA 6.5% 4/26 144A	4,600,000.00	4,515,820.00	
SEG HLD LLC 5.625% 10/15/28 144A	5,080,000.00	4,533,950.80	
SENSATA TECHNOL 4% 04/15/29 14	5,575,000.00	4,978,140.50	
SERVICE CO INTL 5.125% 6/1/29	3,060,000.00	2,952,900.00	
SIMMONS FOOD IN 4.625% 03/29 144A	3,345,000.00	2,862,684.45	
SIRIUS XM R 4.125% 7/1/30 144A	7,070,000.00	6,186,250.00	
SIRIUS XM RADIO 5% 8/1/27 144A	8,735,000.00	8,367,518.55	
SM ENERGY CO 6.5% 07/15/28	2,040,000.00	1,960,603.20	
SM ENERGY CO 6.625% 1/15/27	5,695,000.00	5,557,465.75	
SM ENERGY CO 6.75% 09/15/26	3,640,000.00	3,571,204.00	
SOTHEBYS 7.375% 10/15/27 144A	7,330,000.00	6,992,380.20	
SOUTHWESTERN EN 4.75% 02/01/32	4,720,000.00	4,310,776.00	
SOUTHWESTERN EN 5.375% 02/29	10,290,000.00	9,998,381.40	
SOUTHWESTERN EN 8.375% 9/15/28	5,280,000.00	5,735,400.00	
SP FINCO LLC 6.75% 7/1/25 144A	2,735,000.00	2,600,629.45	
SPA HOLDINGS 4.875% 2/28 144A	3,985,000.00	3,461,610.10	
SPIRIT LOYALT 8% 09/20/25 144A	3,763,895.00	3,933,872.49	
SPRINGLEAF CORP 4% 09/15/30	6,100,000.00	4,826,625.00	
SPRINGLEAF CORP 8.875% 06/1/25	7,255,000.00	7,586,553.50	
SPRINGLEAF FIN 6.875% 3/15/25	6,965,000.00	6,951,836.15	
SPRINGLEAF FIN CRP 7.125% 3/26	9,765,000.00	9,618,525.00	
SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32	44,955,000.00	56,496,297.15	
SQUARE INC 2.75% 06/01/26 144A	5,755,000.00	5,134,208.15	
SQUARE INC 3.5% 06/01/31 144A	5,755,000.00	4,710,985.45	

SRS DISTRIBUTIO 4.625% 07/01/28 144A	4,110,000.00	3,627,075.00	
SRS DISTRIBUTIO 6% 12/01/29 144A	3,575,000.00	2,886,812.50	
SRS DISTRIBUTIO 6.125% 07/01/29 144A	2,260,000.00	1,850,149.00	
STATION CAS LLC 4.625% 12/01/31 144A	7,800,000.00	6,318,000.00	
STERICYCL 3.875% 01/15/29 144A	3,440,000.00	2,981,860.80	
STUDIO CITY 6.5% 1/15/28 144A	10,530,000.00	6,844,500.00	
STUDIO CITY CO 7% 02/27 144A	5,135,000.00	4,518,800.00	
SUGARHOUSE 5.875% 5/15/25 144A	5,585,000.00	5,361,600.00	
SUNOCO LP /CORP 4.5% 05/15/29	4,765,000.00	4,144,406.40	
SUNOCO LP /CORP 6% 04/15/27	9,955,000.00	9,900,844.80	
SURGERY CTR 10% 04/15/27 144A	5,555,000.00	5,548,334.00	
SYMANTEC CORP 5% 04/25 144A	6,265,000.00	6,241,506.25	
SYNAPTICS INC 4% 06/15/29 144A	2,730,000.00	2,293,200.00	
TALLGRASS LP 6% 12/31/30 144A	5,145,000.00	4,489,012.50	
TARGA RES 6.5% 7/15/27	3,585,000.00	3,681,723.30	
TAYLOR MORRISON CMNTY/ MONARCH	7,155,000.00	6,824,081.25	
TEGNA INC 5% 09/15/29	13,405,000.00	12,734,750.00	
TEMPUR SEALY 4% 04/15/29 144A	5,280,000.00	4,428,705.60	
TENET HEALTH 4.25% 06/01/29 144A	14,290,000.00	12,624,643.40	
TENET HEALTH 4.375% 01/15/30 144A	14,020,000.00	12,314,186.60	
TENET HEALTH 6.125% 10/01/28 144A	22,670,000.00	20,742,823.30	
TENET HEALTH 6.875% 11/15/31	725,000.00	702,300.25	
TENET HEALTHCA 6.25% 2/27 144A	13,060,000.00	12,635,550.00	

