

【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】 | 平成30年8月2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 チャック・マッケンジー |
| 【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(資産成長型) (為替ヘッジあり) |
| 【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、平成29年11月6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。

第一部【証券情報】

（３）【発行（売出）価額の総額】

< 訂正前 >

当初申込期間：10億円を上限とします。

継続申込期間：6兆円を上限とします。

< 訂正後 >

6兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

< 訂正前 >

当初申込期間：受益権 1 口当たり 1 円とします。

継続申込期間：取得申込受付日の翌営業日の基準価額¹とします。

（略）

< 訂正後 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額¹とします。

（略）

（５）【申込手数料】

< 訂正前 >

ファンドの申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額（当初申込期間中は 1 口当たり 1 円）に3.24%^{*}（税抜 3.00%）を上限として販売会社が別途定める手数料率を乗じて得た額とします。

（略）

< 訂正後 >

ファンドの申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.24%^{*}（税抜 3.00%）を上限として販売会社が別途定める手数料率を乗じて得た額とします。

（略）

（７）【申込期間】

< 訂正前 >

当初申込期間：2017年11月22日

継続申込期間：2017年11月24日から2018年 8 月17日まで

（略）

< 訂正後 >

継続申込期間：2017年11月24日から2018年 8 月17日まで

（略）

（９）【払込期日】

< 訂正前 >

< 当初申込期間 >

取得申込者は、当初申込期間中に申込代金^{*}を販売会社が定める期日までにお支払いいただくものとします。当初申込期間を通じた発行価額の総額は、ファンドの当初設定日（2017年11月24

日)に、販売会社から、委託会社の指定する口座を經由して、ファンドの受託会社である三菱UFJ信託銀行株式会社(以下「受託会社」といいます。)の指定するファンド口座に払込まれます。

<継続申込期間>

取得申込者は、申込代金^{*}を販売会社が定める期日までにお支払いいただくものとします。ファンドの振替受益権に係る各取得申込受付日における発行価額の総額は、当該取得申込みに係る追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払込まれます。

* 「申込代金」とは、お申込み金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額(当初申込期間中は1口当たり1円)×お申込み口数)に申込手数料および当該申込手数料に係る消費税等相当額を加算した取得申込者の支払金総額をいいます。以下同じ。

<訂正後>

取得申込者は、申込代金^{*}を販売会社が定める期日までにお支払いいただくものとします。ファンドの振替受益権に係る各取得申込受付日における発行価額の総額は、当該取得申込みに係る追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払込まれます。

* 「申込代金」とは、お申込み金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×お申込み口数)に申込手数料および当該申込手数料に係る消費税等相当額を加算した取得申込者の支払金総額をいいます。以下同じ。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

（略）

ファンドの基本的性格

（略）

（参考）ファンドの仕組み



ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建て高利回り事業債(ハイ・イールド・ボンド)等へ実質的に投資を行なう、「ファミリーファンド方式」です。

（略）

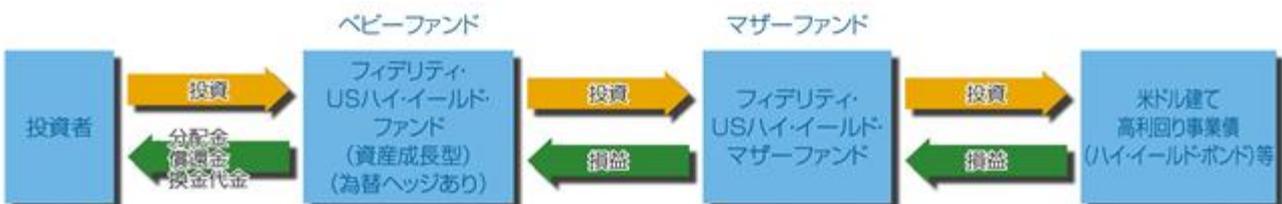
<訂正後>

（略）

ファンドの基本的性格

（略）

（参考）ファンドの仕組み



ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建て高利回り事業債(ハイ・イールド・ボンド)等へ実質的に投資を行なう、「ファミリーファンド方式」です。

（略）

（2）【ファンドの沿革】

<訂正前>

| | |
|-------------|---------------------------------|
| 2017年11月22日 | ファンドの募集開始 |
| 2017年11月24日 | 信託契約の締結、ファンドの当初設定、ファンドの運用開始（予定） |

<訂正後>

| | |
|-------------|-----------------------------|
| 2017年11月22日 | ファンドの募集開始 |
| 2017年11月24日 | 信託契約の締結、ファンドの当初設定、ファンドの運用開始 |

（ 3 ） 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

（ 略 ）

委託会社の概況（2017年9月末日現在）

（ 略 ）

< 訂正後 >

（ 略 ）

委託会社の概況（2018年6月末日現在）

（ 略 ）

3【投資リスク】

< 訂正前 >

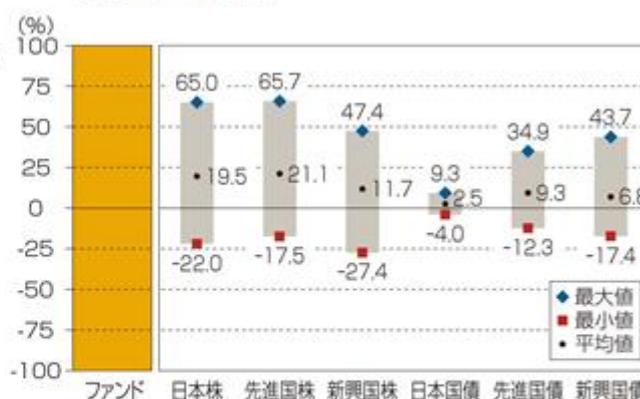
(略)

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及び分配金再投資基準価額の推移

※ファンドの運用は、2017年11月24日から開始する為、届出日現在該当事項はありません。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※ファンドの運用は、2017年11月24日から開始する為、届出日現在該当事項はありません。他の代表的な資産クラスについては2012年10月～2017年9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・平均値を表示しております。当グラフは、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。

[代表的な資産クラスの指数]

| | | |
|------|--|--|
| 日本株 | TOPIX(配当金込) | TOPIX(配当金込)とは株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます。)が算出・公表する株価指数です。東証の知的財産であり、TOPIX等の算出、数値の公表、利用などTOPIX等に関する権利は東証が所有しています。 |
| 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算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 | シティ世界国債インデックス(除く日本/円ベース) | シティ世界国債インデックス(除く日本/円ベース)とは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。 |
| 新興国債 | JPモルガンGBI-EMグローバルダイバーシファイド(円ベース) | JPモルガンGBI-EMグローバルダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。当指数の著作権はジェーピーモルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属しております。 |

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、指数提供元に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及び分配金再投資基準価額の推移



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドが設定から1年を経過していないため、表示できません。

※「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。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※ファンドは設定から1年を経過していないため、ファンドの年間騰落率を表示できません。他の代表的な資産クラスについては2013年7月～2018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・平均値を表示しております。当グラフは、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。

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

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

<訂正前>

ファンドの申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額（当初申込期間中は1口当たり1円）に3.24%^{*}（税抜 3.00%）を上限として販売会社が別途定める手数料率を乗じて得た額とします。

（略）

<訂正後>

ファンドの申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.24%^{*}（税抜 3.00%）を上限として販売会社が別途定める手数料率を乗じて得た額とします。

（略）

（４）【その他の手数料等】

<訂正前>

（略）

その他、以下の諸費用

（略）

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

（略）

<訂正後>

（略）

その他、以下の諸費用

（略）

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

（略）

（５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、2017年9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、2018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】

(2018年6月29日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|------------------|----|-------------|-------------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 21,192,067 | 100.30 |
| 預金・その他の資産（負債控除後） | - | 62,882 | 0.30 |
| 合計（純資産総額） | | 21,129,185 | 100.00 |

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

その他資産の投資状況

(2018年6月29日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|------------|----|-------------|-------------|
| 為替予約取引（売建） | 日本 | 21,173,760 | 100.21 |

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

(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

(2018年6月29日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------|---------|-----------------|-------------|
| 株式 | アメリカ | 24,489,803,092 | 2.98 |
| | オランダ | 4,385,113,510 | 0.53 |
| | アイルランド | 2,705,889,590 | 0.33 |
| | ケイマン諸島 | 1,710,385,862 | 0.21 |
| | ジャージー | 1,578,413,834 | 0.19 |
| | バミューダ | 123,130,506 | 0.02 |
| | 小計 | 34,992,736,394 | 4.26 |
| 新株予約権証券 | アメリカ | 323,543,875 | 0.04 |
| | 小計 | 323,543,875 | 0.04 |
| 社債券 | アメリカ | 546,747,806,431 | 66.61 |
| | カナダ | 39,871,530,881 | 4.86 |
| | ルクセンブルグ | 34,733,573,146 | 4.23 |
| | オランダ | 25,022,846,510 | 3.05 |
| | イギリス | 20,257,853,458 | 2.47 |

| | | | |
|------------------|-----------------|-----------------|--------|
| | マーシャル諸島 | 8,698,205,511 | 1.06 |
| | ケイマン諸島 | 7,238,457,592 | 0.88 |
| | フランス | 6,972,041,750 | 0.85 |
| | アイルランド | 6,669,180,803 | 0.81 |
| | 日本 | 3,307,243,557 | 0.40 |
| | イギリス領バー ジン諸島 | 2,565,773,626 | 0.31 |
| | オーストラリア | 1,625,022,149 | 0.20 |
| | ブラジル | 1,459,592,268 | 0.18 |
| | イタリア | 1,417,722,756 | 0.17 |
| | フィンランド | 1,291,014,479 | 0.16 |
| | バミューダ | 1,240,783,412 | 0.15 |
| | オーストリア | 693,909,986 | 0.08 |
| | ドイツ | 682,145,104 | 0.08 |
| | バハマ | 443,714,192 | 0.05 |
| | 小計 | 710,938,417,611 | 86.62 |
| 投資証券 | アメリカ | 645,424,599 | 0.08 |
| | 小計 | 645,424,599 | 0.08 |
| 預金・その他の資産(負債控除後) | - | 73,862,023,116 | 9.00 |
| 合計(純資産総額) | | 820,762,145,595 | 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

(2018年6月29日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|------------|------|----------------|-------------|
| 為替予約取引(買建) | 日本 | 18,785,583 | 0.00 |
| 為替予約取引(売建) | 日本 | 1,187,251,727 | 0.14 |
| 貸付債権 | アメリカ | 37,217,317,868 | 4.53 |

(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】

(2018年6月29日現在)

| 順位 | 種類 | 銘柄名 | 国名 | 数量 (口数) | 帳簿価 額単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|-------------------|--|----|------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1 | 親投資 信託受 益証券 | フィデリ ティ・USハ イ・イール ド・マザー ファンド | 日本 | 6,855,390 | 3.0956 | 21,221,585 | 3.0913 | 21,192,067 | 100.30 |

種類別投資比率

(2018年6月29日現在)

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 100.30 |

(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・USハイ・イールド・マザーファンド

(2018年6月29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 | ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31 | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 91,910,000 | 13,209.53 12,140,879,023 | 13,126.62 12,064,681,037 | 8.000 2031/11/01 | 1.47 |
| 2 | CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144 | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 102,045,000 | 10,211.13 10,419,950,159 | 10,321.67 10,532,750,702 | 5.125 2027/05/01 | 1.28 |
| 3 | VRX ESCROW 5.875% 5/23 144A | アメリカ・ドル カナダ | 社債券 - | 98,485,000 | 10,515.11 10,355,813,469 | 10,307.86 10,151,690,996 | 5.875 2023/05/15 | 1.24 |
| 4 | ALTICE SA 7.75% 05/15/22 144A | アメリカ・ドル ルクセンブルグ | 社債券 - | 92,680,000 | 10,625.65 9,847,859,371 | 10,611.84 9,835,053,312 | 7.750 2022/05/15 | 1.20 |
| 5 | APX GRP INC 8.75% 12/1/20 WI | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 91,440,000 | 10,273.25 9,393,865,268 | 10,556.57 9,652,927,608 | 8.750 2020/12/01 | 1.18 |
| 6 | SPRINT CAP GLBL 6.9% 5/01/19 | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 80,666,000 | 11,357.98 9,162,032,180 | 11,275.08 9,095,156,032 | 6.900 2019/05/01 | 1.11 |
| 7 | CITIGROUP 5.35% PERP | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 83,055,000 | 10,954.62 9,098,363,411 | 10,929.64 9,077,614,578 | 5.350 2049/12/31 | 1.11 |
| 8 | CHS/CMNTY HEALTH 6.25% 3/31/23 | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 83,300,000 | 10,335.49 8,609,463,170 | 10,114.41 8,425,303,530 | 6.250 2023/03/31 | 1.03 |
| 9 | CHESAPEAKE ENERGY 8% 06/15/27 | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 73,300,000 | 11,136.90 8,163,351,365 | 11,192.18 8,203,864,275 | 8.000 2027/06/15 | 1.00 |
| 10 | TENET HEALTHCARE 6.75% 6/15/23 | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 71,860,000 | 11,026.36 7,923,545,889 | 10,971.10 7,883,828,867 | 6.750 2023/06/15 | 0.96 |
| 11 | ZIGGO SEC 5.5% 1/15/27 144A | アメリカ・ドル オランダ | 社債券 - | 72,070,000 | 10,515.11 7,578,245,182 | 10,332.17 7,446,397,657 | 5.500 2027/01/15 | 0.91 |

