

【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6月24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・グローバル・ハイ・イールド・ファンド （毎月決算型） |
| 【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】 | 5,000億円を上限とします。 |
| 【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致しましたので、2019年12月25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】

（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）

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^{*}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。*再委託も含まれます。

（略）

委託会社の概況（2019年10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）

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

（略）

委託会社の概況（2020年4月末日現在）

（略）

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<訂正前>

(略)

ファンドのベンチマーク*

(略)

| ベンチマーク | 構成割合 |
|---|-------|
| ICE BofAML アジアン・ハイ・イールド・コーポレート・コンストレインド・ブレンデッド・インデックス(レベル4-20%)(円換算) | 1 / 3 |
| ICE BofAML グローバル・ハイ・イールド・ヨーロッパ・イシューアーズ・コンストレインド・インデックス(レベル4-20%)(ユーロヘッジ・ベース)(円換算) | 1 / 3 |
| ICE BofAML USハイ・イールド・コンストレインド・インデックス(円換算) | 1 / 3 |

(略)

<訂正後>

(略)

ファンドのベンチマーク*

(略)

| ベンチマーク | 構成割合 |
|---|-------|
| ICE BofA アジアン・ハイ・イールド・コーポレート・コンストレインド・ブレンデッド・インデックス(レベル4-20%)(円換算) | 1 / 3 |
| ICE BofA グローバル・ハイ・イールド・ヨーロッパ・イシューアーズ・コンストレインド・インデックス(レベル4-20%)(ユーロヘッジ・ベース)(円換算) | 1 / 3 |
| ICE BofA USハイ・イールド・コンストレインド・インデックス(円換算) | 1 / 3 |

(略)

(2)【投資対象】

原届出書「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (2) 投資対象

主たる投資対象ファンドの概要」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>

主たる投資対象ファンドの概要(2020年4月末日現在)

| | |
|-------|---|
| ファンド名 | フィデリティ・ファンズ - アジアン・ハイ・イールド・ファンド |
| 設定形態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人 / 米ドル建て |
| 関係法人 | 投資運用会社：FILファンド・マネジメント・リミテッド（バミューダ） |
| 投資目的 | 主として、活動の大半がアジアで営まれている発行体の高利回り事業債（ハイ・イールド債券）に投資を行ない、高水準のインカムの確保と値上り益の追求を目指します。 |
| 費用 | 管理報酬：1.00% その他の手数料等については、運用状況等により変動しますので事前に料率、上限額等を表示することができません。 その他の手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。 |
| 申込手数料 | なし |

注) 管理報酬は1.00%となっていますが、代行手数料相当分である0.50%については、ファンドに割戻しを行ないます。上記の記載事項は、当該投資対象ファンド固有の事情により変更される場合があります。

| | |
|-------|---|
| ファンド名 | フィデリティ・ファンズ - ヨーロピアン・ハイ・イールド・ファンド |
| 設定形態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人 / ユーロ建て |
| 関係法人 | 投資運用会社：FILファンド・マネジメント・リミテッド（バミューダ） |
| 投資目的 | 主として、本店所在地が西ヨーロッパ、中央ヨーロッパ、東ヨーロッパ（ロシアを含む）にあるか、活動の大半がそれらの地域で営まれている発行体の高利回り事業債（ハイ・イールド債券）に投資を行ない、高水準のインカムの確保と値上り益の追求を目指します。 |
| 費用 | 管理報酬：1.00% ・ その他の手数料等については、運用状況等により変動しますので事前に料率、上限額等を表示することができません。 ・ その他の手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。 |
| 申込手数料 | なし |

注) 管理報酬は1.00%となっていますが、代行手数料相当分である0.50%については、ファンドに割戻しを行ないます。上記の記載事項は、当該投資対象ファンド固有の事情により変更される場合があります。

| | |
|-------|--|
| ファンド名 | 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） |
| 設定形態 | 国内証券投資信託 |
| 委託会社等 | 委託会社：フィデリティ投信株式会社 ただし、マザーファンドの運用指図に関する権限はフィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニー・エルエルシー [*] （米国）に委託します。 |
| 投資目的 | フィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンド受益証券への投資を通じて、米ドル建ての高利回り社債（ハイ・イールド債券）を主要な投資対象とし、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的に積極的な運用を行なうことを基本とします。 |
| 費用 | 信託報酬：純資産総額に対し年率0.8745%（税抜 0.795%） 税法が改正された場合等には、上記数値が変更になることがあります。 <ul style="list-style-type: none"> その他、投資信託財産に係る監査費用等を投資信託財産の純資産総額に対して年率0.10%（税込）を上限として投資信託財産から支払う場合があります。（なお、当該上限率については変更する場合があります。） その他の手数料等については、運用状況等により変動しますので事前に料率、上限額等を表示することができません。 その他の手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。 |
| 申込手数料 | なし |

注）上記の記載事項は、当該投資対象ファンド固有の事情により変更される場合があります。

* 当該運用の委託先は2020年1月1日付でフィデリティ・マネジメント・アンド・リサーチ・カンパニーから名称を変更しています。

（３）【運用体制】

<訂正前>

（略）

運用担当者の変更等により、運用の指図に関する権限の委託^{*}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。*再委託も含まれます。

