

【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】	2020年3月9日提出
【発行者名】	フィデリティ投信株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 デレック・ヤング
【本店の所在の場所】	東京都港区六本木七丁目7番7号
【事務連絡者氏名】	照沼 加奈子
【電話番号】	03 - 4560 - 6000
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】	フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Aコース（ダイワ投資 一任専用） フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Bコース（ダイワ投資 一任専用）
【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】	各ファンドにつき1兆円を上限とします。
【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、半期報告書を提出致しましたので、2019年9月11日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するとともに、その他の情報について訂正すべき事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

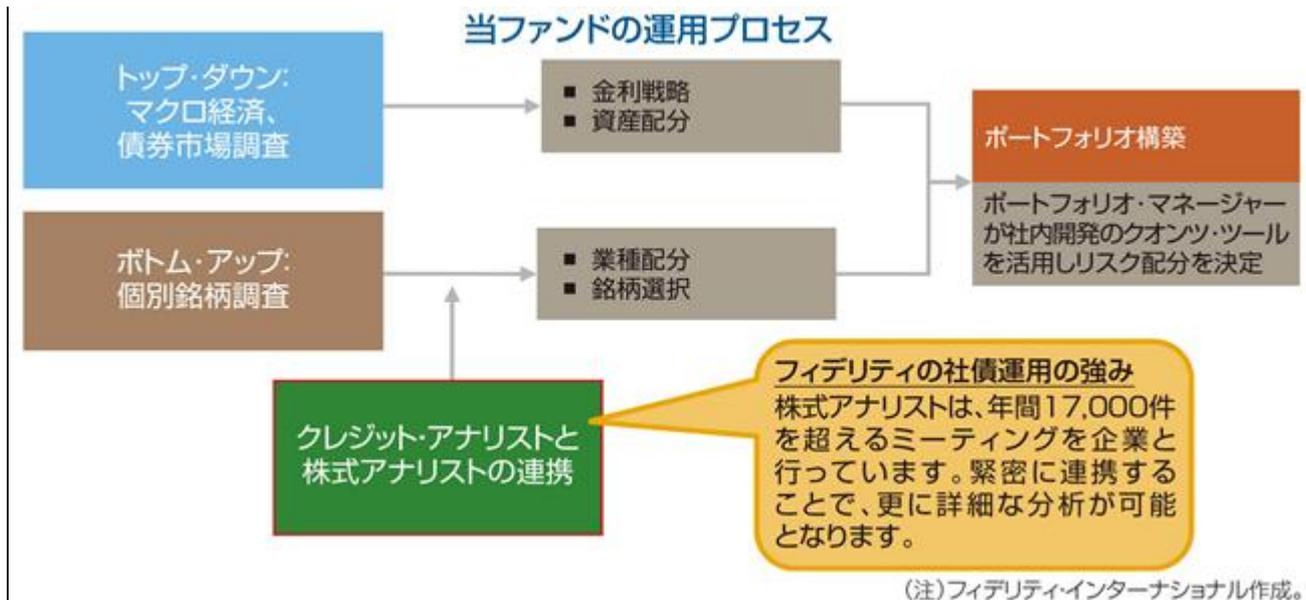
（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

（略）

ファンドの特色

（略）



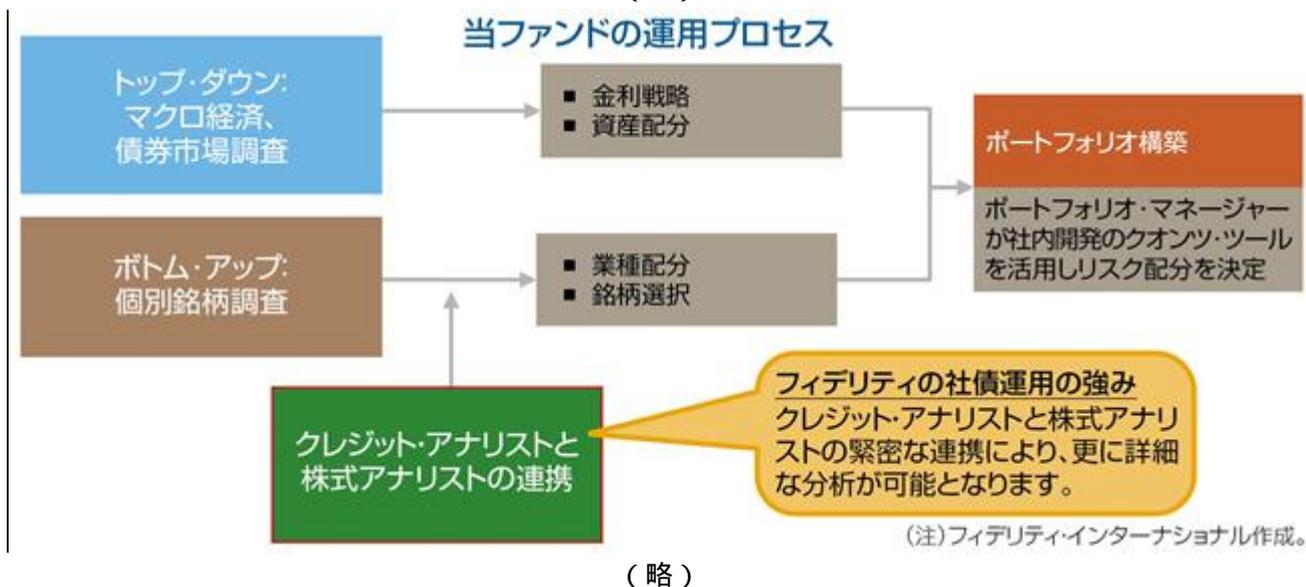
（略）

<訂正後>

（略）

ファンドの特色

（略）



（略）

(3) 【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社およびファンドの関係法人

(略)

(d) 運用の委託先

(略)

(参考)

FILインベストメンツ・インターナショナルおよびフィデリティ投信株式会社は、FILリミテッドの実質的な子会社です。FILリミテッドは世界有数の資産運用会社として、アジア太平洋、欧州、中近東、南アメリカの25を超える国および地域において、投資家向けにさまざまなアセットクラスを網羅する投資商品や、リタイアメント・ソリューションを提供しています。

(略)

委託会社の概況（2019年7月末日現在）

(略)

<訂正後>

(略)

委託会社およびファンドの関係法人

(略)

(d) 運用の委託先

(略)

(参考)

FILインベストメンツ・インターナショナルおよびフィデリティ投信株式会社は、FILリミテッドの実質的な子会社です。FILリミテッドは世界有数の資産運用会社として、アジア太平洋、欧州、中近東、南アメリカにおいて、投資家向けにさまざまなアセットクラスを網羅する投資商品や、リタイアメント・ソリューションを提供しています。

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

(略)

委託会社の概況（2020年1月末日現在）

（略）

2【投資方針】

（3）【運用体制】

<訂正前>

（略）

上記「（3）運用体制」の内容は、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

（略）

上記「（3）運用体制」の内容は、今後変更となる場合があります。

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

3【投資リスク】

<訂正前>

（略）

(2) 投資リスクの管理体制

（略）

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

（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2016年9月26日に設定されたため、2017年9月～2019年7月の期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

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

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

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2016年9月26日に設定されたため2017年9月～2019年7月の期間、他の代表的な資産クラスについては2014年8月～2019年7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。
※ファンドは税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

【代表的な資産クラスの指数】

日本株	TOPIX (配当込)	東証株価指数 (TOPIX) は、株式会社東京証券取引所 (東東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) の商標に関するすべての権利は東東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東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、東東京証券取引所は、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、野村証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証券に帰属します。なお、野村証券株式会社は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。