| | | | | | | | | |
|----|---|--------------------|----------|------------|----------------------------|----------------------------|----------------------|------|
| 12 | NRG ENERGY INC 5.75% 1/28 144A | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 62,345,000 | 10,819.10 6,745,169,453 | 10,957.28 6,831,314,657 | 5.750 2028/01/15 | 0.83 |
| 13 | CALIF RES 8.0% 12/15/22 144A | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 64,660,000 | 10,142.04 6,557,846,297 | 10,031.50 6,486,371,133 | 8.000 2022/12/15 | 0.79 |
| 14 | MOMENTIVE PRF MATL 3.88% 10/21 | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 54,529,000 | 11,717.24 6,389,293,799 | 11,606.70 6,329,017,443 | 3.880 2021/10/24 | 0.77 |
| 15 | INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A | アメリカ・ドル オランダ | 社債券 - | 56,712,000 | 10,998.73 6,237,599,757 | 10,888.19 6,174,910,312 | 7.000 2023/06/30 | 0.75 |
| 16 | JPMORGAN CHASE 5.15% PERP | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 54,895,000 | 10,954.51 6,013,480,460 | 10,860.56 5,961,901,667 | 5.150 2049/12/31 | 0.73 |
| 17 | BALBOA MRGR 11.375% 12/21 144A | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 47,175,000 | 12,035.04 5,677,531,299 | 11,965.96 5,644,939,271 | 11.375 2021/12/01 | 0.69 |
| 18 | DYNEGY INC 7.625% 11//24 W/I | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 46,075,000 | 11,883.05 5,475,115,287 | 11,800.14 5,436,916,808 | 7.625 2024/11/01 | 0.66 |
| 19 | TPC GROUP 8.75% 12/15/20 144A | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 47,910,000 | 10,998.73 5,269,491,543 | 11,018.63 5,279,024,291 | 8.750 2020/12/15 | 0.64 |
| 20 | TENET HEALTHCAR 8.125% 4/22 WI | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 45,510,000 | 11,634.33 5,294,785,858 | 11,482.34 5,225,614,071 | 8.125 2022/04/01 | 0.64 |
| 21 | NEW COTAI 10.625%PIK 5/19 144A | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 43,812,568 | 10,895.04 4,773,398,330 | 10,888.19 4,770,395,646 | 10.625 2019/05/01 | 0.58 |
| 22 | SPRINT CORP 7.875% 9/15/23 | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 40,680,000 | 11,620.51 4,727,226,519 | 11,440.89 4,654,154,052 | 7.875 2023/09/15 | 0.57 |
| 23 | ALLY 8% GLOBAL | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 34,804,000 | 13,209.53 4,597,444,821 | 13,098.99 4,558,972,479 | 8.000 2031/11/01 | 0.56 |
| 24 | INTELSAT JACKSON 8% 02/24 144A | アメリカ・ドル ルクセンブルグ | 社債券 - | 37,010,000 | 11,689.60 4,326,322,810 | 11,606.70 4,295,639,670 | 8.000 2024/02/15 | 0.52 |
| 25 | ALLY FINL INC 5.75% 11/20/2025 | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 37,710,000 | 11,275.08 4,251,832,668 | 11,275.08 4,251,832,668 | 5.750 2025/11/20 | 0.52 |
| 26 | CSC HLDGS 5.5% 04/15/27 144A | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 39,870,000 | 10,487.48 4,181,359,272 | 10,528.94 4,197,886,384 | 5.500 2027/04/15 | 0.51 |
| 27 | CHESAPEAKE ENERGY 8% 01/15/25 | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 37,095,000 | 11,192.17 4,151,737,316 | 11,261.26 4,177,365,324 | 8.000 2025/01/15 | 0.51 |
| 28 | BARCLAYS 7.625% 11/21/22 | アメリカ・ドル イギリス | 社債券 - | 34,979,000 | 12,010.17 4,201,037,714 | 11,896.87 4,161,405,282 | 7.625 2022/11/21 | 0.51 |
| 29 | DYNEGY INC 8.125% 1/30/26 144A | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 34,490,000 | 12,104.13 4,174,714,437 | 12,021.22 4,146,120,502 | 8.125 2026/01/30 | 0.51 |
| 30 | SPRINT COMMUNICATIONS 6% 11/15/22 | アメリカ・ドル アメリカ | 社債券 - | 37,330,000 | 10,998.73 4,105,825,909 | 10,888.19 4,064,561,327 | 6.000 2022/11/15 | 0.50 |

(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

(2018年6月29日現在)

| 種 類 | 国内 / 外国 | 業種 / 種別 | 投資比率 (%) |
|-------------|---------|------------------------|-------------|
| 株式 | 外国 | 工業部品 | 0.05 |
| | | エネルギー | 0.46 |
| | | 素材 | 0.44 |
| | | 資本財 | 0.47 |
| | | 運輸 | 0.11 |
| | | 自動車・自動車部品 | 0.35 |
| | | 消費者サービス | 0.70 |
| | | メディア | 0.22 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 0.02 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 0.22 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 0.33 |
| | | 銀行 | 0.37 |
| | | 各種金融 | 0.02 |
| | | テクノロジー・ハードウェア及び機器 | 0.28 |
| 公益事業 | 0.25 | | |
| | 小計 | | 4.26 |
| 新株予約権証券 | 外国 | - | 0.04 |
| | 小計 | | 0.04 |
| 公社債券 | 国内 | 社債券 | 0.40 |
| | 小計 | | 0.40 |
| | 外国 | 社債券 | 86.22 |
| | 小計 | | 86.22 |
| 投資証券 | 外国 | - | 0.08 |
| | 小計 | | 0.08 |
| 合計(対純資産総額比) | | | 91.00 |

【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】

(2018年6月29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 | 売建 | 192,000 | 21,147,949 | 21,173,760 | 100.21 |

(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

(2018年6月29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 | 169,989 | 18,808,974 | 18,785,583 | 0.00 |
| | アメリカ・ドル | 売建 | 10,743,826 | 1,185,636,445 | 1,187,251,727 | 0.14 |
| 貸付債権 | アメリカ・ドル | - | 340,339,088.13 | 37,492,800,550 | 37,217,317,868 | 4.53 |

(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】

2018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。

| 期 | 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) |
|----|--------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 1期 | (2018年5月22日) | 20 | 20 | 0.9831 | 0.9831 |
| | 2017年11月末日 | 11 | - | 0.9943 | - |
| | 2017年12月末日 | 11 | - | 0.9969 | - |
| | 2018年1月末日 | 17 | - | 0.9990 | - |
| | 2018年2月末日 | 18 | - | 0.9878 | - |
| | 2018年3月末日 | 16 | - | 0.9769 | - |
| | 2018年4月末日 | 19 | - | 0.9806 | - |
| | 2018年5月末日 | 20 | - | 0.9809 | - |
| | 2018年6月末日 | 21 | - | 0.9809 | - |

【分配の推移】

| 期 | 1口当たりの分配金(円) |
|-----|--------------|
| 第1期 | 0.0000 |

【収益率の推移】

| 期 | 収益率(%) |
|-----|--------|
| 第1期 | 1.7 |

(注) 収益率とは、計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を直前の計算期間末の基準価額(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1期 | 23,861,151 | 3,326,276 | 20,534,875 |

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

< 参考情報 >

(2018年6月29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 | 9,809円 |
| 純資産総額 | 21.1百万円 |

分配の推移

| 決算期 | 分配金(1万円当たり/税引前) |
|---------|-----------------|
| 2018年5月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0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 | アリー LLC | 8% | 2031/11/01 | 自動車ローン | BB/Ba | 1.5% |
| 2 | CCOホールディングス/キャピタル | 5.125% | 2027/05/01 | メディアケーブル | BB/Ba | 1.3% |
| 3 | バリアントファーマシューティカルズIntl | 5.875% | 2023/05/15 | 医薬品 | B | 1.2% |
| 4 | アルティス | 7.75% | 2022/05/15 | メディア放送 | B | 1.2% |
| 5 | APXグループ | 8.75% | 2020/12/01 | 支援サービス | CCC/Caa | 1.2% |
| 6 | スプリントキャピタルコーポレーション | 6.9% | 2019/05/01 | 通信 | B | 1.1% |
| 7 | シティグループ | 5.35% | 2049/12/31 | 金融/投資 | BB/Ba | 1.1% |
| 8 | CHS/コミュニティヘルスシステムズ | 6.25% | 2023/03/31 | 健康サービス | B | 1.0% |
| 9 | チェサピークエナジー | 8% | 2027/06/15 | エネルギー | CCC/Caa | 1.0% |
| 10 | テネットヘルスケア | 6.75% | 2023/06/15 | 健康サービス | CCC/Caa | 1.0% |

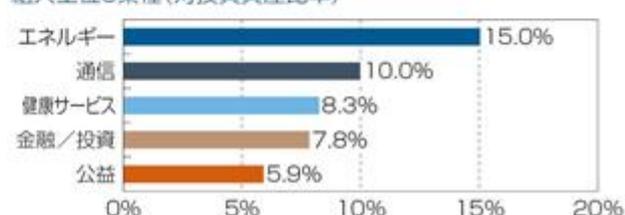
資産別組入状況

| | |
|---------------|-------|
| 債券等 | 91.2% |
| 株式 | 4.3% |
| 新株予約権証券(ワラント) | 0.0% |
| 投資証券 | 0.1% |
| 現金-その他 | 4.5% |

格付別組入状況(対投資債券比率)

| | |
|---------|-------|
| A以上 | - |
| BBB/Baa | 5.2% |
| BB/Ba | 40.0% |
| B | 38.7% |
| CCC/Caa | 15.1% |
| CC/Ca以下 | - |
| 格付なし | 1.1% |

組入上位5業種(対投資資産比率)



※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。

※2049/12/31は、永久債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おりません。

※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、尚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



※当ファンドは、ベンチマークを設定しておりませんので、ファンド設定前の年間騰落率についての情報は記載しておりません。

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

※2017年は当初設定日(2017年11月24日)以降2017年末までの実績、2018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】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

（略）

ファンドの販売価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額（当初申込期間中は1口当たり1円）とします。

（略）

ファンドの申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額（当初申込期間中は1口当たり1円）に3.24%（税抜 3.00%）を上限として販売会社が別途定める手数料率を乗じて得た額とします。

（略）

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

<訂正後>

（略）

ファンドの販売価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（略）

ファンドの申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.24%（税抜 3.00%）を上限として販売会社が別途定める手数料率を乗じて得た額とします。

（略）

ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払と引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社

振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行いません。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行いません。

3【資産管理等の概要】

（４）【計算期間】

<訂正前>

ファンドの計算期間は、毎年5月23日から翌年5月22日までとすることを原則とします。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日以降の最初の営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、第1期の計算期間は信託契約締結日から2018年5月22日までとし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

<訂正後>

ファンドの計算期間は、毎年5月23日から翌年5月22日までとすることを原則とします。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日以降の最初の営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（平成29年11月24日（設定日）から平成30年5月22日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド（資産成長型）（為替ヘッジあり）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| 第1期計算期間 平成30年5月22日現在 | |
|-------------------------|------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 親投資信託受益証券 | 20,924,364 |
| 派生商品評価勘定 | 2,240 |
| 未収入金 | 135,911 |
| 流動資産合計 | 21,062,515 |
| 資産合計 | |
| 21,062,515 | |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 3,108 |
| 未払金 | 738,239 |
| 未払受託者報酬 | 1,627 |
| 未払委託者報酬 | 124,730 |
| その他未払費用 | 7,746 |
| 流動負債合計 | 875,450 |
| 負債合計 | |
| 875,450 | |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 20,534,875 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 347,810 |
| （分配準備積立金） | 481,301 |
| 元本等合計 | 20,187,065 |
| 純資産合計 | |
| 20,187,065 | |
| 負債純資産合計 | |
| 21,062,515 | |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| 第 1 期計算期間 | |
|---|---------|
| 自 平成29年11月24日(設定日) | |
| 至 平成30年 5 月22日 | |
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 121,126 |
| 為替差損益 | 282,576 |
| 営業収益合計 | 161,450 |
| 営業費用 | |
| 受託者報酬 | 1,627 |
| 委託者報酬 | 124,730 |
| その他費用 | 20,706 |
| 営業費用合計 | 147,063 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 308,513 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 308,513 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 308,513 |
| 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（ ） | 58,958 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 264 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 264 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 98,519 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 98,519 |
| 分配金 | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 347,810 |

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|---------------------|--|
| 1．有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |
| 2．デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における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。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | 第1期計算期間 平成30年5月22日現在 |
|----------------------------|-------------------------|
| 1．元本の推移 | |
| 期首元本額 | 11,207,000 円 |
| 期中追加設定元本額 | 12,654,151 円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,326,276 円 |
| 2．受益権の総数 | 20,534,875 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 | 347,810 円 |
| 4．1口当たり純資産額 | 0.9831 円 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 第1期計算期間 自 平成29年11月24日（設定日） 至 平成30年5月22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0.35%以内の額 |
| 2．分配金の計算過程 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（481,301円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（31,607円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は512,908円（1口当たり0.024977円）であります。分配は行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

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

．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種 類 | 第 1 期計算期間 平成30年 5 月22日現在 | |
|-----------|-----------------------------|--|
| | 当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円) | |
| 親投資信託受益証券 | 276,723 | |
| 合 計 | 276,723 | |

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

| 種 類 | 第 1 期計算期間 平成30年 5 月22日 現在 | | | |
|-----------|------------------------------|------------|------------|-------------|
| | 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 | 20,587,472 | - | 20,588,340 | 868 |
| アメリカ・ドル | 20,587,472 | - | 20,588,340 | 868 |
| 合計 | 20,587,472 | - | 20,588,340 | 868 |

（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。

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

（ア）株式

該当事項はありません。

（イ）株式以外の有価証券

| 種 類 | 銘 柄 | 券面総額 （円） | 評価額 （円） | 備考 |
|---------------|------------------------------|-------------|------------|----|
| 親投資信託受益 証券 | フィデリティ・USハイ・イールド・マ ザーファンド | 6,755,679 | 20,924,364 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | 6,755,679 | 20,924,364 | |
| 合計 | | 6,755,679 | 20,924,364 | |

（注）親投資信託受益証券における券面総額の数値は証券数を表示しております。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

（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 | 平成30年5月22日現在 |
|-------------|-----------------|
| | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 25,598,203,103 |
| 金銭信託 | 100,598 |
| 株式 | 38,128,222,063 |
| 新株予約権証券 | 288,783,378 |
| 社債券 | 740,639,188,085 |
| 投資証券 | 598,735,944 |
| 貸付債権 | 41,236,656,043 |
| 派生商品評価勘定 | 1,142,992 |
| 未収入金 | 10,716,502,209 |
| 未収配当金 | 29,648,361 |
| 未収利息 | 11,697,244,119 |
| 前払費用 | 379,548,898 |
| 流動資産合計 | 869,313,975,793 |
| 資産合計 | 869,313,975,793 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 66,757,622 |
| 未払金 | 8,830,919,427 |
| 未払解約金 | 11,619,731,291 |
| その他未払費用 | 135 |
| 流動負債合計 | 20,517,408,475 |
| 負債合計 | 20,517,408,475 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 274,043,492,200 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 574,753,075,118 |
| 元本等合計 | 848,796,567,318 |
| 純資産合計 | 848,796,567,318 |
| 負債純資産合計 | 869,313,975,793 |

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

（貸借対照表に関する注記）

| 項 目 | 平成30年5月22日現在 |
|---|-------------------|
| 1. 元本の推移 | |
| 期首元本額 | 335,264,311,790 円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,679,945,704 円 |
| 期中一部解約元本額 | 64,900,765,294 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 | 253,609,607,506 円 |
| フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド （資産成長型） | 8,819,441,127 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） | 11,562,983,227 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） | 7,636,429 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） | 6,755,679 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） | 37,068,232 円 |
| 計 | 274,043,492,200 円 |
| 3. 受益権の総数 | 274,043,492,200 口 |
| 4. 1口当たり純資産額 | 3.0973 円 |