TENET HEALTHCARE 6.75% 6/15/23	9,290,000.00	9,374,353.20	
TERRAFORM POWE 4.25% 1/23 144A	4,870,000.00	4,870,000.00	
TERRIER M 8.875% 12/15/27 144A	7,700,000.00	7,161,000.00	
THOR INDUSTRIES 4% 10/15/29 144A	6,650,000.00	5,411,770.00	
TKC HOLDIN 10.5% 05/15/29 144A	5,775,000.00	5,021,362.50	
TOPS MARKETS CORP ESCROW	20,640,000.00	-	
TRANSDIGM INC 4.625% 01/15/29	8,355,000.00	7,087,212.30	
TRANSDIGM INC 5.5% 11/15/27	27,775,000.00	24,789,187.50	
TRANSDIGM INC 7.5% 03/15/27	16,800,000.00	16,422,000.00	
TRANSOCEAN 5.375% 5/15/23 144A	5,455,622.25	5,266,203.04	
TREEHOUSE FOODS 4% 09/01/28	1,800,000.00	1,503,000.00	
TRI POINTE GROUP 5.7% 06/15/28	1,630,000.00	1,519,975.00	
TRITON WAT 6.25% 04/01/29 144A	2,425,000.00	1,818,750.00	
TRIVIUM PACKING 5.5% 8/26 144A	3,670,000.00	3,559,900.00	
TRONOX INC 4.625% 03/15/29 144A	5,040,000.00	4,407,278.40	
TTM TECH INC 4% 03/01/29 144A	5,085,000.00	4,397,152.05	
TULLOW OI 10.25% 05/15/26 144A	15,657,000.00	15,109,005.00	
TWILIO INC 3.625% 03/15/29	3,905,000.00	3,387,587.50	
TWILIO INC 3.875% 03/15/31	4,090,000.00	3,458,831.20	
TWITTER INC 5% 03/01/30 144A	38,105,000.00	37,152,375.00	
UBER TECH 7.5% 05/15/25 144A	10,860,000.00	11,022,900.00	
UBER TECH I 7.5% 09/15/27 144A	5,815,000.00	5,859,135.85	
UBER TECH INC 4.5% 08/15/29 144A	27,145,000.00	23,344,700.00	
UBER TECH INC 6.25% 01/15/28 144A	4,435,000.00	4,264,607.30	
UNISYS 6.875% 11/01/27 144A	2,905,000.00	2,672,338.55	

UNITED AIRLIN 4.625% 04/30/29 144A	6,645,000.00	6,014,389.50	
UNITED AIRLS 14-2 4.625% 9/22	6,732,306.96	6,748,329.85	
UNITED NATURA 6.75% 10/15/28 144A	3,695,000.00	3,505,631.25	
UNITI GRP/UNI 6% 01/15/30 144A	14,240,000.00	10,733,400.00	
UNITI/FIN 4.75% 04/15/28 144A	4,490,000.00	3,816,500.00	
UNITI/FIN/CSL 6.5% 02/15/29 144A	7,695,000.00	6,002,100.00	
UNIVISION 6.625% 06/01/27 144A	10,585,000.00	10,464,542.70	
US FOODS INC 4.625% 06/01/30 144A	2,370,000.00	2,061,900.00	
US FOODS INC 4.75% 02/15/29 144A	7,250,000.00	6,506,875.00	
USA COMPRESSIO 6.875% 04/01/26	2,960,000.00	2,826,208.00	
USIS MERGER 6.875% 05/25 144A	11,205,000.00	10,644,862.05	
VALARIS 12%/VAR 04/30/28 144A	1,233,000.00	1,226,835.00	
VALEANT PHARMA 9.25% 4/26 144A	4,505,000.00	3,568,861.00	
VALVOLINE INC 4.25% 2/30 144A	3,940,000.00	3,417,950.00	
VENTURE GLOBAL 3.875% 08/15/29 144	4,765,000.00	4,333,672.20	
VENTURE GLOBAL 4.125% 08/15/31 144A	4,765,000.00	4,283,115.55	
VERTIV GROUP 4.125% 11/15/28 144A	6,290,000.00	5,440,850.00	
VICI PPTY LP 4.625% 06/25 RGS	10,630,000.00	10,291,966.00	
VICI PPTY LP 5.75% 02/01/27 RE	6,005,000.00	5,910,721.50	
VICI PROPE 4.125% 8/15/30 144A	5,935,000.00	5,250,813.20	
VICI PROPERT 3.75% 02/27 144A	4,530,000.00	4,121,484.60	
VICTORIA'S 4.625% 07/29 144A	3,640,000.00	2,948,400.00	
VICTORS MERGER 6.375% 05/15/29 144A	7,820,000.00	5,055,004.40	