<訂正後>

（略）

(2) 投資リスクの管理体制

（略）

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

投資リスクの管理体制は変更となる場合がありますが、ファンドの基本的なリスクの管理体制が変更されるものではありません。

（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2016年9月26日に設定されたため、2017年9月～2020年1月の期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

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

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

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2016年9月26日に設定されたため2017年9月～2020年1月の期間、他の代表的な資産クラスについては2015年2月～2020年1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。

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

[代表的な資産クラスの指数]

日本株	TOPIX (配当込)	東証株価指数 (TOPIX) は、株式会社東京証券取引所 (株東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) の商標に関するすべての権利は東証東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東証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、東証東京証券取引所は、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、野村証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証券に帰属します。なお、野村証券株式会社はNOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて運用される当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円ベース)	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。当指数の著作権はジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属しております。

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

4【手数料等及び税金】

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

信託報酬(消費税等相当額を含みます。)の総額は、計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年0.5454%^{*}(税抜0.505%)の率を乗じて得た額とします。

* 消費税率が10%となった場合は、年率0.5555%となります。

(略)

<訂正後>

信託報酬(消費税等相当額を含みます。)の総額は、計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年0.5555%(税抜0.505%)の率を乗じて得た額とします。

(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、2019年7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)

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記「(5)課税上の取扱い」の記載は、2020年1月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更となる場合があります。

(略)

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

Aコース（ダイワ投資一任専用）

（2020年1月31日現在）

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	3,393,812,924	100.06
預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,904,898	0.06
合計（純資産総額）		3,391,908,026	100.00

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

その他資産の投資状況

（2020年1月31日現在）

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引（売建）	日本	3,265,231,090	96.27

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

Bコース（ダイワ投資一任専用）

（2020年1月31日現在）

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	869,795,558	100.07
預金・その他の資産（負債控除後）	-	651,538	0.07
合計（純資産総額）		869,144,020	100.00

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

(参考) マザーファンドの投資状況

フィデリティ・外国債券・マザーファンド

(2020年1月31日現在)

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	5,212,588,765	30.12
	ドイツ	1,370,886,462	7.92
	ノルウェー	1,215,835,195	7.02
	イタリア	689,356,954	3.98
	カナダ	621,260,244	3.59
	中国	520,371,747	3.01
	韓国	464,746,709	2.69
	イギリス	366,306,157	2.12
	オーストラリア	185,937,794	1.07
	インドネシア	82,993,382	0.48
	ポーランド	28,118,911	0.16
	小計	10,758,402,320	62.16
地方債証券	オランダ	92,613,926	0.54
	小計	92,613,926	0.54
特殊債券	アメリカ	1,043,669,736	6.03
	メキシコ	108,950,395	0.63
	インドネシア	94,077,228	0.54
	小計	1,246,697,359	7.20
社債券	アメリカ	2,708,347,170	15.65
	オランダ	458,113,823	2.65
	デンマーク	217,225,062	1.26
	サウジアラビア	110,945,211	0.64
	アイルランド	109,346,828	0.63
	ドイツ	95,661,116	0.55
	イタリア	78,586,010	0.45
	イギリス	71,810,683	0.41
	ルクセンブルグ	43,851,094	0.25
	小計	3,893,886,997	22.50
預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,316,795,262	7.61
合計（純資産総額）		17,308,395,864	100.00

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

その他資産の投資状況

（2020年1月31日現在）

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引（買建）	日本	5,115,609,351	29.56
為替予約取引（売建）	日本	5,096,085,545	29.44
債券先物取引（買建）	アメリカ	1,052,904,432	6.08
	ドイツ	525,019,275	3.03
	イギリス	327,230,876	1.89
債券先物取引（売建）	ドイツ	417,724,908	2.41

（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）先物取引の時価については、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

Aコース（ダイワ投資一任専用）

（2020年1月31日現在）

順位	種類	銘柄名	国・地域	数量 (口数)	帳簿価 額単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	親投資 信託受 益証券	フィデリティ・外 国債券・マザー ファンド	日本	1,395,711,846	2.3460	3,274,385,457	2.4316	3,393,812,924	100.06

Bコース（ダイワ投資一任専用）

（2020年1月31日現在）

順位	種類	銘柄名	国・地域	数量 (口数)	帳簿価 額単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	親投資 信託受 益証券	フィデリティ・外 国債券・マザー ファンド	日本	357,705,033	2.3445	838,642,406	2.4316	869,795,558	100.07

種類別投資比率

Aコース（ダイワ投資一任専用）

（2020年1月31日現在）

種 類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.06

Bコース（ダイワ投資一任専用）

（2020年1月31日現在）

種 類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.07

（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・外国債券・マザーファンド

（2020年1月31日現在）

順位	銘柄名	通貨 地域	種 類	数 量	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 時価金額(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率 (%)
1	USTN 1.75% 11/15/29	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	9,909,000	10,888.95 1,078,986,884	11,075.48 1,097,469,237	1.750 2029/11/15	6.34
2	USTN 2.875% 11/15/21	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	8,050,000	11,087.14 892,514,854	11,179.41 899,942,780	2.875 2021/11/15	5.20
3	NORWAY GOVERNMENT BOND 2% 04/2	ノルウェー・ク ロネ ノルウェー	国債証券	59,450,000	1,228.15 730,137,078	1,249.09 742,582,197	2.000 2028/04/26	4.29
4	CANADA GOVT 2% 11/01/20	カナダ・ドル カナダ	国債証券	7,500,000	8,306.07 622,955,442	8,283.47 621,260,244	2.000 2020/11/01	3.59
5	USTN 1.5% 10/31/24	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,885,000	10,831.70 529,128,650	10,954.53 535,128,873	1.500 2024/10/31	3.09
6	UNITED STATES TREASURY BOND 2.	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,195,000	10,952.87 459,473,310	11,393.72 477,966,399	2.250 2049/08/15	2.76
7	GERMANY GOVT 0% 08/15/29 RGS	ユーロ ドイツ	国債証券	3,600,000	12,393.09 446,151,521	12,543.20 451,555,192	0.000 2029/08/15	2.61
8	UMBS 30YR 4% 02/50 #TBA	アメリカ・ドル アメリカ	特殊債券	3,700,000	11,357.57 420,230,333	11,385.65 421,268,897	4.000 2050/02/01	2.43
9	USTN 1.5% 08/31/21	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	3,740,000	10,891.32 407,335,606	10,911.02 408,072,026	1.500 2021/08/31	2.36
10	GNII II 3.5% 02/50 #TBA	アメリカ・ドル アメリカ	特殊債券	3,500,000	11,255.75 393,951,558	11,240.81 393,428,497	3.500 2050/02/01	2.27
11	GERMANY GOVT 0% 08/15/50	ユーロ ドイツ	国債証券	2,740,000	11,641.06 318,965,140	11,676.68 319,941,001	0.000 2050/08/15	1.85
12	USTN 1.75% 12/31/24	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	2,720,000	10,985.68 298,810,697	11,086.60 301,555,611	1.750 2024/12/31	1.74
13	KOREA REPUBLIC OF 2.625% 06/10	韓国・ウォン 韓国	国債証券	2,901,750,000	9.89 287,183,193	9.94 288,289,187	2.625 2028/06/10	1.67