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

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

・金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種 類 | 平成30年5月22日現在 |
|---------|----------------------|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 3,756,351,484 |
| 新株予約権証券 | 47,993,259 |
| 社債券 | 18,077,446,973 |
| 投資証券 | 99,487,846 |
| 合 計 | 14,173,614,384 |

（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 | 平成30年5月22日 現在 | | | |
|-----------|----------------|-----------|----------------|-------------|
| | 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 | 11,619,646,173 | - | 11,685,260,803 | 65,614,630 |
| アメリカ・ドル | 11,619,646,173 | - | 11,685,260,803 | 65,614,630 |
| 合計 | 11,619,646,173 | - | 11,685,260,803 | 65,614,630 |

（注1）時価の算定方法

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

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

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

（注2）デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(ア) 株式

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|--------------------------------|--------------------------------|-----------|---------------|------------------------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカ・ドル | PENN NATIONAL GAMING INC | 907,560 | 35.18 | 31,927,960.80 | |
| | SOUTHWESTERN ENERGY CO | 1,634,897 | 4.73 | 7,733,062.81 | |
| | UNITED RENTALS INC | 184,200 | 173.78 | 32,010,276.00 | |
| | BANK OF AMERICA CORPORATION | 952,600 | 30.55 | 29,101,930.00 | |
| | SHIP FINANCE INTL LTD | 74,260 | 14.45 | 1,073,057.00 | |
| | MELCO RESORTS & ENTERTAINMENTS | 553,200 | 31.49 | 17,420,268.00 | |
| | WHITING PETROLEUM CORP | 334,090 | 53.22 | 17,780,269.80 | |
| | GENERAL MOTORS CO | 279,996 | 38.09 | 10,665,047.64 | |
| | HCA HLDGS INC | 190,300 | 103.86 | 19,764,558.00 | |
| | APTIV PLC | 155,326 | 98.18 | 15,249,906.68 | |
| | MOTORS LIQ CO GUC TR | 116,980 | 10.10 | 1,181,498.00 | |
| | ALLERGAN PLC | 145,206 | 154.21 | 22,392,217.26 | |
| | CDW CORPORATION | 256,300 | 79.86 | 20,468,118.00 | |
| | UC HOLDINGS INC | 143,715 | 24.13 | 3,467,842.95 | |
| | CHARTER COMMUNICATIONS INC A | 68,685 | 266.55 | 18,307,986.75 | |
| | CONTURA ENERGY INC | 61 | 65.50 | 3,995.50 | |
| | LINN ENERGY INC | 294,811 | 40.76 | 12,016,496.36 | |
| | WARRIOR MET COAL INC | 3,982 | 27.81 | 110,739.42 | |
| | AERCAP HOLDINGS NV | 137,000 | 55.97 | 7,667,890.00 | |
| | LYONDELLBASELL INDS CLASS A | 295,100 | 117.53 | 34,683,103.00 | |
| | ELDORADO RESORTS INC | 181,500 | 43.70 | 7,931,550.00 | |
| | US FOODS HOLDING CORP | 298,000 | 35.63 | 10,617,740.00 | |
| | RED ROCK RESORTS INC 144A | 1,786 | 34.64 | 61,867.04 | |
| ASCENT RES MARCELLUS HLDGS INC | 1,229,672 | 2.98 | 3,664,422.56 | | |
| VISTRA ENRGY SR 0 PC 7% 7/1/19 | 195,200 | 93.85 | 18,319,520.00 | | |
| アメリカ・ドル 小計 | | 8,634,427 | | 343,621,323.57 (38,128,222,063) | |
| 合計 | | 8,634,427 | | 38,128,222,063 (38,128,222,063) | |

(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 | ASCENT RES CL A 1LN WT 3/30/23 | 318,370.00 | - | |
| | | CONTURA ENERGY WTS 26/07/2023 | 1,324.00 | 34,093.00 | |
| | | GENERAL MTRS CO 7/10/19 WT | 34,887.00 | 703,321.92 | |
| | | GULFMARK OFFSHORE WT 10/21/42 | 57,390.00 | 1,865,175.00 | |
| | アメリカ・ドル | 小計 | 411,971.00 | 2,602,589.92 (288,783,378) | |
| 新株予約権証券 合計 | | | | 288,783,378 (288,783,378) | |
| 社債券 | アメリカ・ドル | 1011778 BC 4.25% 05/15/24 144A | 24,130,000.00 | 22,742,525.00 | |
| | | ACRISURE LLC 7% 11/15/25 144A | 14,085,000.00 | 13,187,081.25 | |
| | | AES CORP 4% 03/15/21 | 17,880,000.00 | 17,897,343.60 | |
| | | AES CORP 4.5% 03/15/23 | 11,820,000.00 | 11,820,000.00 | |
| | | AES CORP 5.125% 09/01/2027 | 7,830,000.00 | 7,771,275.00 | |
| | | ALBERTSON'S INC 7.45% 8/01/29 | 975,000.00 | 780,000.00 | |
| | | ALBERTSONS COM 5.75% 03/15/25 | 10,515,000.00 | 9,279,487.50 | |
| | | ALBERTSONS COM 6.625% 06/15/24 | 3,975,000.00 | 3,776,250.00 | |
| | | ALBERTSONS MTN 6.625% 6/01/28 | 10,659,000.00 | 8,237,275.20 | |
| | | ALCOA NEDERLA 6.125% 5/28 144A | 2,285,000.00 | 2,330,700.00 | |
| | | ALLY 8% GLOBAL | 34,804,000.00 | 41,590,780.00 | |
| | | ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31 | 91,910,000.00 | 109,832,450.00 | |
| | | ALLY FINL INC 5.75% 11/20/2025 | 37,710,000.00 | 38,464,200.00 | |
| | | ALLY LLC MTN 8% 12/31/18 | 27,200,000.00 | 27,920,800.00 | |
| | | ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18 Escrow | 6,605,000.00 | - | |
| | | ALTICE FINCO 7.625% 2/25 144A | 21,930,000.00 | 20,559,375.00 | |
| | | ALTICE FINCO 8.125% 01/24 144A | 4,115,000.00 | 4,228,162.50 | |

| | | | |
|-----------------------------------|----------------|---------------|--|
| ALTICE FING 6.625% 2/23 144A | 20,540,000.00 | 20,540,000.00 | |
| ALTICE FING SA 7.5% 05/26 144A | 17,590,000.00 | 17,194,225.00 | |
| ALTICE SA 7.625% 2/15/25 144A | 34,390,000.00 | 31,122,950.00 | |
| ALTICE SA 7.75% 05/15/22 144A | 92,680,000.00 | 89,088,650.00 | |
| AMC ENT HLDGS 5.875% 11/15/26 | 7,785,000.00 | 7,639,031.25 | |
| AMC ENT HLDGS 6.125% 05/15/27 | 6,450,000.00 | 6,224,250.00 | |
| ANTERO LP/ FIN 5.375% 09/15/24 | 3,540,000.00 | 3,504,600.00 | |
| ANTERO RES CORP 5.625% 6/01/23 | 12,650,000.00 | 12,855,562.50 | |
| ANTERO RES CRP 5.125% 12/22 WI | 5,235,000.00 | 5,274,262.50 | |
| ANTERO RS FN 5.375% 11/21 WI | 9,260,000.00 | 9,352,600.00 | |
| APERGY CORP 6.375% 5/1/26 144A | 2,850,000.00 | 2,907,000.00 | |
| APX GROUP 7.875% 12/01/22 WI | 49,265,000.00 | 48,279,700.00 | |
| APX GROUP INC 7.625% 09/01/23 | 30,375,000.00 | 26,881,875.00 | |
| APX GRP INC 6.375% 12/1/19 WI | 10,901,000.00 | 10,982,757.50 | |
| APX GRP INC 8.75% 12/1/20 WI | 103,960,000.00 | 96,617,305.20 | |
| ARAMARK SERVICES 5% 2/28 144A | 15,015,000.00 | 14,451,937.50 | |
| ARAMARK SVCS 5% 4/01/25 144A | 8,500,000.00 | 8,521,250.00 | |
| ARCELORMITTA 7% 10/15/39 | 14,530,000.00 | 16,854,800.00 | |
| ARCELORMITTAL STEP 3/01/41 | 350,000.00 | 397,078.50 | |
| ARDAGH PKG FIN 7.25% 5/24 144 | 16,335,000.00 | 17,110,912.50 | |
| ARDAGH PKG/USA 6% 2/15/25 144A | 34,155,000.00 | 33,728,062.50 | |
| ASHTead CAP 4.125% 8/25 144A | 7,265,000.00 | 6,810,937.50 | |
| ASHTead CAP 4.375% 8/27 144A | 7,660,000.00 | 7,066,350.00 | |
| AV HOMES INC 6.625% 05/15/22 | 8,135,000.00 | 8,257,025.00 | |
| AVANTOR INC 6% 10/01/24 144A | 14,375,000.00 | 14,267,187.50 | |

| | | | |
|--------------------------------------|---------------|---------------|--|
| AVANTOR INC 9% 10/01/25 144A | 10,080,000.00 | 10,281,600.00 | |
| BALBOA MRGR 11.375% 12/21 144A | 47,175,000.00 | 51,361,781.25 | |
| BANK OF AMERICA 5.86%/VAR PERP | 32,140,000.00 | 31,939,125.00 | |
| BANK OF AMERICA 6.1% VAR PERP | 12,630,000.00 | 13,072,050.00 | |
| BARCLAYS 7.625% 11/21/22 | 45,099,000.00 | 49,000,063.50 | |
| BBA US HLDGS 5.375% 5/26 144A | 2,885,000.00 | 2,885,000.00 | |
| BI-LO LLC/CORP 9.25% 2/19 144A | 18,155,000.00 | 18,176,786.00 | |
| BI-LO/FIN PIK VAR 9/15/18 144A | 13,381,515.00 | 7,811,459.37 | |
| BIG RIVER STL 7.25% 9/25 144A | 7,770,000.00 | 8,100,225.00 | |
| BLUESCPE STL/FN 6.5% 5/21 144A | 1,686,000.00 | 1,740,795.00 | |
| BMC EAST LLC 5.5% 10/1/24 144A | 6,215,000.00 | 6,028,550.00 | |
| BOMBARDIER INC 7.5% 12/24 144A | 9,355,000.00 | 9,752,587.50 | |
| BRAND ENERGY 8.5% 7/25 144A | 11,550,000.00 | 11,752,125.00 | |
| BROOKFIELD RES 6.125 7/22 144A | 5,470,000.00 | 5,550,409.00 | |
| BROOKFIELD RESIDENTL PPTYS INC | 2,925,000.00 | 2,968,875.00 | |
| C&S GRP EN 5.375% 7/15/22 144A | 12,910,000.00 | 12,554,975.00 | |
| C&W SR FIN 6.875% 9/15/27 144A | 10,465,000.00 | 10,203,375.00 | |
| CALFRAC HLDGS 7.5% 12/20 144A | 19,765,000.00 | 20,041,710.00 | |
| CALIF RES 8.0% 12/15/22 144A | 64,660,000.00 | 59,325,550.00 | |
| CALLON PETRO 6.125% 10/01/24 | 3,310,000.00 | 3,367,925.00 | |
| CALPINE CORP 5.375% 01/15/23 | 11,640,000.00 | 10,999,800.00 | |
| CALPINE CORP 5.75% 01/15/25 | 7,130,000.00 | 6,345,700.00 | |
| CATALENT PHA 4.875% 1/26 144A | 3,210,000.00 | 3,097,650.00 | |
| CBS RADIO 7.25% 11/1/24 144A | 6,120,000.00 | 5,905,800.00 | |

| | | | |
|--|----------------|---------------|--|
| CCO HLDGS LLC 5.75% 01/15/24 | 34,185,000.00 | 34,355,925.00 | |
| CCO HLDGS LLC 5.75% 2/26 144A | 8,140,000.00 | 7,895,800.00 | |
| CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144 | 102,045,000.00 | 94,264,068.75 | |
| CCO HLDGS/CAP 5.5% 05/26 144A | 12,870,000.00 | 12,290,850.00 | |
| CD&R WATERWKS 6.125% 8/25 144A | 3,880,000.00 | 3,734,500.00 | |
| CDK GLOBAL INC 4.875% 06/01/27 | 15,895,000.00 | 15,020,775.00 | |
| CEDAR FAIR 5.375% 4/27 144A | 5,515,000.00 | 5,487,425.00 | |
| CENGAGE LEARN 9.5% 6/24 144A | 11,875,000.00 | 9,678,125.00 | |
| CENTENE ESCRO 5.375% 6/26 144A | 20,140,000.00 | 20,210,490.00 | |
| CEQUEL 7.5% 4/01/28 144A | 20,300,000.00 | 20,249,250.00 | |
| CEQUEL COM HLDG 1/CAP CP 7.75% 7/25 144A | 12,110,000.00 | 12,533,850.00 | |
| CERIDIAN HCM HLD 11% 3/21 144A | 21,990,000.00 | 22,651,899.00 | |
| CF INDUS INC 5.375% 03/15/44 | 13,930,000.00 | 12,084,275.00 | |
| CF INDUSTRI INC 5.15% 03/15/34 | 18,530,000.00 | 16,797,445.00 | |
| CF INDUSTRIES INC 4.95% 6/43 | 36,807,000.00 | 30,606,860.85 | |
| CHARLES RIVER 5.5% 4/26 144A | 5,735,000.00 | 5,756,506.25 | |
| CHEMOURS CO 5.375% 05/15/2027 | 4,070,000.00 | 3,978,425.00 | |
| CHEMOURS CO 6.625% 5/15/23 | 6,645,000.00 | 6,977,250.00 | |
| CHEMOURS CO 7% 05/15/2025 | 4,355,000.00 | 4,703,400.00 | |
| CHENIERE CORPUS 5.125% 06/27 | 10,165,000.00 | 9,923,581.25 | |
| CHENIERE CORPUS 5.875% 3/31/25 | 11,540,000.00 | 11,972,750.00 | |
| CHESAPEAKE 8% 12/15/22 REGS | 11,694,000.00 | 12,381,022.50 | |
| CHESAPEAKE ENERGY 3ML+325 4/19 | 9,705,000.00 | 9,680,737.50 | |
| CHESAPEAKE ENERGY 4.875% 04/22 | 24,040,000.00 | 23,318,800.00 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------------|---------------|--|
| CHESAPEAKE ENERGY 8% 01/15/25 | 43,320,000.00 | 43,861,500.00 | |
| CHESAPEAKE ENERGY 8% 06/15/27 | 73,300,000.00 | 73,849,750.00 | |
| CHOBANI 7.5% 04/15/25 144A | 16,630,000.00 | 16,006,375.00 | |
| CHS/CMNTY HEALTH 6.25% 3/31/23 | 83,300,000.00 | 77,885,500.00 | |
| CHUKCHANSI EC 9.75 5/30/20 RGS | 4,220,732.56 | 2,848,994.47 | |
| CIT GROUP INC NEW 4.125% 3/21 | 4,905,000.00 | 4,917,262.50 | |
| CIT GROUP INC NEW 5.25% 3/7/25 | 7,490,000.00 | 7,564,900.00 | |
| CIT GROUP NEW 5.375% 5/15/20 | 903,000.00 | 928,961.25 | |
| CITGO HLDG 10.75% 2/20 144A | 18,135,000.00 | 19,313,775.00 | |
| CITIGROUP 5.35% PERP | 83,055,000.00 | 82,308,335.55 | |
| CLEAR CHANNEL 7.625 3/20 WI | 22,155,000.00 | 22,099,612.50 | |
| CLEAR CHANNEL 8.75% 12/20 144A | 2,605,000.00 | 2,722,225.00 | |
| CLEVELAND-CLIFF 5.75% 03/01/25 | 25,980,000.00 | 24,843,375.00 | |
| CNH INDUSTRIAL CAP 4.375% 4/22 | 15,000,000.00 | 15,150,000.00 | |
| COMMUNITY HLTH 5.125 8/21 | 12,885,000.00 | 12,176,325.00 | |
| CONSOLI ENRGY 6.875% 6/25 144A | 26,970,000.00 | 27,610,537.50 | |
| CONSOLID FRN 3ML+375 6/22 144A | 22,670,000.00 | 22,640,302.30 | |
| CONSOLIDATED 6.5% 5/26 144A | 16,275,000.00 | 16,173,281.25 | |
| CONTINENTAL 4.375% 1/28 144A | 11,370,000.00 | 11,164,544.10 | |
| CONTL AIR ERJ1 9.798% 4/1/21 | 1,122,793.36 | 1,202,792.37 | |
| CONTL AIR PASS RJ04 9.558 9/19 | 214,446.70 | 221,148.15 | |
| COTY INC 6.5% 04/15/26 144A | 12,205,000.00 | 11,777,825.00 | |
| COVANTA HLDG 5.875% 3/1/24 | 8,530,000.00 | 8,380,725.00 | |
| COVEY PK 7.5% 5/15/25 144A | 3,735,000.00 | 3,716,325.00 | |
| CRC ESCROW 5.25% 10/15/25 144A | 28,430,000.00 | 27,292,800.00 | |