	VIKING CRUIS 13% 05/15/25 144A	4,665,000.00	5,003,212.50	
	VIPER ENER 5.375% 11/1/27 144A	2,590,000.00	2,551,745.70	
	VISTAJET MAL/XO 6.375% 02/01/30 144A	9,445,000.00	7,649,316.60	
	VISTRA OP CO 5.625% 02/27 144A	5,626,000.00	5,426,558.30	
	VZ SECURED FINA 5% 01/15/32 14	15,310,000.00	13,020,083.30	
	WALTER ENERGY 9.5% 10/19 144A	13,820,000.00	-	
	WASH MULT 5.75% 4/15/26 144A	3,610,000.00	3,506,032.00	
	WEEKLEY HOMES L 4.875% 09/15/28	2,460,000.00	2,081,160.00	
	WESTERN GLO 10.375% 8/25 144A	5,625,000.00	5,681,250.00	
	WINDSTREA 7.75% 08/15/28 144A	22,330,000.00	19,177,004.00	
	WINNEBAGO IND 6.25% 7/28 144A	4,355,000.00	4,202,575.00	
	WOLVERINE 8.5% 11/24 144A	3,807,000.00	2,017,710.00	
	WP ROCKET MRGR 10.125 7/19 144	6,530,000.00	-	
	WR GRACE 4.875% 06/15/27 144A	6,725,000.00	6,069,312.50	
	WR GRACE HLG 5.625% 08/29 144A	5,070,000.00	3,979,950.00	
	WYNN RESORTS LTD 7.75% 04/15/2	11,430,000.00	11,510,010.00	
	YUM BRANDS INC 4.625% 01/31/32	5,800,000.00	5,286,584.00	
	ZIGGO BOND 6% 1/15/27 144A	5,985,000.00	5,735,964.15	
	ZIGGO BOND CO 5.125% 02/28/30 144A	2,840,000.00	2,357,796.40	
	ZIGGO BV 4.875% 01/15/2030 144	4,150,000.00	3,621,622.00	
	アメリカ・ドル 小計	4,049,681,883.80	3,616,351,884.49 (462,097,443,800)	
社債券 合計			462,097,443,800 (462,097,443,800)	
合計			464,039,163,635 (464,039,163,635)	

（注）新株予約権証券における券面総額の数値は証券数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株 予約権証券 時価比率	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式	26銘柄	5.33%	-%	100%
	新株予約権証券	4銘柄	-%	0.40%	
	社債券	528銘柄	-%	94.28%	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