<訂正後>

（略）

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

（４）【分配方針】

<訂正前>

（略）

利益の処理方式

（略）

(a) 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額は、借入有価証券品借料、借入金の利息および融資枠の設定に要する費用、信託事務の諸費用等（投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、立替金利

息等を含みます。) 、信託報酬等(以下、総称して「支出金」といいます。)を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

(略)

<訂正後>

(略)

利益の処理方式

(略)

(a) 配当金、利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額は、借入有価証券品借料、借入金の利息および融資枠の設定に要する費用、信託事務の諸費用等(投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、立替金利息等を含みます。)、信託報酬等(以下、総称して「支出金」といいます。)を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

(略)

(5)【投資制限】

<訂正前>

<ファンドの投資信託約款に基づく投資制限>

(略)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

有価証券の貸付の指図および範囲

(a) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する公社債について、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えない範囲内で貸付の指図をすることができます。

(b) 上記(a)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

有価証券の借入れの指図および範囲

(略)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

資金の借入れ

(略)

<訂正後>

<ファンドの投資信託約款に基づく投資制限>

(略)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対

する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

— 有価証券の借入れの指図および範囲

(略)

— 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

— 資金の借入れ

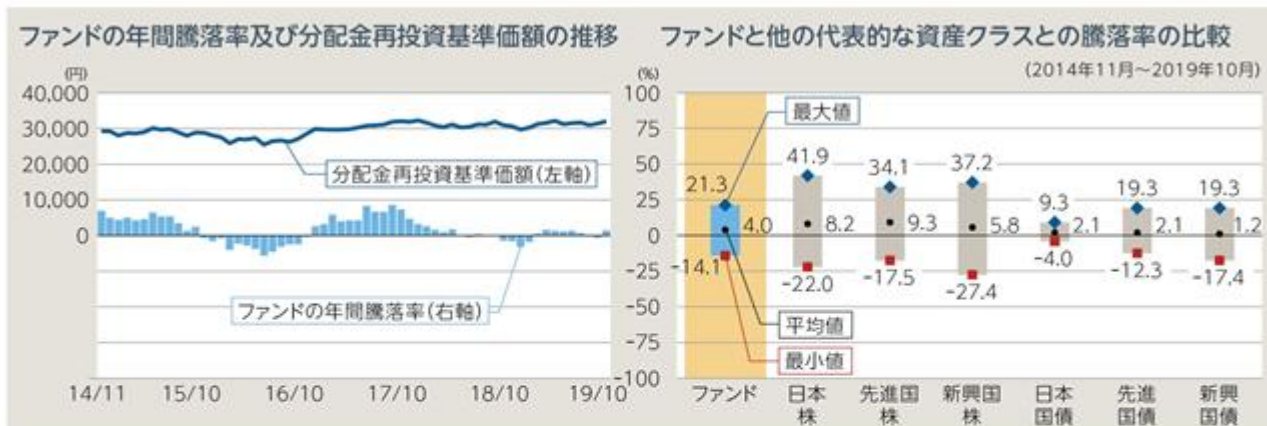
(略)

3【投資リスク】

<訂正前>

（略）

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2014年11月～2019年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

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

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

※2014年11月～2019年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

代表的な資産クラスの指数

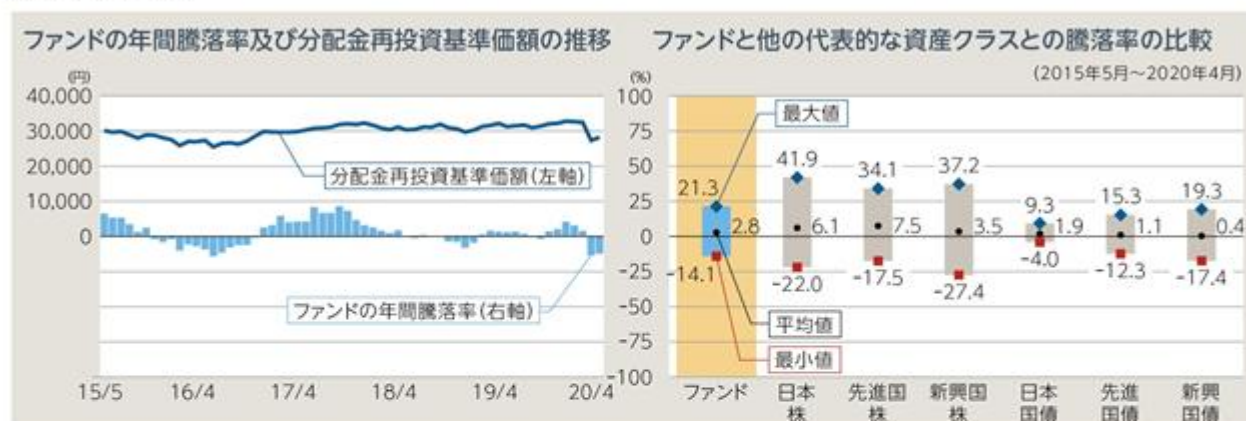
| | |
|--|--|
| 日本株 TOPIX (配当込) | 東証株価指数 (TOPIX) は、株式会社東京証券取引所 (株東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、本商品の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。 |
| 先進国株 MSCI コクサイ・インデックス (税引前配当金込/円ベース) | MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が開発した、日本を除く先進国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他知的所有権は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。