| | | | |
|--------------------------------------|---------------|---------------|--|
| CREDIT AGR 8.125/VAR PERP 144A | 20,050,000.00 | 22,481,062.50 | |
| CREDIT AGRIC 7.875% PERP 144A | 25,145,000.00 | 26,826,697.60 | |
| CRESTWOOD MID P/F 5.75% 4/1/25 | 15,145,000.00 | 14,917,825.00 | |
| CRESTWOOD MIDSTRM 6.25% 04/23 | 8,790,000.00 | 8,943,825.00 | |
| CROWN AMER 4.25% 09/30/26 | 5,300,000.00 | 4,823,000.00 | |
| CROWN AMERICAS 4.75% 2/26 144A | 25,060,000.00 | 23,744,350.00 | |
| CSC HLDGS 5.5% 04/15/27 144A | 39,870,000.00 | 37,826,662.50 | |
| CSC HLDGS LLC 5.375% 2/28 144A | 12,540,000.00 | 11,615,175.00 | |
| CTR PARTNERSHIP 5.25% 6/1/25 | 14,710,000.00 | 14,489,350.00 | |
| CUMBERLAND FARM 6.75 5/25 144A | 3,730,000.00 | 3,841,900.00 | |
| CYRUSONE LP/FIN 5% 03/15/24 | 6,280,000.00 | 6,327,100.00 | |
| CYRUSONE LP/FIN 5.375% 3/15/27 | 5,190,000.00 | 5,228,925.00 | |
| DAE FDG LLC 4.5% 08/01/22 144A | 7,165,000.00 | 6,860,487.50 | |
| DAE FDG LLC 5% 08/01/24 144A | 9,870,000.00 | 9,388,837.50 | |
| DCP MIDSTR 5.85% 5/21/43 144A | 5,575,000.00 | 5,226,562.50 | |
| DENBURY RESOURC 6.375% 8/15/21 | 3,405,000.00 | 3,234,750.00 | |
| DENBURY RESOURCE 4.625 7/15/23 | 22,385,000.00 | 19,363,025.00 | |
| DENBURY RESOURCES 5.5% 05/22 | 11,055,000.00 | 10,087,687.50 | |
| DIAMOND FIN 5.875% 6/21 144A | 2,295,000.00 | 2,360,453.40 | |
| DIAMOND FIN 7.125% 6/24 144A | 8,010,000.00 | 8,558,925.30 | |
| DISH CORP 5% 03/15/23 WI | 14,355,000.00 | 12,417,075.00 | |
| DISH DBS CORP 5.875% 7/22 | 32,995,000.00 | 31,262,762.50 | |
| DOLPHIN SUB 7.25% 10/15/21 | 13,220,000.00 | 14,376,750.00 | |
| DPL INC 6.75% 10/01/2019 | 3,934,000.00 | 4,091,360.00 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------------|---------------|--|
| DRAX FINCO 6.625% 11/1/25 144A | 7,415,000.00 | 7,489,150.00 | |
| DYNEGY INC 5.875% 6/1/23 | 8,930,000.00 | 9,153,250.00 | |
| DYNEGY INC 7.375% 11/22 W/I | 20,825,000.00 | 21,866,250.00 | |
| DYNEGY INC 7.625% 11//24 W/I | 46,075,000.00 | 49,530,625.00 | |
| DYNEGY INC 8% 01/15/25 144A | 6,730,000.00 | 7,285,225.00 | |
| DYNEGY INC 8.125% 1/30/26 144A | 34,490,000.00 | 37,766,550.00 | |
| EAGLE INTER 7.5% 5/1/25 144A | 3,070,000.00 | 3,131,400.00 | |
| EIG INVS CORP 10.875% 02/01/24 | 15,000,000.00 | 16,200,000.00 | |
| ELDORADO RESRT 6% 04/01/25 | 9,965,000.00 | 9,915,175.00 | |
| ENDEAVOR ENERGY 5.5% 1/26 144A | 4,040,000.00 | 3,989,500.00 | |
| ENDEAVOR ENERGY 5.75 1/28 144A | 4,065,000.00 | 4,029,431.25 | |
| ENERGY TRANSFER 5.5% 6/1/27 | 11,915,000.00 | 12,063,937.50 | |
| ENERGY TRANSFER 9% 4/15/19 | 1,464,000.00 | 1,540,025.52 | |
| ENSCO PLC 4.5% 10/01/2024 | 18,060,000.00 | 15,147,825.00 | |
| ENSCO PLC 5.2% 3/15/25 | 3,665,000.00 | 3,110,668.75 | |
| ENSCO PLC 7.75% 02/01/2026 | 9,670,000.00 | 9,331,550.00 | |
| ENSEMBLE S MRG 9% 9/30/23 144A | 28,065,000.00 | 29,538,412.50 | |
| ENTEGRIS INC 4.625% 02/26 144A | 10,540,000.00 | 10,171,100.00 | |
| EP ENERGY LLC 7.75% 5/26 144A | 26,165,000.00 | 26,557,475.00 | |
| EP ENRGY/EVRST 8% 11/29/24 144 | 5,225,000.00 | 5,225,000.00 | |
| EQUINIX INC 5.375% 5/15/27 | 7,185,000.00 | 7,239,318.60 | |
| ESAL GMBH 6.25% 02/05/23 144A | 14,160,000.00 | 13,441,946.40 | |
| EW SCRIPPS 5.125% 05/25 144A | 3,830,000.00 | 3,619,350.00 | |
| EXELA INTER/FIN 10% 07/23 144A | 10,600,000.00 | 10,865,000.00 | |
| EXTERRAN PARTNER 6% 10/22 WI | 33,285,000.00 | 33,451,425.00 | |

| | | | |
|------------------------------------|---------------|---------------|--|
| EXTERRAN PR/EXLP 6% 4/1/21 WI | 2,235,000.00 | 2,246,175.00 | |
| FIRST QUANTUM 6.5% 3/24 144A | 9,295,000.00 | 8,853,487.50 | |
| FIRST QUANTUM 6.875% 3/26 144A | 9,295,000.00 | 8,789,537.90 | |
| FIRST QUANTUM 7.25% 4/23 144A | 8,900,000.00 | 8,897,241.00 | |
| FIRST QUANTUM 7.5% 4/25 144A | 18,468,000.00 | 18,098,640.00 | |
| FLEX ACQ 6.875% 1/15/25 144A | 4,065,000.00 | 3,932,887.50 | |
| FLY LEASING 5.25% 10/15/24 | 7,695,000.00 | 7,406,437.50 | |
| FMG RES AUG 4.75% 5/15/22 144A | 6,475,000.00 | 6,357,608.25 | |
| FMG RES AUGUS 5.125% 3/23 144A | 8,750,000.00 | 8,640,625.00 | |
| FREEMPORT MCMOR 6.875% 02/15/23 | 31,485,000.00 | 33,649,593.75 | |
| FRONTIER COMM 8.5% 4/26 144A | 20,580,000.00 | 19,936,875.00 | |
| FRONTIER COMMS 11% 9/15/25 | 35,685,000.00 | 28,726,425.00 | |
| FTI CONSULTING 6% 11/15/22 WI | 16,645,000.00 | 17,069,447.50 | |
| FTS INTERNATIONAL INC 6.25% 05 | 14,290,000.00 | 14,504,350.00 | |
| GCI INC 6.875% 4/15/25 | 10,070,000.00 | 10,472,800.00 | |
| GENERAL MO GLB 6.75 5/01/28DTC | 1,280,000.00 | - | |
| GENERAL MOTORS 7.4% 9/01/25 | 635,000.00 | - | |
| GENERAL MOTORS 7.7% 4/15/16 | 2,285,000.00 | - | |
| GLP CAP LP / GLP 5.25% 6/25 | 7,810,000.00 | 7,808,438.00 | |
| GM 8.25% 7/15/23 | 23,035,000.00 | - | |
| GM GLBL 7.125 7/15/13 DT | 3,690,000.00 | - | |
| GM GLBL 7.2% 1/15/11 DT | 9,305,000.00 | - | |
| GM GLBL 8.375 7/15/33 DT | 74,265,000.00 | - | |
| GOLDEN NUGGET 8.75% 10/25 144A | 8,500,000.00 | 8,893,125.00 | |
| GOLDMAN SACHS 5.375% VAR PERP | 19,240,000.00 | 19,671,938.00 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------------|---------------|--|
| GRINDING MED 7.375% 12/23 144 | 5,820,000.00 | 6,169,200.00 | |
| H&E EQUIPMENT 5.625% 09/01/25 | 11,650,000.00 | 11,475,250.00 | |
| HCA INC 4.5% 02/15/27 | 26,015,000.00 | 24,389,062.50 | |
| HCA INC 4.75% 5/01/23 | 11,720,000.00 | 11,749,300.00 | |
| HCA INC 5.25% 06/15/26 | 6,500,000.00 | 6,451,250.00 | |
| HCA INC 5.375% 02/01/25 | 20,960,000.00 | 20,671,800.00 | |
| HCA INC 5.875% 02/15/26 | 10,445,000.00 | 10,497,225.00 | |
| HCA INC 5.875% 3/15/22 | 32,351,000.00 | 34,049,427.50 | |
| HEALTHSOUTH 5.75% 11/01/24 | 21,820,000.00 | 22,152,973.20 | |
| HEALTHSOUTH CORP 5.75% 9/15/25 | 1,845,000.00 | 1,888,228.35 | |
| HESS INFRA 5.625% 02/26 144A | 12,165,000.00 | 12,278,986.05 | |
| HILCORP EN/FIN 5% 12/1/24 144A | 20,615,000.00 | 20,151,162.50 | |
| HILCORP ENRGY 5.75% 10/25 144A | 19,300,000.00 | 19,203,500.00 | |
| HILTON DOMEST 5.125% 5/26 144A | 20,305,000.00 | 19,975,043.75 | |
| HILTON LLC/INC 6.125% 12/01/24 | 3,175,000.00 | 3,313,906.25 | |
| HILTON WORLDWI 4.875% 04/01/27 | 5,940,000.00 | 5,694,975.00 | |
| HILTON WRLD 4.625% 4/1/25 144A | 9,905,000.00 | 9,595,468.75 | |
| HMAN FIN 6.375% 07/15/22 144A | 5,585,000.00 | 5,305,750.00 | |
| HOCKEY MGR 7.875% 10/1/21 144A | 11,100,000.00 | 11,530,125.00 | |
| HOLOGIC 4.375% 10/15/25 144A | 9,155,000.00 | 8,743,025.00 | |
| HOLOGIC IN 4.625% 2/01/28 144A | 3,040,000.00 | 2,857,600.00 | |
| HOWARD HUGHES 5.375% 3/25 144A | 16,220,000.00 | 15,855,050.00 | |
| HUB HL/FN PIK 8.125% 7/19 144A | 7,730,000.00 | 7,730,000.00 | |
| HUB INTEL LTD 7% 5/01/26 144A | 7,640,000.00 | 7,611,350.00 | |
| ICAHN ENTR LP 5.875% 2/1/22 WI | 11,410,000.00 | 11,534,939.50 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------------|---------------|--|
| ICAHN LP/FN COR 6.25% 02/01/22 | 17,035,000.00 | 17,482,168.75 | |
| ICAHN LP/FN COR 6.375% 12/15/2 | 25,455,000.00 | 25,441,508.85 | |
| ICAHN LP/FN COR 6.75% 02/01/24 | 7,810,000.00 | 7,927,150.00 | |
| IHO VERWALTUNGS 4.12% 9/21 144 | 6,265,000.00 | 6,233,675.00 | |
| IHS MARKIT 4.75% 2/15/25 144A | 5,050,000.00 | 4,949,000.00 | |
| IHS MARKIT LTD 4% 3/1/26 144A | 4,180,000.00 | 3,890,284.20 | |
| INDIGO NATURAL 6.875 2/26 144A | 9,730,000.00 | 9,243,500.00 | |
| INTELSAT JACKSON 8% 02/24 144A | 37,010,000.00 | 39,138,075.00 | |
| INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A | 56,712,000.00 | 56,428,440.00 | |
| J2 CLOUD/GLOBL 6% 7/15/25 144A | 6,690,000.00 | 6,735,960.30 | |
| JAGUAR LD RVR 4.5% 10/27 144A | 29,780,000.00 | 26,429,750.00 | |
| JBS INVTS GMBH 7.25% 4/24 144A | 22,850,000.00 | 22,473,889.00 | |
| JBS USA / FIN 5.75% 6/25 144A | 15,080,000.00 | 13,986,850.80 | |
| JBS USA/FIN 5.875% 07/24 144A | 725,000.00 | 694,187.50 | |
| JBS USA/FIN 6.75% 02/28 144A | 18,470,000.00 | 17,615,762.50 | |
| JONAH ENERGY 7.25% 10/25 144A | 13,345,000.00 | 9,575,037.50 | |
| JOSEPH T RYERSON 11% 5/22 144A | 5,205,000.00 | 5,751,525.00 | |
| JPMORGAN CHASE 5.15% PERP | 54,895,000.00 | 54,400,945.00 | |
| JURASSIC 6.875% 02/15/21 144A | 11,325,000.00 | 10,932,022.50 | |
| KFC CO/PIZZA 4.75% 6/1/27 144A | 7,630,000.00 | 7,172,200.00 | |
| KFC HLD/PIZZA 5% 06/24 144A | 16,250,000.00 | 16,016,325.00 | |
| LAMB WESTON 4.625% 11/1/24 144 | 6,245,000.00 | 6,042,037.50 | |
| LAMB WESTON 4.875% 11/1/26 144 | 6,310,000.00 | 6,120,700.00 | |
| LANDRYS 6.75% 10/15/24 144A | 15,935,000.00 | 16,134,187.50 | |
| LAUREATE EDU 8.25% 5/1/25 144A | 19,465,000.00 | 20,681,562.50 | |