その他特定資産の明細表

特定資産の 種類 / 通貨	銘柄	数量	帳簿単価 帳簿金額	評価単価 評価金額	評価損益	備考
貸付債権 / アメリカ・ ドル	ACRISURE TERM B 1LN 02/15/27 C1	458,850.00	99.24 455,408.62	95.83 439,729.72	15,678.90	-
	AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C1	689,440.08	99.27 684,469.21	96.50 665,309.67	19,159.54	-
	AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C2	347,097.42	99.27 344,594.84	96.50 334,949.01	9,645.83	-
	AKZONOBEL TERM B 10/01/25 C1	648,460.05	99.23 643,479.87	95.42 618,793.00	24,686.87	-
	AKZONOBEL TERM B 10/01/25 C2	2,498,149.80	99.23 2,478,939.02	95.42 2,383,859.44	95,079.58	-
	ALLIANT INSURAN TRM B EXT 5/25 C1	357,270.37	99.02 353,772.69	95.48 341,128.89	12,643.80	-
	ALLIANT TERM B-2 1LN 05/10/25 C1	5,450,862.50	99.07 5,400,605.54	95.67 5,214,949.17	185,656.37	-
	ALTERRA MOUNT TM B-1 1LN 07/28 C1	278,450.74	99.92 278,236.33	96.83 269,632.20	8,604.13	-
	ANASTASIA BEV TERM B 08/25 C1	7,752,888.72	85.07 6,595,770.07	84.18 6,527,001.95	68,768.12	-
	ASCEND LEARNING TM 2LN 11/29 C1	650,000.00	99.75 648,375.00	95.87 623,187.50	25,187.50	-
	ATHENAHEALTH TM B 1LN 02/15/29 C1	6,036,811.59	99.49 6,006,627.53	94.81 5,723,682.17	282,945.36	-
	AUTHENTIC BR TM B 2LN 12/20/29 C1	370,000.00	99.25 367,225.00	96.00 355,200.00	12,025.00	-
	CITGO HOLDING TM B 1LN 8/1/23 C1	721,500.00	99.41 717,279.22	98.04 707,373.03	9,906.19	-
	CITGO TERM LOAN B 1LN 03/28/24 C1	12,609,657.04	100.09 12,621,257.92	98.50 12,420,512.18	200,745.74	-
	CONAIR TERM B 1LN 5/17/28 C1	1,049,725.00	100.06 1,050,375.82	92.12 967,059.15	83,316.67	-
	CONSOLIDATE TM INCR B 1LN 5/25 C1	12,728,812.50	97.49 12,410,337.61	96.25 12,251,482.03	158,855.58	-
	CSC SERVICEWORKS TM B 1LN 2/28 C1	3,410,550.00	100.27 3,419,792.59	95.32 3,251,106.78	168,685.81	-
	ECHO GLOBAL LOGIS TM 2LN 10/28 C1	1,915,000.00	99.50 1,905,425.00	99.50 1,905,425.00	-	-
	EPICOR SOFTWARE TL 2LN 07/28 C1	4,075,000.00	102.56 4,179,442.25	99.60 4,058,985.25	120,457.00	-
	EXAMWORKS TERM B 1LN 11/01/28 C1	600,000.00	99.50 597,000.00	96.07 576,426.00	20,574.00	-
FRST EAGLE TERM B 1LN 2/1/27 C1	2,474,538.69	98.74 2,443,557.46	95.62 2,366,277.62	77,279.84	-	
GREAT OUTDOOR TM B1 1LN 3/5/28 C1	6,217,080.68	100.17 6,227,836.22	95.58 5,942,472.22	285,364.00	-	

HUNTER DOUGLAS TERM B 1LN 2/29 C1	2,505,142.86	99.50 2,492,617.15	91.46 2,291,429.12	201,188.03	-
HUNTER DOUGLAS TERM B 1LN 2/29 C2	919,857.14	99.49 915,257.85	91.46 841,384.12	73,873.73	-
INTERNET TM 1LN 09/15/2024 C1	1,054,632.92	99.74 1,051,985.79	96.00 1,012,447.60	39,538.19	-
KINDER CARE TERM 2LN 08/22/2025 C1	13,635,000.00	100.16 13,657,770.45	98.75 13,464,562.50	193,207.95	-
MISYS LIMITED TERM 2LN 06/25 C1	3,431,000.00	99.82 3,424,995.75	87.22 2,992,826.99	432,168.76	-
NUMERICABLE TERM B-12 01/01/26 C1	15,553,848.72	99.39 15,459,592.39	93.50 14,542,848.55	916,743.84	-
PAREXEL TERM B 1LN 08/11/28 C1	2,425,000.00	100.01 2,425,315.25	96.41 2,337,966.75	87,348.50	-
PELTON INTERACTIV TM 1LN 5/29	40,000.00	95.50 38,200.00	97.29 38,916.80	716.80	-
SANCHEZ DIP ROLL UP TL 5/11/20 C1	1,489,000.00	- -	- -	-	-
SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C1	1,814,338.93	- -	- -	-	-
SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C2	1,638,087.99	- -	- -	-	-
SCIENTIFIC GAME TM B 1LN 02/29 C1	1,005,000.00	99.75 1,002,487.50	96.26 967,473.30	35,014.20	-
SINCLAIR BROAD TM 1LN 05/26 C1	940,722.39	92.99 874,871.82	100.37 944,250.09	69,378.27	-
SOFTBANK SVF II TERM 1LN 12/24 C1	23,475,846.03	100.00 23,475,846.03	100.00 23,475,846.03	-	-
THE GOLUB CORPOR TM 2LN 05/26 C1	9,516,600.33	100.01 9,517,985.97	100.00 9,516,600.33	1,385.64	-
TRAVELPORT TERM 1LN 05/29/2026 C1	3,383,177.98	87.27 2,952,600.76	77.58 2,624,770.97	327,829.79	-
UKG TERM 1LN 5/3/26 C1	8,403,937.50	100.00 8,403,937.50	95.55 8,029,962.28	373,975.22	-
UKG TERM 2LN 05/03/2027 C1	1,260,000.00	100.00 1,260,000.00	96.43 1,215,118.80	44,881.20	-
ULTIMATE SOFTWARE TERM 1LN 5/26 C1	1,911,000.00	99.91 1,909,280.10	96.62 1,846,503.75	62,776.35	-
USI TERM B INCR 05/16/24	2,435,250.00	99.23 2,416,547.28	97.09 2,364,481.63	52,065.65	-
VEEAM SOFTWARE TERM B 1LN 2/27 C1	1,087,800.00	99.62 1,083,698.99	96.62 1,051,086.75	32,612.24	-
貸付債権 / アメリカ・ドル 小計		162,192,798.39 (20,724,995,778)	157,503,018.34 (20,125,735,683)	4,689,780.05 (599,260,095)	
貸付債権 合計		20,724,995,778 (20,724,995,778)	20,125,735,683 (20,125,735,683)	599,260,095 (599,260,095)	