<訂正後>

(略)

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2015年5月～2020年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。
 ※「ファンドの年間騰落率」は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率であり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。なお、当騰落率は目盛最大値に比べ値が小さいためにグラフが見えない場合があります。
 ※「分配金再投資基準価額」は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額であり、実際の基準価額と異なる場合があります。

※2015年5月～2020年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
 ※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
 ※ファンドは税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

代表的な資産クラスの指数

| | |
|--|--|
| 日本株 TOPIX (配当込) | 東証株価指数 (TOPIX) は、株式会社東京証券取引所 (株東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、本商品の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。 |
| 先進国株 MSCI コクサイ・インデックス (税引前配当金込/円ベース) | MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が開発した、日本を除く先進国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他知的所有権は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>

（略）

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

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

なお、投資対象ファンドにおいて、年率0.60%（税抜）程度の運用報酬等が別途課されるため、ファンドにおいては、合計で最大年率1.49%（税込）程度の信託報酬等を実質的に支弁する予定です。ただし、この実質的な信託報酬等は、2019年10月末日現在の投資対象ファンドに基づくものであり、投資対象ファンドの変更等により将来的に変動することがあります。

（略）

<訂正後>

（略）

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

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

なお、投資対象ファンドにおいて、年率0.60%（税抜）程度の運用報酬等が別途課されるため、ファンドにおいては、合計で最大年率1.49%（税込）程度の信託報酬等を実質的に支弁する予定です。ただし、この実質的な信託報酬等は、2020年4月末日現在の投資対象ファンドに基づくものであり、投資対象ファンドの変更等により将来的に変動することがあります。

（略）

（5）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

2020年1月1日以降の分配時において、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、2019年10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4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】

(2020年4月30日現在)

| 資産の種類 | 国・地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|------------------|---------|----------------|-------------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 16,963,003,907 | 33.41 |
| 投資証券 | ルクセンブルグ | 33,369,501,048 | 65.72 |
| 預金・その他の資産（負債控除後） | - | 444,531,477 | 0.88 |
| 合計（純資産総額） | | 50,777,036,432 | 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。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(2020年4月30日現在)

| 順位 | 銘柄名 | 通貨 地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価(円) 簿価金額(円) | 評価単価(円) 時価金額(円) | 投資 比率 (%) |
|----|--------------------------------------|--------------------|--------------|-------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------|
| 1 | FF-EURO HIGH YIELD A-MDIST-EURO | ユーロ ルクセンブルグ | 投資証券 | 14,445,373.35 | 1,171.59 16,924,199,416 | 1,177.40 17,007,982,582 | 33.50 |
| 2 | 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) | 日本・円 日本 | 投資信託 受益証券 | 26,364,631,500.00 | 0.6443 16,989,368,538 | 0.6434 16,963,003,907 | 33.41 |
| 3 | FF-ASIAN HIGH YIELD FDI-MDIST-USD | アメリカ・ドル ルクセンブルグ | 投資証券 | 21,933,724.03 | 745.31 16,347,454,124 | 745.95 16,361,518,466 | 32.22 |

種類別投資比率

(2020年4月30日現在)

| 種類 | 国内 / 外国 | 投資比率 (%) |
|-------------|---------|-------------|
| 投資信託受益証券 | 国内 | 33.41 |
| 投資証券 | 外国 | 65.72 |
| 合計（対純資産総額比） | | 99.12 |

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

2020年4月末日および同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次のとおりです。

| 年月日 | 純資産総額 (百万円) (分配落) | 純資産総額 (百万円) (分配付) | 1口当たり純資産額 (円) (分配落) | 1口当たり純資産額 (円) (分配付) |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 2010年9月27日 (第4特定期間) | 1,437 | 1,452 | 1.4801 | 1.4961 |
| 2011年3月28日 (第5特定期間) | 2,030 | 2,053 | 1.4252 | 1.4412 |
| 2011年9月27日 (第6特定期間) | 2,356 | 2,390 | 1.1146 | 1.1306 |
| 2012年3月27日 (第7特定期間) | 3,096 | 3,136 | 1.2498 | 1.2658 |
| 2012年9月27日 (第8特定期間) | 5,267 | 5,343 | 1.1137 | 1.1297 |
| 2013年3月27日 (第9特定期間) | 6,073 | 6,145 | 1.3419 | 1.3579 |
| 2013年9月27日 (第10特定期間) | 9,456 | 9,586 | 1.3175 | 1.3355 |
| 2014年3月27日 (第11特定期間) | 28,106 | 28,535 | 1.3095 | 1.3295 |
| 2014年9月29日 (第12特定期間) | 72,629 | 73,775 | 1.2673 | 1.2873 |
| 2015年3月27日 (第13特定期間) | 94,366 | 95,936 | 1.2019 | 1.2219 |
| 2015年9月28日 (第14特定期間) | 132,340 | 134,776 | 1.0865 | 1.1065 |
| 2016年3月28日 (第15特定期間) | 135,407 | 138,365 | 0.9158 | 0.9358 |
| 2016年9月27日 (第16特定期間) | 138,548 | 141,372 | 0.7848 | 0.8008 |
| 2017年3月27日 (第17特定期間) | 133,546 | 135,185 | 0.8148 | 0.8248 |
| 2017年9月27日 (第18特定期間) | 126,772 | 128,313 | 0.8225 | 0.8325 |
| 2018年3月27日 (第19特定期間) | 105,614 | 106,623 | 0.7326 | 0.7396 |
| 2018年9月27日 (第20特定期間) | 92,317 | 93,207 | 0.7259 | 0.7329 |
| 2019年3月27日 (第21特定期間) | 72,223 | 72,754 | 0.6799 | 0.6849 |
| 2019年9月27日 (第22特定期間) | 63,502 | 63,992 | 0.6470 | 0.6520 |
| 2020年3月27日 (第23特定期間) | 49,357 | 49,819 | 0.5342 | 0.5392 |
| 2019年4月末日 | 71,285 | - | 0.6939 | - |
| 2019年5月末日 | 67,529 | - | 0.6639 | - |
| 2019年6月末日 | 67,015 | - | 0.6651 | - |