14	NORWAY GOVT 1.75% 2/17/27	ノルウェー・ク ローネ ノルウェー	国債証券	20,450,000	1,197.52 244,894,426	1,222.31 249,962,280	1.750 2027/02/17	1.44
15	BTP 2.1% 07/15/26	ユーロ イタリア	国債証券	1,850,000	12,981.78 240,163,010	13,232.64 244,803,823	2.100 2026/07/15	1.41
16	GERMANY FED REPUBLIC 0.5% 2/25	ユーロ ドイツ	国債証券	1,905,000	12,695.13 241,842,271	12,733.15 242,566,574	0.500 2025/02/15	1.40
17	CHINA PEOPLE RE OF 2.94% 10/24	オフショア・人民 元 中国	国債証券	15,300,000	1,562.22 239,019,669	1,572.94 240,659,924	2.940 2024/10/17	1.39
18	WELLS FARGO BA 3ML+65 09/09/22	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	2,000,000	10,906.00 218,120,000	10,935.23 218,704,561	2.082 2022/09/09	1.26
19	USTN 2.5% 12/31/20	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	1,950,000	11,001.00 214,519,529	10,999.68 214,493,809	2.500 2020/12/31	1.24
20	AUS 2.75% 11/21/29 REGS	オーストラリア・ ドル オーストラリア	国債証券	2,174,000	8,377.79 182,133,365	8,552.80 185,937,794	2.750 2029/11/21	1.07
21	USTN 2% 05/31/24	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	1,610,000	10,997.90 177,066,225	11,181.59 180,023,673	2.000 2024/05/31	1.04
22	GERMANY GOVT 0.25% 8/15/28 RGS	ユーロ ドイツ	国債証券	1,390,000	12,709.31 176,659,491	12,820.25 178,201,484	0.250 2028/08/15	1.03
23	KOREA REPUBLIC OF 2.25% 06/10/25	韓国・ウォン 韓国	国債証券	1,850,000,000	9.33 172,719,274	9.54 176,457,521	2.250 2025/06/10	1.02
24	ITALY GOVT I/L 1.25% 9/32 144A	ユーロ イタリア	国債証券	1,250,000	11,997.84 149,973,007	14,090.14 176,126,718	1.250 2032/09/15	1.02
25	VW 4.125% 11/16/38 RGS	ユーロ オランダ	社債券	1,100,000	13,943.86 153,382,500	16,009.40 176,103,440	4.125 2038/11/16	1.02
26	GERMANY FEDERAL REPUBLIC OF 0%	ユーロ ドイツ	国債証券	1,240,000	12,324.32 152,821,601	12,334.12 152,943,068	0.000 2023/10/13	0.88
27	UK GILT 2% 09/07/25 REGS	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	975,000	15,364.38 149,802,802	15,566.97 151,777,980	2.000 2025/09/07	0.88
28	UK GILT .875% 10/22/29 REGS	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	1,020,000	14,727.38 150,219,289	14,736.75 150,314,898	0.875 2029/10/22	0.87
29	USTN T11 0.125% 04/15/22	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	1,300,000	11,243.38 146,163,980	11,542.26 150,049,328	0.125 2022/04/15	0.87
30	TIME WARNER CAB 5.75% 6/02/31	イギリス・ポンド アメリカ	社債券	830,000	17,255.37 143,219,617	17,959.47 149,063,628	5.750 2031/06/02	0.86

（参考）マザーファンドの種類別投資比率
フィデリティ・外国債券・マザーファンド

（2020年1月31日現在）

種 類	国内 / 外国	投資比率 (%)
国債証券	外国	62.16
地方債証券	外国	0.54
特殊債券	外国	7.20
社債券	外国	22.50
合計（対純資産総額比）		92.39

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

Aコース（ダイワ投資一任専用）

（2020年1月31日現在）

種類	名称等	買建/売建	数量	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	ポーランド・ズロチ	売建	264,300	7,564,847	7,397,757	0.22
	デンマーク・クローネ	売建	487,800	7,928,787	7,853,580	0.23
	メキシコ・ペソ	売建	1,926,600	11,022,680	11,155,014	0.33
	タイ・バーツ	売建	3,690,600	13,270,290	12,917,100	0.38
	スウェーデン・クローナ	売建	1,276,400	14,724,550	14,436,084	0.43
	スイス・フラン	売建	177,500	19,874,835	19,965,200	0.59
	オーストラリア・ドル	売建	617,600	46,376,988	45,239,200	1.33
	カナダ・ドル	売建	1,203,300	100,457,067	99,332,415	2.93
	オフショア・人民元	売建	7,753,800	120,772,971	120,959,280	3.57
	イギリス・ポンド	売建	1,305,800	186,422,738	186,481,298	5.50
	ユーロ	売建	7,710,300	935,754,318	927,549,090	27.35
	アメリカ・ドル	売建	16,626,400	1,801,692,708	1,811,945,072	53.42

Bコース（ダイワ投資一任専用）

該当事項はありません。

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

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

（参考）マザーファンドのその他投資資産の主要なもの
フィデリティ・外国債券・マザーファンド

（2020年1月31日現在）

種類	名称等	買建/売建	数量	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカ・ドル	買建	20,085,441	2,198,726,740	2,188,710,561	12.65
	ユーロ	買建	18,022,000	2,191,403,601	2,168,046,600	12.53
	オーストラリア・ドル	買建	2,497,000	187,283,264	182,905,250	1.06
	オフショア・人民元	買建	6,555,000	103,254,246	102,258,000	0.59
	スイス・フラン	買建	884,000	99,458,626	99,432,320	0.57
	イギリス・ポンド	買建	539,000	76,769,155	76,974,590	0.44
	スウェーデン・クローナ	買建	6,415,000	74,011,145	72,553,650	0.42
	タイ・バーツ	買建	14,559,000	52,511,635	50,956,500	0.29
	メキシコ・ペソ	買建	8,400,000	48,634,572	48,636,000	0.28
	デンマーク・クローネ	買建	2,791,000	45,419,059	44,935,100	0.26
	カナダ・ドル	買建	541,000	45,102,862	44,654,140	0.26
	シンガポール・ドル	買建	444,000	35,893,179	35,546,640	0.21
	オーストラリア・ドル	売建	1,767,000	131,288,100	129,432,750	0.75
	カナダ・ドル	売建	1,779,000	149,115,780	146,838,660	0.85
	ユーロ	売建	2,556,000	311,039,640	307,486,800	1.78
	イギリス・ポンド	売建	2,407,000	344,892,400	343,743,670	1.99
	ノルウェー・クローネ	売建	102,473,000	1,262,390,820	1,216,354,510	7.03
アメリカ・ドル	売建	27,092,127	2,959,741,344	2,952,229,155	17.06	
債券先物取引	US 10YR ULTRA FUT MAR20 UXYH0	買建	45	698,743,602	712,460,010	4.12
	EURO-BUND FUTURE MAR20 RXH0	買建	25	517,204,436	525,019,275	3.03

US 5YR NOTE (CBT) MAR20 FVH0	買建	26	337,393,019	340,444,422	1.97
LONG GILT FUTURE MAR20 G H0	買建	17	322,264,651	327,230,876	1.89
EURO-BOBL FUTURE MAR20 OEHO	売建	4	64,494,490	64,851,324	0.37
EURO BUXL 30Y BND MAR20 UBHO	売建	14	343,001,561	352,873,584	2.04

(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) 先物取引の時価については、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

2020年1月末日および同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次のとおりです。

Aコース(ダイワ投資一任専用)