合 計		20,724,995,778 (20,724,995,778)	20,125,735,683 (20,125,735,683)	599,260,095 (599,260,095)	
-----	--	------------------------------------	------------------------------------	-------------------------------	--

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(2022年6月30日現在)

種 類	金 額	単 位
資産総額	477,737,552,194	円
負債総額	688,259,852	円
純資産総額(-)	477,049,292,342	円
発行済数量	1,531,393,790,643	口
1単位当たり純資産額(/)	0.3115	円

(参考)マザーファンドの純資産額計算書

フィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンド

(2022年6月30日現在)

種 類	金 額	単 位
資産総額	541,585,465,613	円
負債総額	559,378,451	円
純資産総額(-)	541,026,087,162	円
発行済数量	122,880,034,273	口
1単位当たり純資産額(/)	4.4029	円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

(1) 資本金等（2021年12月末日現在）

（略）

<訂正後>

(1) 資本金等（2022年6月末日現在）

（略）

2【事業の内容及び営業の概況】

< 訂正前 >

（略）

2021年12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172本、親投資信託43本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額4,160,271,603,587円です。

< 訂正後 >

（略）

2022年6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171本、単位型株式投資信託2本、親投資信託43本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額4,026,898,107,084円です。

3【委託会社等の経理状況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

当社の財務諸表は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度(2021年4月1日から2021年12月31日まで)の財務諸表について、PwC あらた有限責任監査法人により監査を受けております。

財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

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

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

	第35期 (2021年3月31日)	第36期 (2021年12月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	3,247,762	2,332,260
立替金	55,896	10,825
前払費用	33,253	391,344
未収委託者報酬	6,757,847	5,945,170
未収運用受託報酬	9,468,144	1,090,786
未収収益	7,227	7,554
未収入金	*1 197,099	230,819
流動資産計	19,767,230	10,008,763
固定資産		
無形固定資産		
電話加入権	7,487	7,487
無形固定資産合計	7,487	7,487
投資その他の資産		
長期貸付金	*1 4,012,754	3,719,377
長期差入保証金	13,505	13,505
繰延税金資産	378,891	218,947
その他	230	230
投資その他の資産合計	4,405,381	3,952,060
固定資産計	4,412,868	3,959,547
資産合計	24,180,098	13,968,310
負債の部		
流動負債		
預り金	7	325
未払金	*1	
未払手数料	2,988,518	2,709,755
その他未払金	6,727,569	2,414,060
未払費用	349,227	288,865
未払法人税等	483,198	15,600
未払消費税等	1,276,957	633,070
賞与引当金	1,074,712	1,037,307
その他流動負債	355	355
流動負債合計	12,900,547	7,099,341
固定負債		
長期賞与引当金	210,912	389,323
退職給付引当金	1,942,812	1,998,303
固定負債合計	2,153,725	2,387,627
負債合計	15,054,272	9,486,968
純資産の部		
株主資本		
資本金	1,000,000	1,000,000
利益剰余金		
利益準備金	250,000	250,000
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	7,875,826	3,231,341
利益剰余金合計	8,125,826	3,481,341
株主資本合計	9,125,826	4,481,341
純資産合計	9,125,826	4,481,341
負債・純資産合計	24,180,098	13,968,310

（２）【損益計算書】

(単位：千円)

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

(3)【株主資本等変動計算書】

第35期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本				株主資本合計	純資産合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金			
			その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	1,000,000	250,000	2,203,463	2,453,463	3,453,463	3,453,463
当期変動額						
当期純利益	-	-	5,672,362	5,672,362	5,672,362	5,672,362
当期変動額合計	-	-	5,672,362	5,672,362	5,672,362	5,672,362
当期末残高	1,000,000	250,000	7,875,826	8,125,826	9,125,826	9,125,826

第36期(自2021年4月1日至2021年12月31日)

(単位:千円)