| | | | | |
|------------|--------|---|--------|---|
| 2019年7月末日 | 65,990 | - | 0.6641 | - |
| 2019年8月末日 | 63,414 | - | 0.6434 | - |
| 2019年9月末日 | 63,582 | - | 0.6477 | - |
| 2019年10月末日 | 63,473 | - | 0.6561 | - |
| 2019年11月末日 | 62,595 | - | 0.6539 | - |
| 2019年12月末日 | 62,899 | - | 0.6613 | - |
| 2020年1月末日 | 61,408 | - | 0.6532 | - |
| 2020年2月末日 | 60,281 | - | 0.6450 | - |
| 2020年3月末日 | 49,704 | - | 0.5377 | - |
| 2020年4月末日 | 50,777 | - | 0.5499 | - |

【分配の推移】

| 期 | 1口当たりの分配金(円) |
|----------------------------|--------------|
| 第4特定期間(第16期～第21期計算期間合計) | 0.0930 |
| 第5特定期間(第22期～第27期計算期間合計) | 0.0960 |
| 第6特定期間(第28期～第33期計算期間合計) | 0.0960 |
| 第7特定期間(第34期～第39期計算期間合計) | 0.0960 |
| 第8特定期間(第40期～第45期計算期間合計) | 0.0960 |
| 第9特定期間(第46期～第51期計算期間合計) | 0.0960 |
| 第10特定期間(第52期～第57期計算期間合計) | 0.1060 |
| 第11特定期間(第58期～第63期計算期間合計) | 0.1200 |
| 第12特定期間(第64期～第69期計算期間合計) | 0.1200 |
| 第13特定期間(第70期～第75期計算期間合計) | 0.1200 |
| 第14特定期間(第76期～第81期計算期間合計) | 0.1200 |
| 第15特定期間(第82期～第87期計算期間合計) | 0.1200 |
| 第16特定期間(第88期～第93期計算期間合計) | 0.1000 |
| 第17特定期間(第94期～第99期計算期間合計) | 0.0660 |
| 第18特定期間(第100期～第105期計算期間合計) | 0.0600 |
| 第19特定期間(第106期～第111期計算期間合計) | 0.0540 |
| 第20特定期間(第112期～第117期計算期間合計) | 0.0420 |
| 第21特定期間(第118期～第123期計算期間合計) | 0.0380 |
| 第22特定期間(第124期～第129期計算期間合計) | 0.0300 |
| 第23特定期間(第130期～第135期計算期間合計) | 0.0300 |

【収益率の推移】

| 期 | 収益率(%) |
|----------------------------|--------|
| 第4特定期間（第16期～第21期計算期間合計） | 4.4 |
| 第5特定期間（第22期～第27期計算期間合計） | 2.8 |
| 第6特定期間（第28期～第33期計算期間合計） | 15.1 |
| 第7特定期間（第34期～第39期計算期間合計） | 20.7 |
| 第8特定期間（第40期～第45期計算期間合計） | 3.2 |
| 第9特定期間（第46期～第51期計算期間合計） | 29.1 |
| 第10特定期間（第52期～第57期計算期間合計） | 6.1 |
| 第11特定期間（第58期～第63期計算期間合計） | 8.5 |
| 第12特定期間（第64期～第69期計算期間合計） | 5.9 |
| 第13特定期間（第70期～第75期計算期間合計） | 4.3 |
| 第14特定期間（第76期～第81期計算期間合計） | 0.4 |
| 第15特定期間（第82期～第87期計算期間合計） | 4.7 |
| 第16特定期間（第88期～第93期計算期間合計） | 3.4 |
| 第17特定期間（第94期～第99期計算期間合計） | 12.2 |
| 第18特定期間（第100期～第105期計算期間合計） | 8.3 |
| 第19特定期間（第106期～第111期計算期間合計） | 4.4 |
| 第20特定期間（第112期～第117期計算期間合計） | 4.8 |
| 第21特定期間（第118期～第123期計算期間合計） | 1.1 |
| 第22特定期間（第124期～第129期計算期間合計） | 0.4 |
| 第23特定期間（第130期～第135期計算期間合計） | 12.8 |