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	(2017年6月15日)	1,028	1,028	0.9851	0.9851
2期	(2018年6月15日)	1,249	1,249	0.9709	0.9709
3期	(2019年6月17日)	1,712	1,712	1.0216	1.0216
	2019年1月末日	1,355	-	0.9864	-
	2019年2月末日	1,360	-	0.9900	-
	2019年3月末日	1,480	-	1.0075	-
	2019年4月末日	1,512	-	1.0031	-
	2019年5月末日	1,624	-	1.0128	-
	2019年6月末日	1,907	-	1.0298	-
	2019年7月末日	1,800	-	1.0333	-
	2019年8月末日	1,925	-	1.0525	-
	2019年9月末日	2,231	-	1.0457	-
	2019年10月末日	2,294	-	1.0420	-
	2019年11月末日	2,543	-	1.0437	-
	2019年12月末日	3,049	-	1.0421	-
	2020年1月末日	3,391	-	1.0548	-

Bコース(ダイワ投資一任専用)

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	(2017年6月15日)	255	255	1.0786	1.0786
2期	(2018年6月15日)	437	437	1.0960	1.0960
3期	(2019年6月17日)	560	560	1.1374	1.1374
	2019年1月末日	479	-	1.1052	-
	2019年2月末日	488	-	1.1269	-
	2019年3月末日	538	-	1.1434	-
	2019年4月末日	525	-	1.1434	-
	2019年5月末日	550	-	1.1304	-
	2019年6月末日	646	-	1.1443	-
	2019年7月末日	483	-	1.1493	-
	2019年8月末日	516	-	1.1459	-
	2019年9月末日	552	-	1.1530	-
	2019年10月末日	601	-	1.1714	-
	2019年11月末日	651	-	1.1764	-
	2019年12月末日	786	-	1.1849	-
	2020年1月末日	869	-	1.1904	-

【分配の推移】

Aコース(ダイワ投資一任専用)

期	1口当たりの分配金(円)
第1期	0.0000
第2期	0.0000
第3期	0.0000

Bコース(ダイワ投資一任専用)

期	1口当たりの分配金(円)
第1期	0.0000
第2期	0.0000
第3期	0.0000

【収益率の推移】

Aコース（ダイワ投資一任専用）

期	収益率(%)
第1期	1.5
第2期	1.4
第3期	5.2
第4期中 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日	1.9

Bコース（ダイワ投資一任専用）

期	収益率(%)
第1期	7.9
第2期	1.6
第3期	3.8
第4期中 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日	3.9

（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。

Aコース（ダイワ投資一任専用）

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第1期	1,058,640,474	14,125,943	1,044,514,531
第2期	512,393,856	269,489,664	1,287,418,723
第3期	799,720,938	411,103,468	1,676,036,193
第4期中 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日	1,614,144,008	416,253,809	2,873,926,392

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

Bコース(ダイワ投資一任専用)

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第1期	241,527,997	4,882,167	236,645,830
第2期	204,680,366	42,215,944	399,110,252
第3期	248,514,495	154,558,811	493,065,936
第4期中 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日	328,537,738	187,946,301	633,657,373

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

< 参考情報 >

(2020年1月31日現在)

※運用実績等について別途月次等で適時開示している場合があります。この場合、委託会社のホームページにおいて閲覧できます。
 ※下記データは過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。
 ※各々のグラフ、表にある比率は、それぞれの項目を四捨五入して表示しています。

基準価額・純資産の推移

Aコース



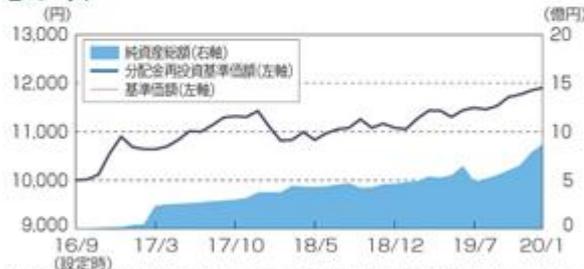
基準価額	Aコース	Bコース
	10,548円	11,904円

純資産総額	Aコース	Bコース
	33.9億円	8.7億円

分配の推移

決算期	分配金(1万円当たり/税引前)	
	Aコース	Bコース
2017年6月	0円	0円
2018年6月	0円	0円
2019年6月	0円	0円
設定以来累計	0円	0円

Bコース



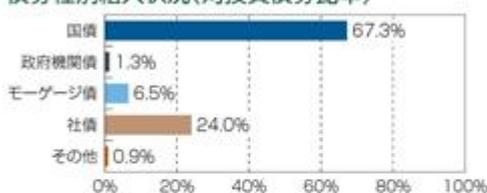
※分配金再投資基準価額は、ファンド設定時に10,000円でスタートしてからの分配金を再投資した実績評価額です。ただし、分配金にかかる税金は考慮していません。
 ※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

主要な資産の状況(マザーファンド)

組入上位10銘柄

順位	銘柄	種別	比率
1	米国国債 1.75% 2029/11/15	国債	6.3%
2	米国国債 2.875% 2021/11/15	国債	5.2%
3	ノルウェー国債 2% 2028/4/26	国債	4.3%
4	カナダ国債 2% 2020/11/01	国債	3.6%
5	米国国債 1.5% 2024/10/31	国債	3.1%
6	米国国債 2.25% 2049/8/15	国債	2.8%
7	ドイツ国債 0% 2029/8/15	国債	2.6%
8	UMBS 4% 2050/2/01	モーゲージ債	2.4%
9	米国国債 1.5% 2021/8/31	国債	2.4%
10	ジニーメイ 3.5% 2050/2/01	モーゲージ債	2.3%

債券種別組入状況(対投資債券比率)



通貨別組入状況

通貨	比率
アメリカドル	59.0%
ユーロ	16.7%
ノルウェークローネ	7.1%
イギリスポンド	5.3%
カナダドル	3.8%
中国元	3.1%
韓国ウォン	2.7%
オーストラリアドル	1.2%
その他	1.1%

格付別組入状況(対投資債券比率)

格付	比率
AAA/Aaa	53.8%
AA/Aa	7.8%
A	7.8%
BBB/Baa	22.9%
BB/Ba	1.2%
格付なし	6.5%

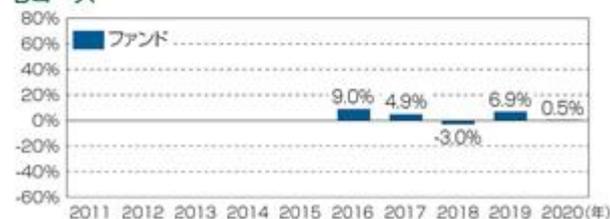
※別途記載がない限り、主要な資産の状況は対純資産総額比率です。
 ※銘柄はご参考のため、英文表記の一部をカタカナで表記しております。実際の発行体名と異なる場合があります。
 ※格付は、S&P社、ムーディーズ社もしくはフィッチ社による格付を採用し、原則として2番目に高い格付を採用しています。([プラス/マイナス]の符号は省略しています。)なお、モーゲージ債および格付のない場合は、「格付なし」に分類しています。

年間収益率の推移

Aコース



Bコース



※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票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。
 ※2016年は当初設定日(2016年9月26日)以降2016年末までの実績、2020年は年初以降1月末までの実績となります。

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

原届出書「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」の末尾に、以下の記載内容を追加いたします。

<追加内容>

ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3、第57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、中間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4期中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第3期計算期間 2019年6月17日現在	第4期中間計算期間 2019年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,721,374,038	3,014,996,525
派生商品評価勘定	287,004	-
未収入金	8,619,137	6,973,802
流動資産合計	1,730,280,179	3,021,970,327
資産合計	1,730,280,179	3,021,970,327
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,431,757	23,718,390
未払解約金	3,907,557	-
未払受託者報酬	233,669	349,312
未払委託者報酬	3,700,529	5,531,537
その他未払費用	721,363	1,068,740
流動負債合計	17,994,875	30,667,979
負債合計	17,994,875	30,667,979
純資産の部		
元本等		
元本	1,676,036,193	2,873,926,392
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	36,249,111	117,375,956
(分配準備積立金)	62,630,500	50,656,895
元本等合計	1,712,285,304	2,991,302,348
純資産合計	1,712,285,304	2,991,302,348
負債純資産合計	1,730,280,179	3,021,970,327