	株主資本				株主資本合計	純資産合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金			
			その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	1,000,000	250,000	7,875,826	8,125,826	9,125,826	9,125,826
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	(7,800,000)	(7,800,000)	(7,800,000)	(7,800,000)
当期純利益	-	-	3,155,515	3,155,515	3,155,515	3,155,515
当期変動額合計	-	-	(4,644,485)	(4,644,485)	(4,644,485)	(4,644,485)
当期末残高	1,000,000	250,000	3,231,341	3,481,341	4,481,341	4,481,341

注記事項

(重要な会計方針)

1. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金、長期賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

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

2. 収益及び費用の計上基準

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

これらには実績報酬が含まれる場合があります。

(1) 運用報酬

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

(2) 実績報酬

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

3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

(2) グループ通算制度への移行に係る税効果会計

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

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

(重要な会計上の見積り)

第35期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

第36期(自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)

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

(会計方針の変更)

1. 収益認識会計基準の適用

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日)等を当事業年度の期首から適用し、約束した又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。なお、当該変更による影響額は軽微であります。

(表示方法の変更)

1. 時価算定会計基準の適用

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

(追加情報)

決算期の変更

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

(貸借対照表関係)

*1 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。

	第35期 (2021年3月31日)	第36期 (2021年12月31日)
未収入金	1,646 千円	1,846 千円
その他未払金	6,519,813 千円	2,192,392 千円
長期貸付金	3,680,000 千円	3,345,000 千円

(損益計算書関係)

*1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	第35期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第36期 (自 2021年4月1日至 2021年12月31日)
営業費用	12,554,987 千円	8,358,672 千円
受取利息	4,830 千円	11,307 千円

(株主資本等変動計算書関係)

第35期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

金銭による配当

該当事項はありません。

金銭以外による配当

該当事項はありません。

第36期 (自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

金銭による配当

該当事項はありません。

金銭以外による配当

2021年12月13日の取締役会において、次のとおり決議しております。

- | | |
|---------------|--------------|
| (1) 配当財産の種類 | 長期貸付金 |
| (2) 配当財産の帳簿価格 | 7,800,000 千円 |
| (3) 1株当たりの配当額 | 390 千円 |
| (4) 基準日 | 2021年12月13日 |
| (5) 効力発生日 | 2021年12月13日 |

（金融商品関係）**1. 金融商品の状況に関する事項****（1）金融商品に対する取組方針**

当社は、資金運用について短期的な預金及びグループ会社への貸付金に限定しております。

また、所要資金は自己資金で賄っており、銀行借入、社債発行等による資金調達は行っておりません。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は、原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。

また、外貨建ての債権債務に関する為替の変動リスクに関しては、個別の案件ごとに毎月残高照合等を行い、リスクを管理しております。

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31日（前期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません。

第35期（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	3,247,762	3,247,762	-
(2) 未収委託者報酬	6,757,847	6,757,847	-
(3) 未収運用受託報酬	9,468,144	9,468,144	-
(4) 未収収益	7,227	7,227	-
(5) 未収入金	197,099	197,099	-
(6) 長期貸付金	4,012,754	4,012,754	-
資産計	23,690,833	23,690,833	-
(1) 未払手数料	2,988,518	2,988,518	-
(2) その他未払金	6,727,569	6,727,569	-
(3) 未払費用	349,227	349,227	-
(4) 未払法人税等	483,198	483,198	-
(5) 未払消費税等	1,276,957	1,276,957	-
負債計	11,825,469	11,825,469	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

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

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

(6) 長期貸付金

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

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、(3) 未払費用、(4) 未払法人税等、(5) 未払消費税等

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

2021年12月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第36期（2021年12月31日）

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

(注2) 資産

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収収益、未収入金

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

負債

未払手数料、その他未払金、未払費用、未払法人税等、未払消費税等

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期（2021年3月31日）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金及び預金	3,247,762	-	-	-
未収委託者報酬	6,757,847	-	-	-
未収運用受託報酬	9,468,144	-	-	-
未収収益	7,227	-	-	-
未収入金	197,099	-	-	-
合計	19,678,080	-	-	-

金銭債権のうち長期貸付金(4,012,754千円)については、契約上返済期限の定めがないため、上記に含めておりません。

第36期（2021年12月31日）

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

(1)時価で貸借対照表に計上している金融商品

該当事項はありません。

(2)時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

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

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1)長期貸付金

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

(退職給付関係)

第35期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は確定給付型年金制度及び確定拠出型年金制度を採用しております。