| | | | |
|--------------------------------------|---------------|---------------|--|
| LBC TANK TRM 6.875 5/15/23 144 | 13,775,000.00 | 13,947,187.50 | |
| LEVEL 3 FIN INC 6.125% 1/15/21 | 13,505,000.00 | 13,606,287.50 | |
| MATCH GROUP INC 5% 12/27 144A | 7,545,000.00 | 7,167,750.00 | |
| MATTAMY 6.875% 12/15/23 144A | 3,310,000.00 | 3,392,750.00 | |
| MATTEL INC 6.75% 12/25 144A | 7,910,000.00 | 7,707,266.70 | |
| MCE FINANCE LTD 4.875% 06/06/2 | 3,860,000.00 | 3,592,656.40 | |
| MCGRAW-HILL 7.875% 5/24 144A | 23,116,000.00 | 21,151,140.00 | |
| MDC PARTNERS 6.5% 5/1/24 144A | 8,453,000.00 | 7,565,435.00 | |
| MEG ENERGY 6.375% 1/30/23 144A | 8,500,000.00 | 7,990,000.00 | |
| MEG ENERGY 7% 3/31/24 144A | 20,750,000.00 | 19,453,125.00 | |
| MGM GROWTH/MGP 4.5% 01/15/28 | 7,275,000.00 | 6,665,718.75 | |
| MGM RESORTS INTL 6.0% 03/15/23 | 15,580,000.00 | 16,183,725.00 | |
| MICRON TEC 5.5% 02/01/25 | 7,295,000.00 | 7,586,800.00 | |
| MOMENTIVE PERF 8.875 10/20 WI | 18,144,000.00 | - | |
| MOMENTIVE PRF MATL 3.88% 10/21 | 54,529,000.00 | 57,800,740.00 | |
| MPT OPER PARTNER 5% 10/15/27 | 31,425,000.00 | 29,382,375.00 | |
| MPT OPER PARTNERSHP 5.25% 8/26 | 8,675,000.00 | 8,328,000.00 | |
| MSCI INC 5.75% 08/15/2025 144A | 6,300,000.00 | 6,457,500.00 | |
| MURRAY ENERGY 11.25% 4/21 144A | 5,230,000.00 | 2,209,675.00 | |
| NAVIENT CORP 5.875% 10/24 | 15,925,000.00 | 15,666,218.75 | |
| NAVIENT CORP 7.25% 09/25/23 | 6,855,000.00 | 7,214,887.50 | |
| NAVIOS 8.125% 11/15/21 144A | 25,980,000.00 | 21,043,800.00 | |
| NAVIOS MARIT 11.25% 8/22 144A | 15,040,000.00 | 14,724,160.00 | |
| NAVIOS MARITIM 7.375 1/22 144A | 10,375,000.00 | 7,878,463.75 | |

| | | | |
|--------------------------------------|---------------|---------------|--|
| NAVIOS STH/FIN 7.25% 5/22 144A | 11,354,000.00 | 11,055,957.50 | |
| NEPTUNE 10.125% 01/15/23 144A | 31,355,000.00 | 34,764,856.25 | |
| NEPTUNE 10.875% 10/15/25 144A | 9,639,000.00 | 11,217,386.25 | |
| NEPTUNE 6.625% 10/15/25 144A | 9,235,000.00 | 9,483,144.45 | |
| NETFLIX 4.875% 04/15/28 144A | 10,590,000.00 | 9,928,125.00 | |
| NETFLIX 5.875% 11/15/28 144A | 12,125,000.00 | 12,075,772.50 | |
| NETFLIX INC 4.375% 11/15/26 | 15,685,000.00 | 14,572,933.50 | |
| NETFLIX INC 5.75% 03/01/24 144 | 17,200,000.00 | 17,673,000.00 | |
| NEW COTAI 10.625%PIK 5/19 144A | 43,812,568.00 | 43,182,543.25 | |
| NEW GOLD INC 6.375% 05/25 144A | 16,040,000.00 | 16,280,600.00 | |
| NEW HOME CO INC 7.25% 4/01/22 | 4,555,000.00 | 4,646,100.00 | |
| NEXTERA ENERGY 4.25% 9/24 144A | 6,615,000.00 | 6,300,787.50 | |
| NEXTERA ENERGY 4.5% 9/27 144A | 4,600,000.00 | 4,255,000.00 | |
| NGPL PIPECO 4.375% 8/22 144A | 2,435,000.00 | 2,438,043.75 | |
| NGPL PIPECO 4.875% 8/27 144A | 2,445,000.00 | 2,359,425.00 | |
| NIELSEN FINANCE 5.0% 4/22 144A | 23,380,000.00 | 22,970,850.00 | |
| NOBLE HLDG 7.875% 2/01/26 144A | 8,425,000.00 | 8,677,750.00 | |
| NOBLE HLDG INTL 6.2% 8/01/40 | 12,545,000.00 | 8,938,312.50 | |
| NOBLE HLDG INTL 7.75% 1/15/24 | 18,761,000.00 | 17,822,950.00 | |
| NOBLE HLDG LTD 6.05% 3/1/41 | 425,000.00 | 299,625.00 | |
| NOKIA CORP 3.375% 06/12/22 | 5,570,000.00 | 5,382,012.50 | |
| NOKIA CORP 4.375% 06/12/27 | 6,670,000.00 | 6,236,450.00 | |
| NOVA CHEM 4.875% 6/1/24 144A | 10,360,000.00 | 9,867,900.00 | |
| NOVA CHEM 5.25% 6/1/27 144A | 10,510,000.00 | 9,905,675.00 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------------|---------------|--|
| NRG ENERGY INC 5.75% 1/28 144A | 62,345,000.00 | 61,020,168.75 | |
| NSG HLDS LLC 7.75% 12/25 144A | 4,964,401.64 | 5,423,608.77 | |
| NUMERICABLE 6.0% 05/15/22 144A | 12,220,000.00 | 12,189,450.00 | |
| NUMERICABLE 7.375% 05/26 144A | 10,975,000.00 | 10,686,906.25 | |
| NVA HLDGS INC 6.875% 4/26 144A | 4,385,000.00 | 4,341,150.00 | |
| OASIS PETE INC 6.875% 3/15/22 | 4,456,000.00 | 4,567,400.00 | |
| OCI NV 6.625% 4/15/23 144A | 28,910,000.00 | 29,632,750.00 | |
| OLIN CORP 5% 02/01/30 | 7,325,000.00 | 6,885,500.00 | |
| ORCHESTRA BORR 6.75% 6/22 144A | 6,150,000.00 | 6,380,625.00 | |
| OSHKOSH CORP 5.375% 03/22 WI | 10,000,000.00 | 10,272,000.00 | |
| PACIFIC DRILL 7.25% 12/17 144A | 21,560,000.00 | 10,995,600.00 | |
| PARSLEPARSLEY ENG 6.25% 6/24 1 | 1,650,000.00 | 1,707,750.00 | |
| PARSLEY 5.625% 10/15/27 144A | 4,765,000.00 | 4,747,131.25 | |
| PATTERN ENERGY 5.875% 2/24 144 | 4,260,000.00 | 4,323,900.00 | |
| PBF HLD LLC/FIN 7% 11/15/23 | 8,490,000.00 | 8,787,150.00 | |
| PBF HLDG / FIN 7.25% 06/15/25 | 10,360,000.00 | 10,709,650.00 | |
| PBF LOGISTICS 6.875% 05/23 | 17,050,000.00 | 17,204,302.50 | |
| PEABODY SEC 6% 3/31/22 144 | 2,735,000.00 | 2,817,050.00 | |
| PEABODY SEC 6.375% 3/25 144A | 3,405,000.00 | 3,556,079.85 | |
| PENN NATL 5.625% 1/15/27 144A | 1,780,000.00 | 1,704,350.00 | |
| PILGRIM PRIDE 5.875% 9/27 144A | 5,725,000.00 | 5,367,187.50 | |
| PILGRIMS PRIDE 5.75% 3/25 144A | 3,220,000.00 | 3,099,250.00 | |
| PINNACLE FOODS 5.875% 1/15/24 | 4,575,000.00 | 4,700,812.50 | |
| PISCES MIDCO 8% 4/15/26 144A | 20,345,000.00 | 20,275,827.00 | |
| PLASTIPAK HLD 6.25% 10/25 144A | 2,855,000.00 | 2,740,800.00 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------------|---------------|--|
| PLATFORM 5.875% 12/1/25 144A | 9,810,000.00 | 9,515,700.00 | |
| PLATFORM SPECLTY 6.5 2/22 144A | 25,285,000.00 | 25,917,125.00 | |
| POST HLDGS 5.625% 01/28 144A | 13,375,000.00 | 12,539,062.50 | |
| POST HLDGS 5.75% 3/1/27 144 | 23,135,000.00 | 22,267,437.50 | |
| POST HLDGS INC 5.5% 3/1/25 144 | 10,820,000.00 | 10,588,884.80 | |
| PRIDE INTL INC 7.875% 8/15/40 | 11,550,000.00 | 10,279,500.00 | |
| PTC INC 6% 05/15/24 | 2,810,000.00 | 2,954,012.50 | |
| QUINTILES IMS 5% 10/15/26 144A | 5,060,000.00 | 4,857,600.00 | |
| RADIATE HOLD 6.875% 2/23 144A | 3,085,000.00 | 2,946,175.00 | |
| RADIATE HOLDCO 6.625% 2/25 144 | 3,050,000.00 | 2,821,250.00 | |
| RBS GRP PLC 8.625%/VAR PERP | 10,725,000.00 | 11,730,468.75 | |
| REYNOLDS GRP 5.75% 10/15/20 WI | 21,436,662.61 | 21,543,845.91 | |
| REYNOLDS GRP 6.875% 2/15/21 WI | 19,686,784.06 | 19,859,043.34 | |
| RITE AID 6.875% 12/15/28 144A | 17,080,000.00 | 14,005,600.00 | |
| RITE AID CORP 7.7% 2/15/27 | 21,230,000.00 | 18,523,175.00 | |
| ROSE ROCK MIDSTRM 5.625% 07/22 | 7,080,000.00 | 6,938,400.00 | |
| ROYAL BK SC 6% 12/19/23 | 24,685,000.00 | 26,150,301.60 | |
| ROYAL BK SCTLND 5.125% 5/28/24 | 34,425,000.00 | 34,876,656.00 | |
| RURAL/METRO C 10.125 7/19 144A | 4,985,000.00 | - | |
| SABRA HLTH /CPTL 5.375% 6/1/23 | 3,725,000.00 | 3,725,000.00 | |
| SAWGRASS MERG 8.75% 12/20 144A | 47,910,000.00 | 47,670,450.00 | |
| SCIENTIFIC GAMES 10% 12/1/22 | 30,525,000.00 | 32,936,475.00 | |
| SCIENTIFIC GAMES 5% 10/25 144A | 2,840,000.00 | 2,747,700.00 | |
| SCIENTIFIC GAMES 6.25 9/20 WI | 3,380,000.00 | 3,384,225.00 | |
| SCIENTIFIC GAMES 6.625% 5/21 | 30,990,000.00 | 31,611,349.50 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------------|---------------|--|
| SEMGROUP CORP 6.375% 03/15/25 | 25,000,000.00 | 23,750,000.00 | |
| SEMGROUP CORP 7.25% 03/15/26 | 22,195,000.00 | 21,918,894.20 | |
| SERVICE CORP 5.375% 05/15/2024 | 20,000,000.00 | 20,350,000.00 | |
| SERVICE CORP 5.375% 1/22 WI | 3,495,000.00 | 3,547,425.00 | |
| SESI LLC 7.75% 09/15/24 144A | 5,950,000.00 | 6,202,875.00 | |
| SHEA HOMES 5.875% 4/23 144A | 7,345,000.00 | 7,381,725.00 | |
| SILVERSEA 7.25% 2/1/25 144A | 3,725,000.00 | 3,901,937.50 | |
| SIRIUS XM 3.875% 8/1/22 144A | 3,075,000.00 | 2,982,750.00 | |
| SIRIUS XM RADIO 5% 8/1/27 144A | 19,165,000.00 | 17,967,187.50 | |
| SIX FLAGS ENT 4.875% 7/24 144A | 11,175,000.00 | 10,728,000.00 | |
| SIX FLAGS ENTMT 5.5% 4/27 144A | 10,000,000.00 | 9,750,000.00 | |
| SLM CORP 5.5% 12/31/23 | 26,956,000.00 | 26,517,965.00 | |
| SLM CORP 6.125% 03/25/2024 | 12,833,000.00 | 12,833,000.00 | |
| SLM CORP MTN 8% 3/25/20 | 5,355,000.00 | 5,689,687.50 | |
| SM ENERGY CO 5.0% 01/15/2024 | 7,515,000.00 | 7,137,747.00 | |
| SM ENERGY CO 5.625% 06/01/25 | 11,575,000.00 | 11,140,937.50 | |
| SM ENERGY CO 6.5 1/1/23 | 385,000.00 | 389,812.50 | |
| SM ENERGY CO 6.75% 09/15/26 | 3,640,000.00 | 3,710,506.80 | |
| SOFTBANK 5.125% 09/19/27 RGS | 15,955,000.00 | 14,832,087.10 | |
| SOFTBANK GR 4.75% 09/19/24 RGS | 15,955,000.00 | 15,153,580.35 | |
| SOLERA LLC/FIN 10.5% 3/24 144A | 27,875,000.00 | 31,010,937.50 | |
| SONIC AUTOMOTIV 6.125% 03/27 | 6,255,000.00 | 5,957,887.50 | |
| SONIC AUTOMOTIVE 5% 5/23 WI | 1,180,000.00 | 1,129,850.00 | |
| SOUTHWESTERN ENRGY 7.5% 4/1/26 | 9,030,000.00 | 9,391,200.00 | |
| SOUTHWESTERN ENRGY 7.75% 10/27 | 6,700,000.00 | 7,026,625.00 | |