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

（４）【設定及び解約の実績】

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

| 期 | 設定数量 (口) | 解約数量 (口) | 発行済数量 (口) |
|------------------------------------|----------------|----------------|-----------------|
| 第4特定期間 (2010年3月30日～2010年9月27日) | 898,819,212 | 120,224,512 | 970,878,150 |
| 第5特定期間 (2010年9月28日～2011年3月28日) | 881,811,974 | 427,854,049 | 1,424,836,075 |
| 第6特定期間 (2011年3月29日～2011年9月27日) | 1,007,884,658 | 318,339,979 | 2,114,380,754 |
| 第7特定期間 (2011年9月28日～2012年3月27日) | 812,026,640 | 448,664,734 | 2,477,742,660 |
| 第8特定期間 (2012年3月28日～2012年9月27日) | 2,808,085,254 | 555,915,015 | 4,729,912,899 |
| 第9特定期間 (2012年9月28日～2013年3月27日) | 3,422,434,598 | 3,626,324,707 | 4,526,022,790 |
| 第10特定期間 (2013年3月28日～2013年9月27日) | 3,929,941,958 | 1,277,882,162 | 7,178,082,586 |
| 第11特定期間 (2013年9月28日～2014年3月27日) | 15,790,693,854 | 1,506,265,482 | 21,462,510,958 |
| 第12特定期間 (2014年3月28日～2014年9月29日) | 41,749,108,888 | 5,901,735,573 | 57,309,884,273 |
| 第13特定期間 (2014年9月30日～2015年3月27日) | 40,097,524,285 | 18,896,138,899 | 78,511,269,659 |
| 第14特定期間 (2015年3月28日～2015年9月28日) | 55,918,886,881 | 12,630,455,918 | 121,799,700,622 |
| 第15特定期間 (2015年9月29日～2016年3月28日) | 44,389,825,878 | 18,329,085,233 | 147,860,441,267 |
| 第16特定期間 (2016年3月29日～2016年9月27日) | 48,945,513,880 | 20,273,194,485 | 176,532,760,662 |
| 第17特定期間 (2016年9月28日～2017年3月27日) | 44,415,211,191 | 57,052,377,715 | 163,895,594,138 |
| 第18特定期間 (2017年3月28日～2017年9月27日) | 26,759,335,398 | 36,532,663,057 | 154,122,266,479 |
| 第19特定期間 (2017年9月28日～2018年3月27日) | 21,524,575,832 | 31,480,009,150 | 144,166,833,161 |
| 第20特定期間 (2018年3月28日～2018年9月27日) | 7,547,440,152 | 24,542,009,517 | 127,172,263,796 |
| 第21特定期間 (2018年9月28日～2019年3月27日) | 3,991,804,919 | 24,937,276,546 | 106,226,792,169 |
| 第22特定期間 (2019年3月28日～2019年9月27日) | 6,473,487,595 | 14,549,005,880 | 98,151,273,884 |
| 第23特定期間 (2019年9月28日～2020年3月27日) | 8,844,515,215 | 14,600,038,790 | 92,395,750,309 |

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

< 参考情報 >

(別途記載がない限り2020年4月30日現在)

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

※下記データは過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

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

基準価額・純資産の推移



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

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 5,499円 |
| 純資産総額 | 507.8億円 |

分配の推移

(1万円当たり/税引前)

| 決算期 | 分配金 |
|----------|---------|
| 2019年12月 | 50円 |
| 2020年1月 | 50円 |
| 2020年2月 | 50円 |
| 2020年3月 | 50円 |
| 2020年4月 | 50円 |
| 直近1年間累計 | 650円 |
| 設定来累計 | 17,990円 |

主要な資産の状況

ファンド別組入状況

| | |
|----------------------------------|-------|
| フィデリティ・ファンズーアジア・ハイ・イールド・ファンド | 32.2% |
| フィデリティ・ファンズーヨーロッパ・ハイ・イールド・ファンド | 33.5% |
| 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) | 33.4% |
| 現金・その他 | 0.9% |

通貨別組入状況(2020年3月末現在)

| | |
|--------|-------|
| アメリカドル | 66.4% |
| ユーロ | 33.2% |
| その他 | 0.3% |

※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。

※通貨別組入状況は各組入れファンドの開示情報をもとに、各ファンドに1/3ずつ投資という仮定のもと弊社にて計算した概算値です。

※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。

投資対象ファンドの運用状況(2020年3月末現在)

資産別組入状況

| | フィデリティ・ファンズー アジア・ハイ・イールド・ファンド | フィデリティ・ファンズー ヨーロッパ・ハイ・イールド・ファンド | 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)(マザーファンド・ベース) |
|---------------|----------------------------------|------------------------------------|---|
| 債券 | 93.9% | 88.3% | 90.1% |
| 転換社債 | - | - | 1.1% |
| 株式 | - | - | 1.9% |
| 新株予約権証券(ワラント) | - | - | 0.0% |
| 現金・その他 | 6.1% | 11.7% | 6.9% |