2. 確定給付型年金制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(千円)
退職給付債務の期首残高	1,900,779
勤務費用	171,251
利息費用	10,280
数理計算上の差異の発生額	29,517
退職給付の支払額	114,101
退職給付債務の期末残高	1,938,692

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

	(千円)
非積立型制度の退職給付債務	1,938,692
未認識過去勤務費用	4,120
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,942,812
退職給付引当金	1,942,812
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,942,812

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	153,392
利息費用	9,208
数理計算上の差異の費用処理額	29,517
過去勤務債務の費用処理額	1,874
確定給付型年金制度に係る退職給付費用	131,209

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は93,260千円であります。

第36期（自 2021年4月1日 至 2021年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は確定給付型年金制度及び確定拠出型年金制度を採用しております。

2. 確定給付型年金制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(千円)
退職給付債務の期首残高	1,938,692
勤務費用	132,302
利息費用	10,621
数理計算上の差異の発生額	1,689
退職給付の支払額	87,714
退職給付債務の期末残高	1,995,588

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.6%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は68,889千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

(資産除去債務関係)

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

(収益認識関係)

第36期(自2021年4月1日至2021年12月31日)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

(単位:千円)

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

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

顧客との契約から生じた債権等

(単位:千円)

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

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

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

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第35期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. サービスごとの情報

(単位:千円)

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

3. 主要な顧客ごとの情報

(1) 委託者報酬

(単位:千円)

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

(2) 運用受託報酬

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

第36期（自 2021年4月1日 至 2021年12月31日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位:千円)

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

(関連当事者情報)

第35期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1)財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称	会社等の所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
親会社	FIL Limited	英領バミューダ、ペンブローク市	千米ドル 6,981	投資顧問業	被所有間接100%	投資顧問契約の再委任等役員の兼任	共通発生経費負担額（注3）	千円 9,231,998	未払金	千円 4,108,489
親会社	フィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社	東京都港区	千円 4,510,000	グループ会社経営管理	被所有直接100%	当社事業活動の管理等役員兼任	金銭の貸付（注1） 利息の受取（注1） 共通発生経費負担額（注3） 連結法人税の個別帰属額	千円 1,800,000 4,830 365,300 -	長期貸付金 未収入金 未払金 未払金	千円 3,680,000 1,646 77,826 2,090,219
親会社	FIL Asia Holdings Pte Limited	シンガポール、ブルバード市	千米ドル 189,735	グループ会社経営管理	被所有間接100%	営業取引	共通発生経費負担額（注3）	千円 2,957,688	未払金	千円 243,277

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

属性	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
同一の親会社をもつ会社	フィデリティ証券株式会社	東京都港区	千円 10,857,500	証券業	なし	当社設定投資信託の募集・販売	共通発生経費負担額（注3） 投資信託販売に係る代行手数料（注4）	千円 496,200 754,160	未収入金 未払金	千円 31,831 148,905
同一の親会社をもつ会社	FIL Investment Management (Hong Kong) Limited	香港、セントラル市	千米ドル 22,897	証券投資顧問業	なし	当社事業活動へのサービスの提供	共通発生経費負担額（注3）	千円 408,673	未払金	千円 17,954

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 共通発生経費については、直課可能なものは実際発生額に基づき、直課不可能なものは各社の規模に応じた一定の比率により負担しております。

(注4) 代行手数料については、一般取引条件を基に、両社協議の上合理的に決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

第36期 (自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称	会社等の所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
親会社	FIL Limited	英領バミューダ、ペンブローク市	千米ドル 6,825	投資顧問業	被所有間接100%	投資顧問契約の再委任等役員の兼任	委託調査等報酬(注3) 共通発生経費負担額(注4)	千円 - 5,640,534	未収入金 未払金	千円 620 686,919
親会社	フィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社	東京都港区	千円 4,510,000	グループ会社経営管理	被所有直接100%	当社事業活動の管理等役員の兼任	貸付金の回収(注1) 利息の受取(注1) 共通発生経費負担額(注4) 連結法人税の個別帰属額 剰余金の配当	千円 335,000 11,307 234,202 - 7,800,000	長期貸付金 未収入金 未払金 未払金 未払金	千円 3,345,000 1,226 50,325 1,098,134 -
親会社	FIL Asia Holdings Pte Limited	シンガポール、ブルバード市	千米ドル 189,735	グループ会社経営管理	被所有間接100%	営業取引	共通発生経費負担額(注4)	千円 2,483,934	未払金	千円 357,012