| | | | |
|---|---------------|---------------|--|
| SPRINGLEAF FIN CRP 7.125% 3/26 | 8,055,000.00 | 8,063,860.50 | |
| SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32 | 20,010,000.00 | 21,710,850.00 | |
| SPRINT CAP GLBL 6.9% 5/01/19 | 80,666,000.00 | 82,884,315.00 | |
| SPRINT COMMUNICATIONS 6% 11/15/22 | 41,150,000.00 | 40,944,250.00 | |
| SPRINT CORP 7.125% 06/15/24 | 19,845,000.00 | 20,093,062.50 | |
| SPRINT CORP 7.62% 02/15/2025 | 3,525,000.00 | 3,635,156.25 | |
| SPRINT CORP 7.625% 03/01/2026 | 7,085,000.00 | 7,279,837.50 | |
| SPRINT CORP 7.875% 9/15/23 | 40,680,000.00 | 42,764,850.00 | |
| SPRINT NEXTEL 9% 11/15/18 144A | 30,595,000.00 | 31,398,118.75 | |
| SRC ENERGY 6.25% 12/25 144A | 5,830,000.00 | 5,932,025.00 | |
| STATION CASINOS 5.0% 10/25 | 12,535,000.00 | 12,063,057.25 | |
| STUDIO CITY 5.875% 11/19 144 | 6,260,000.00 | 6,369,550.00 | |
| STUDIO CITY 7.25% 11/21 144A | 16,285,000.00 | 16,936,562.85 | |
| SUGARHOUSE 5.875% 5/15/25 144A | 7,085,000.00 | 6,783,887.50 | |
| SUMMIT MIDSTREAM 5.5% 08/15/22 | 9,700,000.00 | 9,506,000.00 | |
| SUMMIT MIDSTREAM 5.75% 4/25 | 6,465,000.00 | 6,204,331.20 | |
| SUNOCO LP 4.875% 1/15/23 144A | 9,905,000.00 | 9,607,850.00 | |
| SUNOCO LP 5.5% 2/15/26 144A | 8,415,000.00 | 7,994,250.00 | |
| SYMANTEC CORP 5% 04/25 144A | 6,265,000.00 | 6,079,618.65 | |
| TALEN ENERGY SUP 6.5% 6/1/25 | 20,470,000.00 | 14,943,100.00 | |
| TALEN ENRGY 10.5% 1/15/26 144A | 31,580,000.00 | 27,474,600.00 | |
| TARGA RES LP 5.125% 02/01/25 | 4,670,000.00 | 4,576,600.00 | |
| TARGA RES LP 5.375% 02/01/27 | 4,670,000.00 | 4,518,225.00 | |
| TARGA RES P 5.875% 4/26 144A | 6,110,000.00 | 6,110,000.00 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------------|---------------|--|
| TEEKAY CORP 8.5% 1/15/20 | 28,230,000.00 | 29,253,337.50 | |
| TEINE ENERGY 6.875% 09/22 144A | 10,820,000.00 | 11,009,350.00 | |
| TELEFLEX INC 4.625% 11/15/27 | 3,895,000.00 | 3,689,110.30 | |
| TENET HEALTH 4.375% 10/01/21 | 21,130,000.00 | 20,918,700.00 | |
| TENET HEALTH 4.625% 7/24 144A | 24,955,000.00 | 24,019,187.50 | |
| TENET HEALTHCAR 8.125% 4/22 WI | 45,510,000.00 | 47,899,275.00 | |
| TENET HEALTHCARE 6.75% 6/15/23 | 79,135,000.00 | 78,937,162.50 | |
| TENET HLTHCRE 6.75% 02/20 WI | 5,295,000.00 | 5,440,612.50 | |
| TERRAFORM POWE 4.25% 1/23 144A | 4,870,000.00 | 4,723,900.00 | |
| TERRAFORM POWER 5% 1/28 144A | 4,890,000.00 | 4,596,600.00 | |
| TERRAFORM POWR 6.12% 6/25 144A | 28,665,000.00 | 30,743,212.50 | |
| TESORO LOG LP/FN 6.375% 5/24 | 5,660,000.00 | 6,020,825.00 | |
| TESORO LP/FIN 6.25% 10/15/22 | 5,393,000.00 | 5,622,148.57 | |
| TEVA PHARMACEU 6.75% 3/28 144A | 17,995,000.00 | 18,380,632.85 | |
| THC ESCROW 5.125% 5/25 144A | 31,865,000.00 | 30,988,712.50 | |
| TOPS HLDG/MRKT 8.0% 06/22 144A | 20,640,000.00 | 10,939,200.00 | |
| TRANSDIGM UK 6.875% 5/26 144A | 7,940,000.00 | 8,039,250.00 | |
| TRONOX FIN 5.75% 10/1/25 144A | 4,535,000.00 | 4,376,275.00 | |
| TRONOX INC 6.5% 4/15/26 144A | 16,275,000.00 | 16,112,250.00 | |
| TTM TECH 5.625% 10/1/25 144A | 3,350,000.00 | 3,266,250.00 | |
| ULTRA RES 6.875% 04/15/22 144A | 8,215,000.00 | 5,647,812.50 | |
| ULTRA RES 7.125% 04/15/25 144A | 6,160,000.00 | 3,973,200.00 | |
| UNITED AIRLS 14-2 4.625% 9/22 | 12,883,161.06 | 12,977,981.12 | |
| UNITED CONTL HLD 6.375% 6/1/18 | 1,420,000.00 | 1,420,000.00 | |
| USA COMPRESSI 6.875% 4/26 144A | 2,960,000.00 | 3,026,600.00 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------------|---------------|--|
| USIS MERGER 6.875% 05/25 144A | 11,205,000.00 | 11,261,025.00 | |
| VALEANT PHARM 5.5% 3/23 144A | 22,595,000.00 | 21,239,300.00 | |
| VALEANT PHARM 8.50% 1/27 144A | 7,830,000.00 | 7,898,512.50 | |
| VALEANT PHARMA 7% 3/15/24 144A | 13,685,000.00 | 14,454,781.25 | |
| VALEANT PHARMA 9% 12/25 144A | 10,265,000.00 | 10,675,600.00 | |
| VALEANT PHARMA 9.25% 4/26 144A | 27,230,000.00 | 28,455,350.00 | |
| VECTOR GROUP 6.125% 2/1/25 144 | 21,405,000.00 | 21,030,412.50 | |
| VERISIGN 4.625% 5/1/23 WI | 5,945,000.00 | 5,915,275.00 | |
| VERISIGN INC 4.75% 07/15/27 | 9,460,000.00 | 9,057,950.00 | |
| VERITAS /BERMU 10.5% 2/24 144A | 24,970,000.00 | 21,599,050.00 | |
| VIACOM INC 5.875/VAR 02/28/57 | 8,235,000.00 | 8,065,111.95 | |
| VIACOM INC 6.25/VAR 02/28/57 | 11,285,000.00 | 11,115,725.00 | |
| VIDEOTRON 5.125% 04/15/27 144A | 13,085,000.00 | 12,659,737.50 | |
| VIZIENT 10.375% 3/01/24 144A | 10,315,000.00 | 11,385,181.25 | |
| VPII ESCROW 7.5% 7/15/21 144A | 21,185,000.00 | 21,608,700.00 | |
| VRX ESCROW 5.875% 5/23 144A | 98,485,000.00 | 93,683,856.25 | |
| VRX ESCROW 6.125% 4/15/25 144A | 23,905,000.00 | 22,171,887.50 | |
| WALTER ENERGY 9.5% 10/19 144A | 13,820,000.00 | - | |
| WAYNE MERGER 8.25% 8/1/23 144A | 15,938,000.00 | 16,535,675.00 | |
| WEATHERFORD 9.875% 3/1/25 144A | 32,430,000.00 | 32,592,150.00 | |
| WELLCARE HEALTH 5.25% 4/1/25 | 7,170,000.00 | 7,210,510.50 | |
| WILLIAM LYON HOMES INC 5.875% | 5,565,000.00 | 5,356,312.50 | |
| WIND TRE SPA 5% 01/20/26 144A | 16,245,000.00 | 12,829,326.30 | |
| WP ROCKET MRGR 10.125 7/19 144 | 6,530,000.00 | - | |
| WPX ENERGY INC 8.25% 8/01/23 | 7,735,000.00 | 8,798,562.50 | |

| | | | | | |
|---------|---------|-----------------------------------|------------------|---------------------------------------|--|
| | | WYNDHAM HOTEL 5.375% 4/26 144A | 12,205,000.00 | 12,220,256.25 | |
| | | WYNN LAS VEGAS 5.25% 5/27 144A | 12,660,000.00 | 12,027,000.00 | |
| | | WYNN MACAU 4.875% 10/24 144A | 7,250,000.00 | 6,923,750.00 | |
| | | WYNN MACAU 5.5% 10/27 144A | 8,905,000.00 | 8,548,800.00 | |
| | | ZAYO GROUP LLC/INC 6% 04/01/23 | 9,820,000.00 | 9,979,575.00 | |
| | | ZAYO GRP/CAP 5.75% 1/15/27 144 | 27,260,000.00 | 26,374,050.00 | |
| | | ZIGGO BOND 6% 1/15/27 144A | 21,580,000.00 | 20,231,250.00 | |
| | | ZIGGO BOND FN 5.875% 1/25 144A | 8,855,000.00 | 8,390,112.50 | |
| | | ZIGGO SEC 5.5% 1/15/27 144A | 72,070,000.00 | 68,556,587.50 | |
| | アメリカ・ドル | 小計 | 6,952,728,064.99 | 6,674,830,462.19 (740,639,188,085) | |
| 社債券 合計 | | | | 740,639,188,085 (740,639,188,085) | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | EXTENDED STAY AMERICA INC UNIT | 271,700.00 | 5,395,962.00 | |
| | アメリカ・ドル | 小計 | 271,700.00 | 5,395,962.00 (598,735,944) | |
| 投資証券 合計 | | | | 598,735,944 (598,735,944) | |
| 合計 | | | | 741,526,707,407 (741,526,707,407) | |

（注）新株予約権証券および投資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 | 組入債券 時価比率 | 組入 投資証 券等 時価比 率 | 合計金額に 対する比率 |
|---------|-------------|--------------|--------------|-----------------------------|----------------|
| アメリカ・ドル | 株式 25銘柄 | 4.89% | -% | -% | 100% |
| | 新株予約権証券 4銘柄 | -% | -% | 0.04% | |
| | 社債券 445銘柄 | -% | 95.00% | -% | |
| | 投資証券 1銘柄 | -% | -% | 0.08% | |

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 | ALLIANT INSURAN TRM B EXT 5/25 C1 | 371,189.92 | 100.54 373,198.05 | 100.36 372,541.05 | 657.00 | - |
| | ASCENT RES MARCELLUS TERM 3/23 | 1,711,666.67 | 135.63 2,321,567.68 | 100.00 1,711,666.67 | 609,901.01 | - |
| | BASS PRO ESCROW TRM B 09/25/24 C1 | 40,705,387.66 | 96.62 39,330,359.66 | 100.39 40,866,580.99 | 1,536,221.33 | - |
| | CAL RES 1LN 2ND OUT TERM 12/31/21 C1 | 20,460,000.00 | 108.37 22,173,525.00 | 112.31 22,979,239.80 | 805,714.80 | - |
| | CALIFORNIA TERM 1 1/4LN 12/31/22 C1 | 22,485,000.00 | 98.53 22,154,596.88 | 103.12 23,187,656.25 | 1,033,059.37 | - |
| | CCC INFO TERM B 1LN 03/24 C1 | 18,549,825.00 | 100.16 18,580,432.21 | 100.37 18,619,386.84 | 38,954.63 | - |
| | COINMACH TLB 1LN EXT 14/11/2022 C1 | 4,487,914.42 | 100.76 4,522,426.48 | 100.57 4,513,854.56 | 8,571.92 | - |
| | DELL SOFTWARE TERM B 10/31/22 C1 | 261,236.27 | 100.59 262,801.07 | 100.10 261,507.95 | 1,293.12 | - |
| | DELL SOFTWARE TERM B 10/31/22 C2 | 233,914.00 | 100.59 235,315.14 | 100.10 234,157.27 | 1,157.87 | - |
| | DELL SOFTWARE TERM B 10/31/22 C3 | 97,424.54 | 100.59 98,008.11 | 100.10 97,525.86 | 482.25 | - |
| | DELL SOFTWARE TERM B 10/31/22 C4 | 84,531.39 | 100.59 85,038.57 | 100.10 84,619.30 | 419.27 | - |
| | DELL SOFTWARE TERM B 10/31/22 C5 | 71,018.76 | 100.59 71,444.16 | 100.10 71,092.61 | 351.55 | - |
| | GAVILAN RESOURCES TRM 2LN 3/24 C1 | 8,090,000.00 | 98.12 7,938,312.50 | 97.75 7,907,975.00 | 30,337.50 | - |
| | INTELSAT TERM B-3 11/27/23 C1 | 55,455,000.00 | 99.22 55,025,778.30 | 100.41 55,684,029.15 | 658,250.85 | - |
| | INTRAWEST TERM B-1 1LN 07/31/24 C1 | 289,275.00 | 100.62 291,082.96 | 100.54 290,842.87 | 240.09 | - |
| | KINDERCARE TERM 2LN 08/22/2025 C1 | 13,635,000.00 | 100.00 13,635,000.00 | 101.25 13,805,437.50 | 170,437.50 | - |
| | KNOWLEDGE UNIV TERM B-1 8/13/22 C1 | 5,461,257.84 | 100.43 5,484,959.69 | 100.54 5,490,857.85 | 5,898.16 | - |
| | KNOWLEDGE UNIV TERM B-1 8/13/22 C2 | 1,897,246.67 | 100.43 1,905,518.66 | 100.54 1,907,529.74 | 2,011.08 | - |
| | KRONOS TERM B 1LN 11/01/23 C2 | 821,715.56 | 100.49 825,758.40 | 100.63 826,941.67 | 1,183.27 | - |
| | KRONOS TERM B 1LN 11/01/23 C3 | 2,059.44 | 100.49 2,069.57 | 100.63 2,072.53 | 2.96 | - |
| NUMERICABLE TERM B- 12 01/01/26 C1 | 24,770,525.00 | 98.42 24,379,398.41 | 98.37 24,368,003.96 | 11,394.45 | - | |
| PACIFIC DRILLING TERM B 6/3/18 C1 | 4,288,797.99 | 33.33 1,429,585.03 | 40.99 1,758,407.17 | 328,822.14 | - | |