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期中間計算期間 自 2018年6月16日 至 2018年12月15日	第4期中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益		
有価証券売買等損益	38,248,145	95,546,370
派生商品取引等損益	710,252	-
為替差損益	31,723,523	57,336,655
営業収益合計	7,234,874	38,209,715
営業費用		
受託者報酬	209,186	349,312
委託者報酬	3,312,877	5,531,537
その他費用	683,889	1,084,170
営業費用合計	4,205,952	6,965,019
営業利益又は営業損失()	3,028,922	31,244,696
経常利益又は経常損失()	3,028,922	31,244,696
中間純利益又は中間純損失()	3,028,922	31,244,696
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	593,420	3,953,482
期首剰余金又は期首欠損金()	37,524,233	36,249,111
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,041,372	63,603,116
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,041,372	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	63,603,116
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,835,479	9,767,485
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	9,767,485
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,835,479	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	37,695,998	117,375,956

(3)【中間注記表】

(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、わが国における中間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。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期計算期間 2019年6月17日現在	第4期中間計算期間 2019年12月17日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	1,287,418,723 円	1,676,036,193 円
期中追加設定元本額	799,720,938 円	1,614,144,008 円
期中一部解約元本額	411,103,468 円	416,253,809 円
2. 受益権の総数	1,676,036,193 口	2,873,926,392 口
3. 1口当たり純資産額	1.0216 円	1.0408 円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期中間計算期間 自 2018年6月16日 至 2018年12月15日	第4期中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
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0.23%以内の額	信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

1．中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表計上額は中間計算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い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>

（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3期計算期間 2019年6月17日 現在			第4期中間計算期間 2019年12月17日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
	うち 1 年 超			うち 1 年 超		
市場取引以外の取引						
為替予約取引						
売建	1,640,399,191	- 1,649,543,944	9,144,753	2,852,599,934	- 2,876,318,324	23,718,390
アメリカ・ドル	923,071,975	- 929,762,504	6,690,529	1,587,033,747	- 1,594,832,320	7,798,573
イギリス・ポンド	92,080,115	- 92,143,095	62,980	155,016,965	- 159,433,825	4,416,860
オーストラリア・ドル	24,469,615	- 24,325,176	144,439	40,389,173	- 40,719,589	330,416
オフショア・人民元	18,305,334	- 18,396,510	91,176	91,561,730	- 92,665,560	1,103,830
カナダ・ドル	51,601,116	- 52,085,071	483,955	85,500,978	- 86,697,786	1,196,808
スイス・フラン	11,244,781	- 11,249,920	5,139	18,034,226	- 18,258,460	224,234
スウェーデン・クローナ	8,896,897	- 8,908,100	11,203	14,435,389	- 14,736,414	301,025
タイ・バーツ	6,387,708	- 6,459,752	72,044	12,163,915	- 12,216,962	53,047
デンマーク・クローネ	4,537,320	- 4,553,280	15,960	7,175,913	- 7,234,656	58,743
ポーランド・ズロチ	4,201,901	- 4,242,756	40,855	6,817,871	- 6,924,498	106,627
メキシコ・ペソ	5,550,789	- 5,753,860	203,071	9,618,931	- 9,974,972	356,041
ユーロ	490,051,640	- 491,663,920	1,612,280	824,851,096	- 832,623,282	7,772,186
合計	1,640,399,191	- 1,649,543,944	9,144,753	2,852,599,934	- 2,876,318,324	23,718,390

（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いません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

【フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第3期計算期間 2019年6月17日現在	第4期中間計算期間 2019年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	560,788,855	748,490,383
未収入金	5,431,534	1,888,815
流動資産合計	566,220,389	750,379,198
資産合計	566,220,389	750,379,198
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,788,044	-
未払受託者報酬	81,548	94,286
未払委託者報酬	1,291,577	1,493,591
その他未払費用	251,747	288,753
流動負債合計	5,412,916	1,876,630
負債合計	5,412,916	1,876,630
純資産の部		
元本等		
元本	493,065,936	633,657,373
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	67,741,537	114,845,195
(分配準備積立金)	19,204,584	13,338,354
元本等合計	560,807,473	748,502,568
純資産合計	560,807,473	748,502,568
負債純資産合計	566,220,389	750,379,198

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 3 期中間計算期間 自 2018年 6 月16日 至 2018年12月15日	第 4 期中間計算期間 自 2019年 6 月18日 至 2019年12月17日
営業収益		
有価証券売買等損益	13,191,501	25,021,451
営業収益合計	13,191,501	25,021,451
営業費用		
受託者報酬	71,636	94,286
委託者報酬	1,134,986	1,493,591
その他費用	221,268	288,797
営業費用合計	1,427,890	1,876,674
営業利益又は営業損失（ ）	11,763,611	23,144,777
経常利益又は経常損失（ ）	11,763,611	23,144,777
中間純利益又は中間純損失（ ）	11,763,611	23,144,777
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,197,729	1,017,990
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	38,313,447	67,741,537
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,625,870	50,776,570
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,625,870	50,776,570
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,367,259	25,799,699
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,367,259	25,799,699
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	52,137,940	114,845,195

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期計算期間 2019年6月17日現在	第4期中間計算期間 2019年12月17日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	399,110,252 円	493,065,936 円
期中追加設定元本額	248,514,495 円	328,537,738 円
期中一部解約元本額	154,558,811 円	187,946,301 円
2. 受益権の総数	493,065,936 口	633,657,373 口
3. 1口当たり純資産額	1.1374 円	1.1812 円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期中間計算期間 自 2018年6月16日 至 2018年12月15日	第4期中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
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0.23%以内の額	信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表計上額は中間計算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	(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。 (2) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。 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。

（デリバティブ取引に関する注記）

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。

（参考情報）

ファンドは、「フィデリティ・外国債券・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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・外国債券・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	2019年 6 月17日現在	2019年12月17日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	452,871,411	1,507,365,378
金銭信託	7,020,555	22,880,266
国債証券	9,038,007,137	9,565,385,707
地方債証券	-	92,430,294
特殊債券	884,530,404	1,310,531,783
社債券	4,428,677,756	4,485,601,923
派生商品評価勘定	26,915,765	34,039,855
未収入金	1,013,142,077	509,137,304
未収利息	65,724,084	56,887,172
前払費用	17,262,728	24,529,255
差入委託証拠金	163,583,880	204,285,740
流動資産合計	16,097,735,797	17,813,074,677
資産合計	16,097,735,797	17,813,074,677
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	20,682,429	50,991,870
未払金	1,754,213,568	1,556,478,905
未払解約金	14,714,870	9,689,626
その他未払費用	1,016	3,881
流動負債合計	1,789,611,883	1,617,164,282
負債合計	1,789,611,883	1,617,164,282
純資産の部		
元本等		
元本	6,182,747,460	6,717,562,746
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,125,376,454	9,478,347,649
元本等合計	14,308,123,914	16,195,910,395
純資産合計	14,308,123,914	16,195,910,395
負債純資産合計	16,097,735,797	17,813,074,677