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

属性	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
同一の親会社をもつ会社	フィデリティ証券株式会社	東京都港区	10,857,500	証券業	なし	当社設定投資信託の募集・販売	共通発生経費負担額（注4）	452,000	未収入金	56,159
							投資信託販売に係る代行手数料（注5）	656,658	未払金	88,138

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

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

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

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

項目	第35期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第36期 (自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)
当期純利益(千円)	5,672,362	3,155,515
普通株式に係る当期純利益(千円)	5,672,362	3,155,515
期中平均株式数	20,000株	20,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

原届出書「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況 1 名称、資本金の額及び事業の内容」につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

ファンドの運営における役割	名称	資本金の額 (2022年3月末日現在)	事業の内容
受託会社	三菱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。
<参考情報> 再信託受託会社	日本マスタートラスト信託銀行株式会社	10,000百万円	
販売会社	PWM日本証券株式会社	3,000百万円	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。
	auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
	野村証券株式会社	10,000百万円	
	フィデリティ証券株式会社	11,757百万円	
	SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	
	マネックス証券株式会社	12,200百万円	
	ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
	楽天証券株式会社	17,495百万円	
	岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	
	三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
	西日本シティTT証券株式会社	3,000百万円	
	株式会社SBI証券	48,323百万円	
	あかつき証券株式会社	3,067百万円	
	岡三証券株式会社	5,000百万円	
リテラ・クリア証券株式会社	3,794百万円		

大和証券株式会社	100,000百万円	
八十二証券株式会社	3,000百万円	
池田泉州ＴＴ証券株式会社	1,250百万円	
アイザワ証券株式会社	3,000百万円	
中銀証券株式会社	2,000百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
百五証券株式会社	3,000百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
香川証券株式会社	555百万円	
日産証券株式会社	1,500百万円	
とうほう証券株式会社	3,000百万円	
ぐんぎん証券株式会社	3,000百万円	
ほくほくＴＴ証券株式会社	1,250百万円	
七十七証券株式会社	3,000百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
株式会社証券ジャパン	3,000百万円	
十六ＴＴ証券株式会社	3,000百万円	
ＯＫＢ証券株式会社	1,500百万円	
きらぼしライフデザイン証券株式会社	3,000百万円	
岡三にいがた証券株式会社	852百万円	
東洋証券株式会社	13,494百万円	
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。
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	
株式会社ＳＭＢＣ信託銀行	87,550百万円	

株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社七十七銀行	24,658百万円	
株式会社十六銀行	36,839百万円	
株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958百万円	
株式会社三井住友銀行	1,770,900百万円	
株式会社静岡銀行	90,845百万円	
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社もみじ銀行	10,000百万円	
ソニー銀行株式会社	38,500百万円	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	
ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング・コーポレーション・リミテッド （香港上海銀行）	1,161億247万9,495 香港ドル 71億9,800万米ドル	
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
株式会社滋賀銀行	33,000百万円	
株式会社京葉銀行	49,759百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	
株式会社長崎銀行	7,621百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社第四北越銀行	32,776百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	
株式会社常陽銀行	85,113百万円	
株式会社福岡銀行	82,329百万円	
株式会社きらぼし銀行	43,700百万円	
株式会社十八親和銀行	36,878百万円	
株式会社熊本銀行	10,000百万円	
株式会社豊和銀行	12,495百万円	
株式会社京都銀行	42,103百万円	

	株式会社イオン銀行	51,250百万円	
	株式会社大光銀行	10,000百万円	
	株式会社東邦銀行	23,519百万円	
	株式会社北陸銀行	140,409百万円	
	株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
	株式会社伊予銀行	20,948百万円	
	PayPay銀行株式会社	37,250百万円	
	株式会社神奈川銀行	6,191百万円	
	株式会社山口銀行	10,005百万円	
	株式会社北九州銀行	10,000百万円	
	株式会社三十三銀行	37,400百万円	
	ソニー生命保険株式会社	70,000百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
運用の委託先	FIAM LLC	123,235,903米ドル (約14,174百万円 [*]) [*] 1米ドル115.02円で換算 (2021年12月末日現在)	主として米国においてファンドに対する投資顧問業務を営んでいます。

新規募集は行ないません。

独立監査人の監査報告書

2022年8月17日

フィデリティ投信株式会社

取締役会 御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているフィデリティ・US ハイ・イールド・ファンドの2021年11月23日から2022年5月23日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ・US ハイ・イールド・ファンドの2022年5月23日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2022年3月10日

フィデリティ投信株式会社
取締役会 御中

PWCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているフィデリティ投信株式会社の2021年4月1日から2021年12月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ投信株式会社の2021年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。