格付別組入状況(対投資債券比率)

| | フィデリティ・ファンズー アジア・ハイ・イールド・ファンド | フィデリティ・ファンズー ヨーロッパ・ハイ・イールド・ファンド | 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)(マザーファンド・ベース) |
|-----------|----------------------------------|------------------------------------|---|
| A以上 | 0.0% | 1.5% | 0.0% |
| BBB/Baa | 3.4% | 6.7% | 12.5% |
| BB/Ba | 33.0% | 41.1% | 40.7% |
| B | 50.9% | 37.7% | 31.5% |
| CCC/Caa以下 | 4.2% | 11.4% | 11.8% |
| 格付なし | 8.5% | 1.6% | 3.5% |

投資対象ファンドの運用状況(2020年3月末現在)

組入上位5業種

| フィデリティ・ファンズ アジア・ハイ・イールド・ファンド | | フィデリティ・ファンズ ヨーロッパ・ハイ・イールド・ファンド | | 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)(マザーファンド・ベース) | |
|---------------------------------|-------|-----------------------------------|-------|---|-------|
| 1 不動産 | 44.5% | 通信 | 24.1% | エネルギー | 12.4% |
| 2 消費(景気敏感) | 8.7% | 銀行/証券 | 14.8% | 金融/投資 | 12.0% |
| 3 銀行/証券 | 6.2% | 消費(景気敏感) | 9.4% | 通信 | 11.0% |
| 4 素材 | 6.1% | その他金融 | 8.7% | 健康サービス | 10.0% |
| 5 公益 | 5.5% | 消費(生活必需品) | 5.8% | メディア・ケーブル | 9.3% |

組入上位銘柄

| フィデリティ・ファンズ アジア・ハイ・イールド・ファンド | | フィデリティ・ファンズ ヨーロッパ・ハイ・イールド・ファンド | | 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)(マザーファンド・ベース) | |
|---|------|--------------------------------------|------|---|------|
| 1 永利澳門(ウィン・マカオ) 5.125% 12/15/29 RGS | 1.9% | YPSO ファイナンス BIS 8% 5/15/27 RGS | 2.0% | CCOホールディングス/キャピタル 5.125% 2027/05/01 | 2.3% |
| 2 メルコ・リゾーツ・ファイナンス 5.375% 12/04/29 RGS | 1.6% | オラノ 3.375% 04/23/26 RGS | 1.7% | パシフィック・ガス&エレクトリック 6.05% 2034/03/01 | 1.6% |
| 3 グローバルA&Tエレクトロニクス 8.5% 01/12/23 | 1.3% | リンカーン 3.625% 04/01/24 RGS | 1.2% | アリー 8% 2031/11/01 | 1.6% |
| 4 遼洋地産控股(シノ オーシャン) 4.9%/VAR PERP RGS | 1.1% | コトアグローバル・ホールディングス 4.125% 8/25 RGS | 1.2% | シティグループ 5.35% 2049/12/31 | 1.5% |
| 5 中国恒大集団(チャイナエバ・ブランド グループ) 8.75% 6/28/25 RGS | 1.1% | ヴァージン メディア ファイナンス 6.25 3/29RGS | 1.2% | インタージェン 7% 2023/06/30 | 1.2% |

※フィデリティ・ファンズ・アジア・ハイ・イールド・ファンド、フィデリティ・ファンズ・ヨーロッパ・ハイ・イールド・ファンドに関する事項は、ファンドの管理事務代行会社の提供するデータに基づき作成しております。

※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)の「資産別組入状況」の「債券」には、金銭債権が含まれます。「組入上位5業種」は対投資資産比率です。クーポンは、銘柄属性として発行時に定められたものを表示しております。

※格付は、S&P社、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、S&P社または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、格付のない場合は、「格付なし」に分類しています。

※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。

※フィデリティ投信が作成時点で取得可能な投資対象ファンドの開示資料のデータに基づき作成しております。ファンドによってはデータの分類方法や評価基準日異なる場合があるため、概算・推定値となります。掲載データに関する正確性、信頼性、完全性を保証するものではありません。あくまでもファンドの概略をご理解いただくことを目的として作成されておりますことにご留意ください。

年間収益率の推移



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

※2020年は年初以降4月末までの実績となります。

第2【管理及び運営】

4【受益者の権利等】

<訂正前>

(1) 収益分配金に対する請求権

(略)

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

(略)

<訂正後>

(1) 収益分配金に対する請求権

(略)

受益者が収益分配金について支払開始日から10年間その支払を請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

(略)

第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23特定期間（2019年9月28日から2020年3月27日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