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	2019年 6 月17日現在	2019年12月17日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	6,119,359,897 円	6,182,747,460 円
期中追加設定元本額	732,185,537 円	958,898,064 円
期中一部解約元本額	668,797,974 円	424,082,778 円
2. 期末元本額及びその内訳		
フィデリティ・グローバル・ボンド・ファンド（除く日本円、適格機関投資家専用）	753,920,314 円	751,604,251 円
フィデリティ・グローバル・ボンド・ファンド（除く日本円、為替ヘッジあり、非課税適格機関投資家専用）	1,069,876,012 円	1,059,806,411 円
フィデリティ・インスティテューショナル・グローバル・ボンド・ファンド（除く日本円、為替ヘッジあり、適格機関投資家転売制限付き）	1,134,212,174 円	1,104,263,624 円
フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Aコース（ダイワ投資一任専用）	743,831,146 円	1,250,517,016 円

フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用)	242,325,147 円	310,448,106 円
フィデリティ・インスティテューショナル・グローバル・バランス・プラス・ファンド (為替ヘッジあり)(適格機関投資家転売制限付き)	2,238,582,667 円	2,240,923,338 円
計	6,182,747,460 円	6,717,562,746 円
3. 受益権の総数	6,182,747,460 口	6,717,562,746 口
4. 1口当たり純資産額	2.3142 円	2.4110 円

(金融商品に関する注記)

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>

(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	2019年6月17日 現在			2019年12月17日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	4,169,363,407	-	4,162,305,800	7,057,607	4,001,159,398	-	4,038,791,316	37,631,918
アメリカ・ドル	2,556,855,567	-	2,554,937,590	1,917,977	2,743,204,348	-	2,758,602,846	15,398,498
イギリス・ポンド	167,981,800	-	166,713,000	1,268,800	39,016,710	-	38,787,090	229,620
オーストラリア・ドル	276,060,960	-	274,041,360	2,019,600	-	-	-	-
カナダ・ドル	182,812,500	-	181,980,000	832,500	145,984,740	-	147,692,580	1,707,840
ノルウェー・クローネ	898,697,280	-	897,977,170	720,110	1,072,953,600	-	1,093,708,800	20,755,200
ユーロ	86,955,300	-	86,656,680	298,620	-	-	-	-
買建	4,168,699,407	-	4,153,806,128	14,893,279	4,001,159,398	-	4,032,822,769	31,663,371
アメリカ・ドル	1,612,507,840	-	1,612,517,738	9,898	1,257,955,050	-	1,258,126,889	171,839
イギリス・ポンド	-	-	-	-	167,613,458	-	169,820,630	2,207,172
オーストラリア・ドル	300,685,706	-	296,504,990	4,180,716	184,876,036	-	187,699,490	2,823,454
シンガポール・ドル	-	-	-	-	35,488,622	-	35,799,720	311,098
スイス・フラン	96,776,442	-	96,179,200	597,242	97,685,865	-	98,477,600	791,735
スウェーデン・クローナ	358,368,262	-	356,816,350	1,551,912	73,252,601	-	74,991,350	1,738,749
タイ・バーツ	50,466,115	-	50,519,730	53,615	52,232,635	-	52,557,990	325,355
デンマーク・クローネ	45,808,212	-	45,549,120	259,092	45,083,444	-	45,549,120	465,676
メキシコ・ペソ	45,894,230	-	47,292,000	1,397,770	47,263,654	-	48,216,000	952,346
ユーロ	1,658,192,600	-	1,648,427,000	9,765,600	2,039,708,033	-	2,061,583,980	21,875,947
合計	8,338,062,814	-	8,316,111,928	7,835,672	8,002,318,796	-	8,071,614,085	5,968,547

（注1）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

（注2）デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておられません。

債券関連

種類	2019年6月17日 現在			2019年12月17日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1 年 超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
売建	257,720,926	-	261,157,660	3,436,734	413,291,793	-	411,861,836	1,429,957
買建	1,646,857,551	-	1,664,363,294	17,505,743	1,893,526,801	-	1,881,113,376	12,413,425
合計	1,904,578,477	-	1,925,520,954	14,069,009	2,306,818,594	-	2,292,975,212	10,983,468

（注1）時価の算定方法

1. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

2. 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

（注2）デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておられません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

原届出書「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況 純資産額計算書」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>

Aコース（ダイワ投資一任専用）

（2020年1月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	3,407,493,346	円
負債総額	15,585,320	円
純資産総額（ - ）	3,391,908,026	円
発行済数量	3,215,672,069	口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0548	円

Bコース（ダイワ投資一任専用）

（2020年1月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	869,795,558	円
負債総額	651,538	円
純資産総額（ - ）	869,144,020	円
発行済数量	730,127,351	口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1904	円

（参考）マザーファンドの純資産額計算書
フィデリティ・外国債券・マザーファンド

（2020年1月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	19,003,751,016	円
負債総額	1,695,355,152	円
純資産総額（ - ）	17,308,395,864	円
発行済数量	7,117,992,922	口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.4316	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（2019年7月末日現在）

（略）

< 訂正後 >

(1) 資本金等（2020年1月末日現在）

（略）

2【事業の内容及び営業の概況】

< 訂正前 >

（略）

2019年7月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、追加型株式投資信託160本、親投資信託53本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,216,195,748,201円です。

< 訂正後 >

（略）

2020年1月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、追加型株式投資信託157本、親投資信託51本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,333,647,464,264円です。

3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条および第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度（2018年4月1日から2019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。第34期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

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

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第32期 (2018年3月31日)	第33期 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	975,413	1,427,907
立替金	72,930	100,317
前払費用	28,800	13,866
未収委託者報酬	5,464,066	5,388,448
未収収益	1,921,861	741,116
未収入金	* 1 365,790	150,419
繰延税金資産	607,573	-
未収還付法人税等	-	50,510
未収還付消費税等	-	120,394
流動資産計	9,436,436	7,992,981
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 22,863,900	23,346,748
長期差入保証金	17,804	25,145
繰延税金資産	778,438	1,089,396
その他	230	430
投資その他の資産合計	23,660,373	24,461,720
固定資産計	23,667,860	24,469,207
資産合計	33,104,296	32,462,188
負債の部		
流動負債		
預り金	103,438	30,687
未払金	* 1	
未払手数料	2,425,583	2,369,952
その他未払金	2,622,149	1,653,290
未払費用	551,982	592,634
未払法人税等	193,363	-
未払消費税等	291,148	-
賞与引当金	1,858,394	1,469,810
その他流動負債	931	931
流動負債合計	8,046,992	6,117,307
固定負債		
長期賞与引当金	239,904	298,547
退職給付引当金	4,786,190	4,712,577
固定負債合計	5,026,094	5,011,125
負債合計	13,073,087	11,128,432
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	18,931,208	20,233,755
利益剰余金合計	19,031,208	20,333,755
株主資本合計	20,031,208	21,333,755
純資産合計	20,031,208	21,333,755
負債・純資産合計	33,104,296	32,462,188