| | | | | | |
|--|---------------|------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|
| PLY GEM HOLDINGS TRM B 4/12/25 C1 | 17,280,000.00 | 99.50 17,193,600.00 | 100.66 17,395,257.60 | 201,657.60 | - |
| RENAISSANCE LEARN TRM 2LN 4/22 C1 | 14,285,900.00 | 100.50 14,357,329.50 | 100.00 14,285,900.00 | 71,429.50 | - |
| RESTAURANT BRANDS TL B 2/17/24 C3 | 12,401,127.27 | 99.93 12,393,190.54 | 100.12 12,416,628.67 | 23,438.13 | - |
| RESTAURANT BRANDS TL B 2/17/24 C4 | 8,005,696.19 | 99.93 8,000,732.65 | 100.12 8,015,703.31 | 14,970.66 | - |
| SOUTHEASTERN GROC TERM B 5/24 | 22,800,000.00 | 96.00 21,888,000.00 | 97.00 22,116,000.00 | 228,000.00 | - |
| TOPS MRKTS TRM D/D UNFNDD 2/19 C1 | 4,068,296.70 | 100.00 4,068,296.70 | 100.00 4,068,296.70 | - | - |
| TOPS MRKTS TRM DIP FUNDED 02/23/19 C1 | 4,068,296.70 | 100.00 4,068,296.70 | 100.00 4,068,296.70 | - | - |
| TRANSDIGM TERM F INCR 06/09/23 C1 | 6,502,660.30 | 99.87 6,494,401.92 | 100.05 6,506,431.84 | 12,029.92 | - |
| TRANSDIGM TERM F INCR 06/09/23 C2 | 3,405,346.24 | 99.87 3,401,089.56 | 100.05 3,407,321.34 | 6,231.78 | - |
| TRONOX TERM B BLOCKED 09/22/24 C1 | 1,162,551.46 | 100.76 1,171,503.10 | 100.80 1,171,898.37 | 395.27 | - |
| TRONOX TERM B NEW 09/22/24 C1 | 2,682,811.04 | 100.76 2,703,468.68 | 100.80 2,704,380.84 | 912.16 | - |
| UBER TERM B INCR 4/4/25 C1 | 8,885,000.00 | 99.50 8,840,575.00 | 100.66 8,943,729.85 | 103,154.85 | - |
| US RENAL TERM B 1LN 12/31/22 C1 | 6,503,195.57 | 97.29 6,327,284.12 | 99.67 6,482,060.18 | 154,776.06 | - |
| USI TERM B INCR 05/16/24 | 2,537,250.00 | 99.74 2,530,881.50 | 100.06 2,538,848.46 | 7,966.96 | - |
| VALEANT PHARMA TRM B INCR 5/25 | 1,485,000.00 | 99.50 1,477,575.00 | 100.17 1,487,598.75 | 10,023.75 | - |
| WIDOPENWEST TERM B 08/19/23 C1 | 32,138,500.00 | 99.02 31,824,828.24 | 96.41 30,985,049.23 | 839,779.01 | - |
| 貸付債権 / アメリカ・ドル 小計 | | 367,867,229.74 (40,818,547,811) | 371,635,328.43 (41,236,656,043) | 3,768,098.69 (418,108,231) | |
| 貸付債権 合計 | | 40,818,547,811 (40,818,547,811) | 41,236,656,043 (41,236,656,043) | 418,108,231 (418,108,231) | |
| 合計 | | 40,818,547,811 (40,818,547,811) | 41,236,656,043 (41,236,656,043) | 418,108,231 (418,108,231) | |

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】

(2018年6月29日現在)

| 種 類 | 金 額 | 単 位 |
|-----------------|------------|-----|
| 資産総額 | 21,192,673 | 円 |
| 負債総額 | 63,488 | 円 |
| 純資産総額(-) | 21,129,185 | 円 |
| 発行済数量 | 21,539,802 | 口 |
| 1単位当たり純資産額(/) | 0.9809 | 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

(2018年6月29日現在)

| 種 類 | 金 額 | 単 位 |
|-----------------|-----------------|-----|
| 資産総額 | 829,574,121,026 | 円 |
| 負債総額 | 8,811,975,431 | 円 |
| 純資産総額(-) | 820,762,145,595 | 円 |
| 発行済数量 | 265,508,650,329 | 口 |
| 1単位当たり純資産額(/) | 3.0913 | 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（2017年9月末日現在）

（略）

<訂正後>

(1) 資本金等（2018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）

2017年9月29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161本、親投資信託56本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額4,776,393,031,570円です。

< 訂正後 >

（略）

2018年6月29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166本、親投資信託57本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,547,509,744,406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32期事業年度（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

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

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

| | 第31期 （平成29年3月31日） | 第32期 （平成30年3月31日） |
|------------|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | 881,556 | 975,413 |
| 立替金 | 85,308 | 72,930 |
| 前払費用 | 30,449 | 28,800 |
| 未収委託者報酬 | 5,342,216 | 5,464,066 |
| 未収収益 | 1,378,266 | 1,921,861 |
| 未収入金 | * 1 286,806 | 365,790 |
| 繰延税金資産 | 453,542 | 607,573 |
| 流動資産計 | 8,458,145 | 9,436,436 |
| 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 21,722,618 | 22,863,900 |
| 長期差入保証金 | 15,558 | 17,804 |
| 繰延税金資産 | 796,264 | 778,438 |
| その他 | 230 | 230 |
| 投資その他の資産合計 | 22,534,671 | 23,660,373 |
| 固定資産計 | 22,542,158 | 23,667,860 |
| 資産合計 | 31,000,304 | 33,104,296 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 141,925 | 103,438 |
| 未払金 | * 1 | |
| 未払手数料 | 2,371,159 | 2,425,583 |
| その他未払金 | 2,767,150 | 2,622,149 |
| 未払費用 | 568,610 | 551,982 |
| 未払法人税等 | 36,838 | 193,363 |
| 未払消費税等 | 466,813 | 291,148 |
| 賞与引当金 | 1,703,603 | 1,858,394 |
| その他流動負債 | 1,467 | 931 |
| 流動負債合計 | 8,057,569 | 8,046,992 |
| 固定負債 | | |
| 長期賞与引当金 | 194,809 | 239,904 |
| 退職給付引当金 | 5,094,290 | 4,786,190 |
| 固定負債合計 | 5,289,099 | 5,026,094 |
| 負債合計 | 13,346,669 | 13,073,087 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 1,000,000 | 1,000,000 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 100,000 | 100,000 |
| その他利益剰余金 | | |
| 繰越利益剰余金 | 16,553,634 | 18,931,208 |
| 利益剰余金合計 | 16,653,634 | 19,031,208 |
| 株主資本合計 | 17,653,634 | 20,031,208 |
| 純資産合計 | 17,653,634 | 20,031,208 |
| 負債・純資産合計 | 31,000,304 | 33,104,296 |

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

| | 第31期 （自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日） | 第32期 （自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日） |
|--------------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 47,434,300 | 47,015,140 |
| その他営業収益 | 3,825,412 | 4,392,629 |
| 営業収益計 | 51,259,712 | 51,407,769 |
| 営業費用 | * 1 | |
| 支払手数料 | 22,288,152 | 22,128,840 |
| 広告宣伝費 | 672,366 | 493,950 |
| 調査費 | | |
| 調査費 | 460,109 | 487,993 |
| 委託調査費 | 10,233,243 | 10,160,657 |
| 営業雑経費 | | |
| 通信費 | 56,369 | 50,195 |
| 印刷費 | 151,589 | 117,152 |
| 協会費 | 35,216 | 35,503 |
| 諸会費 | 1,100 | 1,555 |
| 営業費用計 | 33,898,147 | 33,475,849 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | | |
| 給料・手当 | 2,735,513 | 2,529,490 |
| 賞与 | 1,993,857 | 2,272,929 |
| 福利厚生費 | 587,661 | 593,981 |
| 交際費 | 28,792 | 27,478 |
| 旅費交通費 | 170,657 | 176,209 |
| 租税公課 | 132,592 | 129,039 |
| 弁護士報酬 | 14,000 | 15,719 |
| 不動産賃貸料・共益費 | 568,831 | 602,626 |
| 支払ロイヤリティ | 1,414,418 | 1,033,326 |
| 退職給付費用 | 294,160 | 201,666 |
| 消耗器具備品費 | 21,484 | 5,733 |
| 事務委託費 | 5,550,653 | 6,503,327 |
| 諸経費 | 359,514 | 322,446 |
| 一般管理費計 | 13,872,137 | 14,413,974 |
| 営業利益 | 3,489,427 | 3,517,944 |
| 営業外収益 | | |
| 受取利息 | * 1 | |
| 受取利息 | 118,872 | 122,290 |
| 保険配当金 | 14,367 | 8,991 |
| 受取配当金 | 130 | - |
| 為替差益 | 30,178 | 86,339 |
| 雑益 | 3,442 | 4,534 |
| 営業外収益計 | 166,991 | 222,156 |
| 営業外費用 | | |
| 寄付金 | 300 | - |
| 為替差損 | - | - |
| 営業外費用計 | 300 | - |
| 経常利益 | 3,656,118 | 3,740,101 |
| 特別利益 | | |
| 投資有価証券売却益 | 148,786 | - |
| 特別利益計 | 148,786 | - |
| 特別損失 | | |
| 特別退職金 | 225,526 | 285,710 |
| 事務過誤損失 | 9 | 596 |
| 特別損失計 | 225,535 | 286,306 |
| 税引前当期純利益 | 3,579,369 | 3,453,794 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 799,824 | 1,212,425 |
| 法人税等調整額 | (769,601) | (136,204) |
| 法人税等合計 | 30,223 | 1,076,221 |
| 当期純利益 | 3,549,146 | 2,377,574 |

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

第31期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | 株主資本合計 |
|-------------------------|-----------|---------|---------------------|------------|------------|
| | 資本金 | 利益準備金 | 利益剰余金 | | |
| | | | その他利益剰余金 繰越利益剰余金 | 利益剰余金合計 | |
| 当期首残高 | 1,000,000 | 100,000 | 13,004,488 | 13,104,488 | 14,104,488 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 当期純利益 | - | - | 3,549,146 | 3,549,146 | 3,549,146 |
| 株主資本以外の項目 の当期変動額(純額) | - | - | - | - | - |
| 当期変動額合計 | - | - | 3,549,146 | 3,549,146 | 3,549,146 |
| 当期末残高 | 1,000,000 | 100,000 | 16,553,634 | 16,653,634 | 17,653,634 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-------------------------|------------------|----------------|------------|
| | その他有価証券 評価差額金 | 評価・換算差額等 合計 | |
| 当期首残高 | 125,824 | 125,824 | 14,230,313 |
| 当期変動額 | | | |
| 当期純利益 | - | - | 3,549,146 |
| 株主資本以外の項目 の当期変動額(純額) | 125,824 | 125,824 | 125,824 |
| 当期変動額合計 | 125,824 | 125,824 | 3,423,322 |
| 当期末残高 | - | - | 17,653,634 |

第32期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | 株主資本合計 |
|-------------------------|-----------|---------|---------------------|------------|------------|
| | 資本金 | 利益準備金 | 利益剰余金 | | |
| | | | その他利益剰余金 繰越利益剰余金 | 利益剰余金合計 | |
| 当期首残高 | 1,000,000 | 100,000 | 16,553,634 | 16,653,634 | 17,653,634 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 当期純利益 | - | - | 2,377,574 | 2,377,574 | 2,377,574 |
| 株主資本以外の項目 の当期変動額(純額) | - | - | - | - | - |
| 当期変動額合計 | - | - | 2,377,574 | 2,377,574 | 2,377,574 |
| 当期末残高 | 1,000,000 | 100,000 | 18,931,208 | 19,031,208 | 20,031,208 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-------------------------|------------------|----------------|------------|
| | その他有価証券 評価差額金 | 評価・換算差額等 合計 | |
| 当期首残高 | - | - | 17,653,634 |
| 当期変動額 | | | |
| 当期純利益 | - | - | 2,377,574 |
| 株主資本以外の項目 の当期変動額(純額) | - | - | - |
| 当期変動額合計 | - | - | 2,377,574 |
| 当期末残高 | - | - | 20,031,208 |

重要な会計方針

1. 資産の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法を採用しております。

2. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当期末において発生していると認められる額を計上しております。退職給付見込額を当期までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。過去勤務債務については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による按分額を定額法により費用処理しております。数理計算上の差異については、発生年度に全額費用処理しております。

(3) 賞与引当金、長期賞与引当金

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

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(未適用の会計基準等)

第32期

自 平成29年4月1日

至 平成30年3月31日

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）

「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

平成34年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

*1 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。

| | 第31期 (平成29年3月31日) | 第32期 (平成30年3月31日) |
|--------|----------------------|----------------------|
| 未収入金 | 153,988 千円 | 75,889 千円 |
| その他未払金 | 2,076,244 千円 | 2,274,334 千円 |
| 長期貸付金 | 20,030,000 千円 | 21,400,000 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31期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日) | 第32期 (自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日) |
|------|--|--|
| 営業費用 | 12,599,807 千円 | 13,524,345 千円 |
| 受取利息 | 48,779 千円 | 57,463 千円 |

（株主資本等変動計算書関係）

第31期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

第32期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

（リース取引関係）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

預金に係る銀行の信用リスクに関しては、口座開設時及びその後も継続的に銀行の信用力を評価し、格付けの高い金融機関でのみで運用し、預金に係る信用リスクを管理しております。未収委託者報酬及び未収収益は、投資信託または取引相手ごとに残高を管理し、当社が運用している資産の中から報酬を徴収するため、信用リスクは僅少であります。また、未収入金は、概ね、海外の関連会社との取引により生じたものであり、原則、翌月中に決済が行われる事により、回収が不能となるリスクは僅少であります。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

第31期（平成29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 | 881,556 | 881,556 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 5,342,216 | 5,342,216 | - |
| (3) 未収入金 | 286,806 | 286,806 | - |
| (4) 長期貸付金 | 21,722,618 | 21,722,618 | - |
| 資産計 | 28,233,196 | 28,233,196 | - |
| (1) 未払手数料 | 2,371,159 | 2,371,159 | - |
| (2) その他未払金 | 2,767,150 | 2,767,150 | - |
| 負債計 | 5,138,309 | 5,138,309 | - |