1【財務諸表】

【フィデリティ・グローバル・ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第22特定期間 2019年9月27日現在 | 第23特定期間 2020年3月27日現在 |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 12,456 | 21,343 |
| 金銭信託 | 1,249,682,493 | 858,997,912 |
| 投資信託受益証券 | 20,973,730,758 | 16,541,837,261 |
| 投資証券 | 41,884,798,042 | 32,572,152,396 |
| 未収配当金 | 96,968,567 | - |
| その他未収収益 | 53,720,658 | 47,563,704 |
| 流動資産合計 | 64,258,912,974 | 50,020,572,616 |
| 資産合計 | 64,258,912,974 | 50,020,572,616 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 490,756,369 | 461,978,751 |
| 未払解約金 | 213,148,569 | 158,016,435 |
| 未払受託者報酬 | 1,433,269 | 1,203,914 |
| 未払委託者報酬 | 44,092,511 | 35,946,103 |
| その他未払費用 | 7,423,270 | 6,080,400 |
| 流動負債合計 | 756,853,988 | 663,225,603 |
| 負債合計 | 756,853,988 | 663,225,603 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 98,151,273,884 | 92,395,750,309 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 34,649,214,898 | 43,038,403,296 |
| （分配準備積立金） | 609,724,178 | - |
| 元本等合計 | 63,502,058,986 | 49,357,347,013 |
| 純資産合計 | 63,502,058,986 | 49,357,347,013 |
| 負債純資産合計 | 64,258,912,974 | 50,020,572,616 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第22特定期間 自 2019年3月28日 至 2019年9月27日 | 第23特定期間 自 2019年9月28日 至 2020年3月27日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 1,716,063,294 | 1,527,001,471 |
| 受取利息 | 21,432 | 17,779 |
| 有価証券売買等損益 | 18,551,679 | 9,642,295,889 |
| 為替差損益 | 1,792,627,774 | 657,504,605 |
| その他収益 | 110,734,775 | 100,897,521 |
| 営業収益合計 | 15,640,048 | 7,356,874,513 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 8,891,232 | 8,311,186 |
| 委託者報酬 | 276,209,979 | 253,927,232 |
| その他費用 | 7,740,896 | 6,426,066 |
| 営業費用合計 | 292,842,107 | 268,664,484 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 277,202,059 | 7,625,538,997 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 277,202,059 | 7,625,538,997 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 277,202,059 | 7,625,538,997 |
| 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（ ） | 29,492,686 | 78,458,687 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 34,003,734,762 | 34,649,214,898 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 4,853,934,287 | 5,069,287,880 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 4,853,934,287 | 5,069,287,880 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 2,186,601,256 | 3,073,829,608 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 2,186,601,256 | 3,073,829,608 |
| 分配金 | 3,006,118,422 | 2,837,566,360 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 34,649,214,898 | 43,038,403,296 |

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|----------------------------------|---|
| <p>1．有価証券の評価基準及び評価方法</p> | <p>（１）投資信託受益証券 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、金融商品取引所等に上場されているものについては、金融商品取引所における最終相場（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、金融商品取引所等に上場されていないものについては、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。</p> <p>（２）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．デリバティブの評価基準及び評価方法</p> | <p>為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> |
| <p>3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> | <p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第22特定期間 2019年9月27日現在 | 第23特定期間 2020年3月27日現在 |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 1. 元本の推移 | | |
| 期首元本額 | 106,226,792,169 円 | 98,151,273,884 円 |
| 期中追加設定元本額 | 6,473,487,595 円 | 8,844,515,215 円 |
| 期中一部解約元本額 | 14,549,005,880 円 | 14,600,038,790 円 |
| 2. 受益権の総数 | 98,151,273,884 口 | 92,395,750,309 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 | 34,649,214,898 円 | 43,038,403,296 円 |
| 4. 1口当たり純資産額 | 0.6470 円 | 0.5342 円 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第22特定期間 自 2019年3月28日 至 2019年9月27日 | 第23特定期間 自 2019年9月28日 至 2020年3月27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0.23%以内の額 | 1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左 |
| 2. 分配金の計算過程 (自2019年3月28日 至2019年5月7日) 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(487,950,129円)、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(10,659,865,874円)及び分配準備積立金(1,176,178,749円)より分配対象収益は12,323,994,752円(1口当たり0.120000円)であり、うち513,499,043円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。 | 2. 分配金の計算過程 (自2019年9月28日 至2019年10月28日) 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(265,350,921円)、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(9,227,854,950円)及び分配準備積立金(595,359,723円)より分配対象収益は10,088,565,594円(1口当たり0.104170円)であり、うち484,236,061円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。 |
| (自2019年5月8日 至2019年5月27日) 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(85,999,102円)、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(10,547,303,436円)及び分配準備積立金(1,160,463,391円)より分配対象収益は11,793,765,929円(1口当たり0.115866円)であり、うち508,939,638円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。 | (自2019年10月29日 至2019年11月27日) 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(238,557,430円)、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(9,124,438,592円)及び分配準備積立金(367,611,707円)より分配対象収益は9,730,607,729円(1口当たり0.101717円)であり、うち478,317,186円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。 |