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第33期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	47,015,140	38,212,229
その他営業収益	4,392,629	3,152,985
営業収益計	51,407,769	41,365,214
営業費用	* 1	
支払手数料	22,128,840	17,804,844
広告宣伝費	493,950	504,887
調査費		
調査費	487,993	606,194
委託調査費	10,160,657	7,658,693
営業雑経費		
通信費	50,195	35,533
印刷費	117,152	63,293
協会費	35,503	30,701
諸会費	1,555	2,487
営業費用計	33,475,849	26,706,635
一般管理費		
給料		
給料・手当	2,529,490	2,408,072
賞与	2,272,929	1,717,394
福利厚生費	593,981	580,285
交際費	27,478	22,538
旅費交通費	176,209	156,818
租税公課	129,039	96,478
弁護士報酬	15,719	9,625
不動産賃貸料・共益費	602,626	598,215
支払ロイヤリティ	1,033,326	305,883
退職給付費用	201,666	210,619
消耗器具備品費	5,733	8,177
事務委託費	6,503,327	6,249,198
諸経費	322,446	325,845
一般管理費計	14,413,974	12,689,151
営業利益	3,517,944	1,969,426
営業外収益		
受取利息	* 1	
受取利息	122,290	139,478
保険配当金	8,991	8,570
為替差益	86,339	-
雑益	4,534	6,818
営業外収益計	222,156	154,868
営業外費用		
寄付金	-	41
為替差損	-	90,627
営業外費用計	-	90,668
経常利益	3,740,101	2,033,626
特別損失		
特別退職金	285,710	49,075
事務過誤損失	596	-
特別損失計	286,306	49,075
税引前当期純利益	3,453,794	1,984,550
法人税、住民税及び事業税	1,212,425	385,388
法人税等調整額	(136,204)	296,615
法人税等合計	1,076,221	682,003
当期純利益	2,377,574	1,302,546

(3)【株主資本等変動計算書】

第32期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本				
	資本金	利益準備金	利益剰余金		株主資本合計
			その他利益剰余金	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

第33期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本				
	資本金	利益準備金	利益剰余金		株主資本合計
			その他利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	1,000,000	100,000	18,931,208	19,031,208	20,031,208
当期変動額					
当期純利益	-	-	1,302,546	1,302,546	1,302,546
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	1,302,546	1,302,546	1,302,546
当期末残高	1,000,000	100,000	20,233,755	20,333,755	21,333,755

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	-	-	20,031,208
当期変動額			
当期純利益	-	-	1,302,546
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-
当期変動額合計	-	-	1,302,546
当期末残高	-	-	21,333,755

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）

「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

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

表示方法の変更

1. 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用
 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）等を当会計期間から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

*1 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。

	第32期 (2018年3月31日)	第33期 (2019年3月31日)
未収入金	75,889 千円	108,246 千円
その他未払金	2,274,334 千円	1,254,001 千円
長期貸付金	21,400,000 千円	21,850,000 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32期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第33期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
営業費用	13,524,345 千円	11,203,862 千円
受取利息	57,463 千円	61,374 千円

(株主資本等変動計算書関係)

第32期(自 2017年4月1日 至 2018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33期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

(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32期（2018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	-

第33期（2019年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	1,427,907	1,427,907	-
(2) 未収委託者報酬	5,388,448	5,388,448	-
(3) 未収収益	741,116	741,116	-
(4) 未収入金	150,419	150,419	-
(5) 長期貸付金	23,346,748	23,346,748	-
資産計	31,054,638	31,054,638	-
(1) 未払手数料	2,369,952	2,369,952	-
(2) その他未払金	1,653,290	1,653,290	-
(3) 未払費用	592,634	592,634	-
負債計	4,615,876	4,615,876	-

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法に関する事項

第32期（2018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。

第33期(2019年3月31日)

資産

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

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

(5) 長期貸付金

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

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、(3) 未払費用

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

(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32期(2018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。

第33期(2019年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金及び預金	1,427,907	-	-	-
未収委託者報酬	5,388,448	-	-	-
未収収益	741,116	-	-	-
未収入金	150,419	-	-	-
合計	7,707,892	-	-	-

金銭債権のうち長期貸付金(23,346,748千円)については、契約上返済期限の定めがないため、上記に含めておりません。

(有価証券関係)

第32期(2018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2017年4月1日 至2018年3月31日)
該当事項はありません。

第33期(2019年3月31日)

1. その他有価証券
該当事項はありません。
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自2018年4月1日 至2019年3月31日)
該当事項はありません。

(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32期（自 2017年4月1日 至 2018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。

第33期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は確定給付型年金制度及び確定拠出型年金制度を採用しております。

2. 確定給付型年金制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(千円)
退職給付債務の期首残高	4,776,447
勤務費用	177,913
利息費用	7,651
数理計算上の差異の発生額	35,733
退職給付の支払額	341,816
制度改定による変動額	-
為替変動による影響額	120,471
その他	225
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>4,704,708</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	4,704,708
未認識過去勤務費用	7,869
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>4,712,577</u>
<u>退職給付引当金</u>	<u>4,712,577</u>
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>4,712,577</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	177,913
利息費用	7,651
数理計算上の差異の費用処理額	35,733
過去勤務債務の費用処理額	1,874
<u>確定給付型年金制度に係る退職給付費用</u>	<u>147,957</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86,210千円であります。

(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32期 (2018年3月31日)	第33期 (2019年3月31日)
(流動)	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払費用	186,465	101,830
賞与引当金	561,152	441,058
その他	62,704	20,196
繰延税金資産合計	810,321	563,084
繰延税金負債		
未払金	202,748	186,975
繰延税金資産又は繰延税金負債()の純額	607,573	376,109
(固定)	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,473,419	1,451,987
資産除去債務	2,685	2,685
その他	81,708	96,782
繰延税金資産小計	1,557,812	1,551,454
評価性引当額	765,291	803,096
繰延税金資産合計	792,521	748,358
繰延税金負債		
長期貸付金	14,084	35,073
繰延税金資産又は繰延税金負債()の純額	778,437	713,285

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32期 (2018年3月31日)	第33期 (2019年3月31日)
法定実効税率	30.62%	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.32%	1.81%
評価性引当額	1.47%	1.90%
過年度法人税等	0.27%	0.04%
税率変更差異	0.00%	0.00%
その他	0.42%	0.08%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.16%	34.38%

(持分法損益等)

該当事項はありません。

（企業結合等関係）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

当社は建物所有者との間で事業用不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、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32期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）及び 第33期（自 2018年4月1日 至 2019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32期（自2017年4月1日 至2018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

第33期（自2018年4月1日 至2019年3月31日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

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

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

投資信託の名称	委託者報酬	関連するサービスの種類
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	10,579,865	投資信託の運用
フィデリティ・USリート・ファンドB（為替ヘッジなし）	9,025,455	投資信託の運用
フィデリティ・日本成長株・ファンド	5,447,177	投資信託の運用

関連当事者情報

第32期（自 2017年4月1日 至 2018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。

第33期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称	会社等の所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
親会社	FIL Limited	英領バ ミュー ダ、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) 共通発生 経費負担額 (注4)	千円 - 6,977,863	未収入金 未払金	千円 82,094 557,126
親会社	フィデリ ティ・ジャ パン・ホー ルディン グス株式 会社	東京都 港区	千円 4,510,000	グループ 会社経営 管理	被所有 直接 100 %	当社事業 活動の管 理等役員 の兼任	金銭の貸付 (注1) 利息の受取 (注1) 共通発生 経費負担額 (注4) 連結法人税の 個別帰属額	千円 450,000 61,374 429,152 -	長期 貸付金 未収入金 未払金 未払金	千円 21,850,000 20,309 81,239 294,863
親会社	FIL Asia Holdings Pte. Limited	シンガ ポール、 ブルバ ード市	千米ドル 189,735	グループ 会社経営 管理	被所有 間接 100%	営業取引	共通発生 経費負担額 (注4)	千円 3,796,845	未払金	千円 314,928