第32期（平成30年3月31日）

| | 貸借対照表計上額 (千円) | 時価 (千円) | 差額 (千円) |
|-------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金及び預金 | 975,413 | 975,413 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 5,464,066 | 5,464,066 | - |
| (3) 未収収益 | 1,921,861 | 1,921,861 | - |
| (4) 未収入金 | 365,790 | 365,790 | - |
| (5) 長期貸付金 | 22,863,900 | 22,863,900 | - |
| 資産計 | 31,591,030 | 31,591,030 | - |
| (1) 未払手数料 | 2,425,583 | 2,425,583 | - |
| (2) その他未払金 | 2,622,149 | 2,622,149 | - |
| 負債計 | 5,047,732 | 5,047,732 | - |

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法に関する事項

第31期（平成29年3月31日）

資 産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収入金

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

(4) 長期貸付金

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金

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

第32期(平成30年3月31日)

資 産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、(4) 未収入金

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

(5) 長期貸付金

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金

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

(注) 2. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期(平成29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 | 881,556 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 5,342,216 | - | - | - |
| 未収入金 | 286,806 | - | - | - |
| 合計 | 6,510,579 | - | - | - |

金銭債権のうち長期貸付金(21,722,618千円)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32期(平成30年3月31日)

| | 1年以内 (千円) | 1年超5年以内 (千円) | 5年超10年以内 (千円) | 10年超 (千円) |
|---------|--------------|-----------------|------------------|--------------|
| 現金及び預金 | 975,413 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 5,464,066 | - | - | - |
| 未収収益 | 1,921,861 | - | - | - |
| 未収入金 | 365,790 | - | - | - |
| 合計 | 8,727,132 | - | - | - |

金銭債権のうち長期貸付金(22,863,900千円)については、契約上返済期限の定めがないため、上記に含めておりません。

(有価証券関係)

第31期(平成29年3月31日)

1. その他有価証券
該当事項はありません。

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

| 売却額(千円) | 売却益の合計(千円) | 売却損の合計(千円) |
|---------|------------|------------|
| 322,623 | 148,786 | - |

第32期(平成30年3月31日)

1. その他有価証券
該当事項はありません。
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(退職給付関係)

第31期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は確定給付型年金制度及び確定拠出型年金制度を採用しております。

2. 確定給付型年金制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

| | (千円) |
|--------------------|------------------|
| 退職給付債務の期首残高 | 5,434,582 |
| 勤務費用 | 211,876 |
| 利息費用 | 9,092 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 13,576 |
| 退職給付の支払額 | 532,305 |
| 制度改定による変動額 | - |
| 為替変動による影響額 | 51,769 |
| その他 | 3,080 |
| <u>退職給付債務の期末残高</u> | <u>5,081,972</u> |

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

| | (千円) |
|----------------------------|------------------|
| 非積立型制度の退職給付債務 | 5,081,972 |
| 未認識過去勤務費用 | 12,318 |
| <u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u> | <u>5,094,290</u> |
| <u>退職給付引当金</u> | <u>5,094,290</u> |
| <u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u> | <u>5,094,290</u> |

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

| | (千円) |
|---------------------------|----------------|
| 勤務費用 | 211,876 |
| 利息費用 | 9,092 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 13,576 |
| 過去勤務債務の費用処理額 | 3,045 |
| <u>確定給付型年金制度に係る退職給付費用</u> | <u>231,499</u> |

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は97,624千円であります。

第32期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は確定給付型年金制度及び確定拠出型年金制度を採用しております。

2. 確定給付型年金制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

| | (千円) |
|--------------------|------------------|
| 退職給付債務の期首残高 | 5,081,972 |
| 勤務費用 | 195,462 |
| 利息費用 | 10,317 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 59,517 |
| 退職給付の支払額 | 315,132 |
| 制度改定による変動額 | - |
| 為替変動による影響額 | 130,690 |
| その他 | 5,965 |
| <u>退職給付債務の期末残高</u> | <u>4,776,447</u> |

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

| | (千円) |
|----------------------------|------------------|
| 非積立型制度の退職給付債務 | 4,776,447 |
| 未認識過去勤務費用 | 9,743 |
| <u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u> | <u>4,786,190</u> |
| <u>退職給付引当金</u> | <u>4,786,190</u> |
| <u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u> | <u>4,786,190</u> |

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

| | (千円) |
|---------------------------|----------------|
| 勤務費用 | 195,462 |
| 利息費用 | 10,317 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 59,517 |
| 過去勤務債務の費用処理額 | 2,575 |
| <u>確定給付型年金制度に係る退職給付費用</u> | <u>143,687</u> |

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は90,790千円であります。

(ストック・オプション等関係)

該当事項はありません。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

| | 第31期 (平成29年3月31日) | 第32期 (平成30年3月31日) |
|----------------------|----------------------|----------------------|
| (流動) | (千円) | (千円) |
| 繰延税金資産 | | |
| 未払費用 | 178,920 | 186,465 |
| 賞与引当金 | 518,171 | 561,152 |
| その他 | 28,302 | 62,704 |
| 繰延税金資産合計 | 725,393 | 810,321 |
| 繰延税金負債 | | |
| 未払金 | 271,851 | 202,748 |
| 繰延税金資産又は繰延税金負債()の純額 | 453,542 | 607,573 |
| (固定) | (千円) | (千円) |
| 繰延税金資産 | | |
| 退職給付引当金 | 1,567,372 | 1,473,419 |
| 資産除去債務 | 2,685 | 2,685 |
| その他 | 69,626 | 81,708 |
| 繰延税金資産小計 | 1,639,683 | 1,557,812 |
| 評価性引当額 | 806,442 | 765,291 |
| 繰延税金資産合計 | 833,241 | 792,521 |
| 繰延税金負債 | | |
| 長期貸付金 | 36,976 | 14,084 |
| 繰延税金資産又は繰延税金負債()の純額 | 796,264 | 778,437 |

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31期 (平成29年3月31日) | 第32期 (平成30年3月31日) |
|--------------------|----------------------|----------------------|
| 法定実効税率 | 30.86% | 30.62% |
| (調整) | | |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 1.67% | 1.32% |
| 評価性引当額 | 31.49% | 1.47% |
| 過年度法人税等 | 0.08% | 0.27% |
| 税率変更差異 | 0.00% | 0.00% |
| その他 | 0.12% | 0.42% |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 0.84% | 31.16% |

(持分法損益等)

該当事項はありません。

（企業結合等関係）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

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

（賃貸等不動産関係）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

第31期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）及び第32期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第31期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. サービスごとの情報

（単位：千円）

| | 投資信託の運用 | 投資顧問業 | 合計 |
|-----------|------------|-----------|------------|
| 外部顧客への売上高 | 47,434,300 | 2,071,319 | 49,505,619 |

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

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

3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

| 投資信託の名称 | 委託者報酬 | 関連するサービスの種類 |
|------------------------------|------------|-------------|
| フィデリティ・US リート・ファンドB（為替ヘッジなし） | 18,437,379 | 投資信託の運用 |
| フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド | 12,375,032 | 投資信託の運用 |
| フィデリティ・日本成長株・ファンド | 4,758,201 | 投資信託の運用 |

第32期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

1. サービスごとの情報

（単位：千円）

| | 投資信託の運用 | 投資顧問業 | 合計 |
|-----------|------------|-----------|------------|
| 外部顧客への売上高 | 47,015,140 | 2,583,082 | 49,598,222 |

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

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

3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

| 投資信託の名称 | 委託者報酬 | 関連するサービスの種類 |
|------------------------------|------------|-------------|
| フィデリティ・US リート・ファンドB（為替ヘッジなし） | 14,973,284 | 投資信託の運用 |
| フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド | 13,887,634 | 投資信託の運用 |
| フィデリティ・日本成長株・ファンド | 5,377,121 | 投資信託の運用 |

関連当事者情報

第31期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社

| 種類 | 会社等の名称 | 会社等の所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有（被所有）割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（注2） | 科目 | 期末残高（注2） |
|-----|--|---------------------------------|---------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|-----------------------|---------------------|-----------|----------------------|
| 親会社 | FIL Limited | 英領バ ミュー ダ、ベン ブローク 市 | 千米ドル 6,981 | 投資 顧問業 | 被所有 間接 100 % | 投資顧問契 約の再委任 等役員の兼 任 | 委託調査 等報酬 （注3） | 千円 148,301 | 未収入金 | 千円 50,544 |
| | | | | | | | 共通発生 経費負担額 （注4） | 9,369,491 | 未払金 | 774,378 |
| 親会社 | フィデリ ティ・ジャ パン・ホー ルディン グス株式 会社 | 東京都 港区 | 千円 4,510,000 | グループ 会社経営 管理 | 被所有 直接 100 % | 当社事業 活動の管 理等役員 の兼任 | 金銭の貸付 （注1） | 千円 3,790,000 | 長期 貸付金 | 千円 20,030,000 |
| | | | | | | | 利息の受取 （注1） | 48,780 | 未収入金 | 15,988 |
| | | | | | | | 共通発生 経費負担額 （注4） | 275,171 | 未払金 | 135,607 |
| | | | | | | | 連結法人税の 個別帰属額 | - | 未払金 | 588,819 |
| | | | | | | 固定資産の 譲渡 | 1,363,103 | 未払金 | - | |
| 親会社 | FIL Asia Holdings Pte. Limited | シンガ ポール、 ブルバ ード市 | 千米ドル 215,735 | 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 2,837,501 | 未払金 | 千円 410,638 |

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

| 属性 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の 所有(被所 有)割合 | 関連当事者 との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (注2) | 科目 | 期末残高 (注2) |
|-------------------------|---|------------------------------|-----------|-------------|------------------------|-----------------------------|-----------------------|--------------|-----|--------------|
| 同一の 親会社 をもつ 会社 | フィデリティ 証券株式会社 | 東京都 港区 | 千円 | 証券業 | なし | 当社設定 投資信託 の募集・ 販売 | 共通発生 経費負担額 (注4) | 千円 | 未払金 | 千円 |
| | | | 8,157,500 | | | | 752,870 | 46,354 | | |
| 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 | 証券投資 顧問業 | なし | 当社事業 活動への サービス の提供 | 共通発生 経費負担額 (注4) | 千円 | 未払金 | 千円 |
| | | | 22,897 | | | | 930,544 | 91,375 | | |
| 同一の 親会社 をもつ 会社 | FIL (Luxembourg) S.A. | ルクセン ブルグ、 ルクセン ブルグ市 | 千米ドル | 証券投資 顧問業 | なし | 商標使用 契約 | ロイヤリティ の支払 | 千円 | 未払金 | 千円 |
| | | | 1,622 | | | | 1,414,418 | 282,976 | | |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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

第32期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社

| 種類 | 会社等の名称 | 会社等の所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有（被所有）割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（注2） | 科目 | 期末残高（注2） |
|-----|--|---------------------------------|---------------------|--------------------|--------------------|------------------------------|-----------------------|---------------------|-----------|----------------------|
| 親会社 | FIL Limited | 英領バ ミュー ダ、ベン ブローク 市 | 千米ドル 6,825 | 投資 顧問業 | 被所有 間接 100 % | 投資顧問契 約の再委任 等役員の兼 任 | 委託調査 等報酬 （注3） | 千円 41,611 | 未収入金 | 千円 55,710 |
| | | | | | | | 共通発生 経費負担額 （注4） | 9,313,596 | 未払金 | 565,117 |
| 親会社 | フィデリ ティ・ジャ パン・ホー ルディン グス株式 会社 | 東京都 港区 | 千円 4,510,000 | グループ 会社経営 管理 | 被所有 直接 100 % | 当社事業 活動の管 理等役員 の兼任 | 金銭の貸付 （注1） | 千円 1,370,000 | 長期 貸付金 | 千円 21,400,000 |
| | | | | | | | 利息の受取 （注1） | 57,463 | 未収入金 | 20,178 |
| | | | | | | | 共通発生 経費負担額 （注4） | 525,884 | 未払金 | 100,806 |
| | | | | | | | 連結法人税の 個別帰属額 | - | 未払金 | 926,608 |
| 親会社 | FIL Asia Holdings Pte. Limited | シンガ ポール、 ブルバ ード市 | 千米ドル 189,735 | グループ 会社経営 管理 | 被所有 間接 100% | 営業取引 | 共通発生 経費負担額 （注4） | 千円 3,456,684 | 未払金 | 千円 681,294 |

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

| 属性 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有（被所有）割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（注2） | 科目 | 期末残高（注2） |
|-------------|---|------------------|-----------------|---------|----------------|-----------------|-------------------------------------|----------------------------|-------------|------------------------|
| 同一の親会社をもつ会社 | フィデリティ証券株式会社 | 東京都港区 | 千円 8,557,500 | 証券業 | なし | 当社設定投資信託の募集・販売 | 共通発生経費負担額（注4） 投資信託販売に係る代行手数料（注5） | 千円 648,819 1,046,990 | 未収入金 未払金 | 千円 9,821 206,260 |
| 同一の親会社をもつ会社 | FIL Investment Management (Hong Kong) Limited | 香港、セントラル市 | 千米ドル 22,897 | 証券投資顧問業 | なし | 当社事業活動へのサービスの提供 | 共通発生経費負担額（注4） | 千円 1,025,434 | 未払金 | 千円 60,135 |
| 同一の親会社をもつ会社 | FIL (Luxembourg) S.A. | ルクセンブルグ、ルクセンブルグ市 | 千米ドル 1,676 | 証券投資顧問業 | なし | 商標使用契約 | ロイヤリティの支払 | 千円 1,033,326 | 未払金 | 千円 29,993 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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

(1株当たり情報)

| | 第31期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日) | 第32期 (自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日) |
|------------|--|--|
| 1株当たり純資産額 | 882,681円74銭 | 1,001,560円45銭 |
| 1株当たり当期純利益 | 177,457円33銭 | 118,878円71銭 |

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

2. 1株当たり当期純損失金額又は1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| 項目 | 第31期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日) | 第32期 (自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日) |
|------------------|--|--|
| 当期純利益(千円) | 3,549,146 | 2,377,574 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益(千円) | 3,549,146 | 2,377,574 |
| 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 (2018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 | フィデリティ証券株式会社 | 8,557百万円 | 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。 |
| | 株式会社SBI証券 | 48,323百万円 | |
| | 楽天証券株式会社 | 7,495百万円 | |
| | 西日本シティTT証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| 運用の委託先 | フィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニー | 7,950米ドル (約0.89百万円 [*]) [*] 1米ドル113.00円で換算 (2017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。 |

独立監査人の監査報告書

平成30年7月4日

フィデリティ投信株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているフィデリティ・USハイ・イールド・ファンド（資産成長型）（為替ヘッジあり）の平成29年11月24日から平成30年5月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド（資産成長型）（為替ヘッジあり）の平成30年5月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2． XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成30年6月15日

フィデリティ投信株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているフィデリティ投信株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ投信株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。