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

属性	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
同一の親会社をもつ会社	フィデリティ証券株式会社	東京都港区	千円 9,257,500	証券業	なし	当社設定投資信託の募集・販売	共通発生経費負担額(注4) 投資信託販売に係る代行手数料(注5)	千円 600,501 877,675	未払金 未払金	千円 23,643 174,703
同一の親会社をもつ会社	FIL Investment Management (Hong Kong) Limited	香港、セントラル市	千米ドル 22,897	証券投資顧問業	なし	当社事業活動へのサービスの提供	共通発生経費負担額(注4)	千円 717,522	未払金	千円 71,425
同一の親会社をもつ会社	FIL (Luxembourg) S.A.	ルクセンブルグ、ルクセンブルグ市	千米ドル 1,676	証券投資顧問業	なし	商標使用契約	ロイヤリティの支払	千円 305,883	未払金	千円 127,244

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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

(1株当たり情報)

	第32期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第33期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	1,001,560円45銭	1,066,687円79銭
1株当たり当期純利益	118,878円71銭	65,127円34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32期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第33期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(千円)	2,377,574	1,302,546
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)	2,377,574	1,302,546
期中平均株式数	20,000株	20,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

		第34期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
科目	注記 番号	金額 (千円)	構成比 (%)
(資産の部)			
流動資産			
現金及び預金		1,082,828	
未収委託者報酬		5,370,889	
未収収益		430,461	
未収入金		174,681	
その他		80,356	
流動資産計		7,139,217	21.0
固定資産			
無形固定資産		7,487	
投資その他の資産			
長期貸付金		25,956,657	
長期差入保証金		19,170	
会員預託金		430	
繰延税金資産		906,522	
投資その他の資産計		26,882,781	79.0
固定資産計		26,890,268	79.0
資産合計		34,029,485	100.0

		第34期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
科目	注記 番号	金額 (千円)	構成比 (%)
(負債の部)			
流動負債			
未払手数料		2,360,675	
その他未払金		1,179,537	
未払費用		319,503	
未払法人税等		81,956	
賞与引当金		1,668,432	
その他	*1	192,621	
流動負債計		5,802,726	17.1
固定負債			
長期賞与引当金		527,631	
退職給付引当金		4,680,295	
固定負債計		5,207,927	15.3
負債合計		11,010,653	32.4
(純資産の部)			
株主資本			
資本金		1,000,000	
利益剰余金			
利益準備金		100,000	
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		21,918,831	
利益剰余金合計		22,018,831	
株主資本合計		23,018,831	67.6
純資産合計		23,018,831	67.6
負債・純資産合計		34,029,485	100.0

(2) 中間損益計算書

		第34期中間会計期間 自 2019年4月1日 至 2019年9月30日	
科目	注記 番号	金額 (千円)	百分比 (%)
営業収益			
委託者報酬		17,981,157	
その他営業収益		1,138,117	
営業収益計		19,119,274	100.0
営業費用及び一般管理費		17,915,356	93.7
営業利益		1,203,918	6.3
営業外収益	*2	107,734	0.6
営業外費用		-	-
経常利益		1,311,652	6.9
特別利益		797,838	4.2
賞与引当金戻入益	*3	797,838	4.2
特別損失		6,785	0.0
特別退職金		6,775	0.0
事務過誤損失		10	0.0
税引前中間純利益		2,102,705	11.0
法人税等	*1	417,629	2.2
中間純利益		1,685,076	8.8

重要な会計方針

項目	第34期中間会計期間 自 2019年4月1日 至 2019年9月30日
1. 引当金の計上基準	<p>(1) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。</p> <p>過去勤務債務については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による按分額を定額法により費用処理しております。数理計算上の差異については、発生年度に全額費用処理しております。</p> <p>(2) 賞与引当金、長期賞与引当金</p> <p>従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p>
2 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 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。</p> <p>(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。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第34期中間会計期間末 2019年9月30日
*1 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

項目	第34期中間会計期間 自 2019年4月1日 至 2019年9月30日
*1 税金費用の取扱い	税金費用については、簡便法による税効果会計を適用しているため、法人税等調整額は法人税等に含めて表示しております。
*2 営業外収益の主要な項目	営業外収益のうち主要な項目は以下のとおりであります。 貸付金利息 74,903千円
*3 特別利益に計上されている 賞与引当金戻入益	当社グループは当中間会計期間において賞与引当金の見積期間（7月1日から6月30日を1月1日から12月31日に）の改定を行いました。これに伴い、2019年6月30日時点で計上されていた賞与引当金のうち797,838千円を取り崩し、当中間会計期間において賞与引当金戻入益として認識しております。

(リース取引関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

第34期中間会計期間(2019年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません。(注)2.参照)

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	1,082,828	1,082,828	-
(2) 未収委託者報酬	5,370,889	5,370,889	-
(3) 未収収益	430,461	430,461	-
(4) 未収入金	174,681	174,681	-
(5) 長期貸付金	25,956,657	25,956,657	-
資産計	33,015,518	33,015,518	-
(1) 未払手数料	2,360,675	2,360,675	-
(2) その他未払金	1,179,537	1,179,537	-
負債計	3,540,212	3,540,212	-

(注) 1.金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、(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。

2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

該当事項はありません。

(有価証券関係)

第34期中間会計期間(2019年9月30日)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

第34期中間会計期間(2019年9月30日)

該当事項はありません。

(ストックオプション等関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

第34期中間会計期間(2019年9月30日)

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

(持分法損益等)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(賃貸等不動産関係)

第34期中間会計期間(2019年9月30日)

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34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

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

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の名称	委託者報酬 (単位:千円)	関連するサービスの種類
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	4,614,955	投資信託の運用
フィデリティ・USリート・ファンドB (為替ヘッジなし)	4,127,388	投資信託の運用
フィデリティ・日本成長株・ファンド	2,553,385	投資信託の運用

(1株当たり情報)

	第34期中間会計期間 自 2019年4月1日 至 2019年9月30日
1株当たり純資産額	1,150,941.60円
1株当たり中間純利益金額	84,253.81円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額	1,685,076千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	1,685,076千円
普通株式の期中平均株式数	20,000株

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

(重要な後発事象)**臨時配当**

当社は2019年11月29日臨時株主総会にて決議されたフィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社（当社株主）に対する剰余金配当を以下の通り行いました。

1．配当財産の種類及び帳簿価額の総額**現物配当**

当社とフィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社との間の2010年11月17日付け「JPY20,000,000,000 LOAN FACILITY AGREEMENT」（2015年10月16日付けの改訂契約を含む。）に基づく当社のフィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社に対する貸付金のうち、元本金額200億円に相当する部分の貸付金

2．株主に対する配当財産の割当てに関する事項

下記3．で定められた日付現在の株主に対し、その有する株式の割合に従い配当を行いました。

3．剰余金の配当の効力が生ずる日

2019年11月29日

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 (2019年9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	大和証券株式会社	100,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
	フィデリティ証券株式会社	9,257百万円	
運用の委託先	FILインベストメンツ・インターナショナル	225,365英ポンド (約32百万円 [*]) [*] 1英ポンド143.48円で 換算 (2019年12月末日現在)	主として英国およびヨーロッパにおいて投資信託の販売および投資信託会社に対する投資運用業務を営んでいます。

独立監査人の中間監査報告書

2020年2月5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外国債券アクティブ・ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)の2019年6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)の2019年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2019年6月18日から2019年12月17日まで)の損益の状況に関する有用な情報を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. 上記は中間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データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2020年2月5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外国債券アクティブ・ファンド Bコース（ダイワ投資一任専用）の2019年6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Bコース（ダイワ投資一任専用）の2019年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を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．上記は中間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データは中間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

2019年6月10日

フィデリティ投信株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第33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2019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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2019年12月6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2019年4月1日から2020年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、フィデリティ投信株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は2019年11月29日開催の臨時株主総会において、親会社であるフィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社に対する剰余金の配当を決議した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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. 上記は中間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データは中間監査の対象には含まれていません。