(自2019年5月28日 至2019年6月27日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(262,144,836円)、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(10,027,375,744円)及び分配準備積立金(1,137,919,009円)より分配対象収益は11,427,439,589円(1口当たり0.113507円)であり、うち503,381,505円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自2019年6月28日 至2019年7月29日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(248,536,083円)、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(9,683,624,943円)及び分配準備積立金(1,111,941,505円)より分配対象収益は11,044,102,531円(1口当たり0.111047円)であり、うち497,273,445円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自2019年7月30日 至2019年8月27日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(254,645,132円)、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(9,352,335,645円)及び分配準備積立金(1,091,988,955円)より分配対象収益は10,698,969,732円(1口当たり0.108670円)であり、うち492,268,422円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自2019年8月28日 至2019年9月27日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(262,678,082円)、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(9,341,723,854円)及び分配準備積立金(837,802,465円)より分配対象収益は10,442,204,401円(1口当たり0.106389円)であり、うち490,756,369円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自2019年11月28日 至2019年12月27日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(237,462,891円)、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(9,075,552,285円)及び分配準備積立金(124,829,058円)より分配対象収益は9,437,844,234円(1口当たり0.099265円)であり、うち475,384,105円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自2019年12月28日 至2020年1月27日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(247,950,311円)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(8,876,786,001円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は9,124,736,312円(1口当たり0.096922円)であり、うち470,724,774円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自2020年1月28日 至2020年2月27日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(233,579,068円)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(8,585,448,316円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は8,819,027,384円(1口当たり0.094437円)であり、うち466,925,483円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

(自2020年2月28日 至2020年3月27日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(194,147,128円)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(8,264,469,055円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は8,458,616,183円(1口当たり0.091548円)であり、うち461,978,751円(1口当たり0.005000円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

| | |
|-------------------------|---|
| 1．金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |
| 2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンド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）上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。</p> <p>当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種 類 | 第22特定期間 2019年9月27日現在 | 第23特定期間 2020年3月27日現在 |
|----------|----------------------------|----------------------------|
| | 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円) | 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円) |
| 投資信託受益証券 | 504,806,954 | 3,516,747,462 |
| 投資証券 | 96,871,497 | 6,847,817,445 |
| 合 計 | 601,678,451 | 10,364,564,907 |

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(ア) 株式

該当事項はありません。

(イ) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-------------|------------|---------------------------------------|----------------|------------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | 日本円 | 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) | 26,784,062,924 | 16,541,837,261 | |
| | 日本円 小計 | | 26,784,062,924 | 16,541,837,261 | |
| 投資信託受益証券 合計 | | | | 16,541,837,261 | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | FF-ASIAN HIGH YIELD FD A-MDIST-USD | 21,933,724.03 | 144,280,036.66 | |
| | アメリカ・ドル 小計 | | 21,933,724.03 | 144,280,036.66 (15,719,309,994) | |
| | ユーロ | FF-EURO HIGH YIELD A-MDIST-EURO | 14,612,768.17 | 140,253,348.89 | |
| | ユーロ 小計 | | 14,612,768.17 | 140,253,348.89 (16,852,842,402) | |
| 投資証券 合計 | | | | 32,572,152,396 (32,572,152,396) | |
| 合計 | | | | 49,113,989,657 (32,572,152,396) | |

(注) 投資信託受益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 投資証券 時価比率 | 合計金額に 対する比率 |
|---------|----------|--------------------|----------------|
| アメリカ・ドル | 投資証券 1銘柄 | 100% | 48.26% |
| ユーロ | 投資証券 1銘柄 | 100% | 51.74% |

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(2020年4月30日現在)

| 種 類 | 金 額 | 単 位 |
|-----------------|----------------|-----|
| 資産総額 | 50,855,057,214 | 円 |
| 負債総額 | 78,020,782 | 円 |
| 純資産総額(-) | 50,777,036,432 | 円 |
| 発行済数量 | 92,332,777,680 | 口 |
| 1単位当たり純資産額(/) | 0.5499 | 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10月末日現在）

（略）

< 訂正後 >

(1) 資本金等（2020年4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10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158本、親投資信託52本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,302,448,296,499円です。

< 訂正後 >

（略）

2020年4月30日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、追加型株式投資信託148本、親投資信託47本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額2,873,902,185,594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 |
| 退職給付債務の期末残高 | 4,776,447 |

(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 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 4,786,190 |
| 退職給付引当金 | 4,786,190 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 4,786,190 |

(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 |
| 確定給付型年金制度に係る退職給付費用 | 143,687 |

(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 | 野村信託銀行株式会社 | 35,000百万円 | 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。 |
| 販売会社 | フィデリティ証券株式会社 | 9,257百万円 | 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。 |
| | 楽天証券株式会社 | 7,495百万円 | |
| | みずほ証券株式会社 | 125,167百万円 | |
| | 西日本シティTT証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| | 株式会社SBI証券 | 48,323百万円 | |
| | あかつき証券株式会社 | 3,067百万円 | |
| | リテラ・クレア証券株式会社 | 3,794百万円 | |
| | 岡三オンライン証券株式会社 | 2,500百万円 | |
| | エース証券株式会社 | 8,831百万円 | |
| | auカブコム証券株式会社 | 7,196百万円 | |
| | 岡三証券株式会社 | 5,000百万円 | |
| | 八十二証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| | ぐんぎん証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| | SMB C日興証券株式会社 | 10,000百万円 | |
| | 松井証券株式会社 | 11,945百万円 | |
| 野村證券株式会社 | 10,000百万円 | | |
| 東海東京証券株式会社 | 6,000百万円 | | |

| | | | |
|--------|------------------------------|---|--|
| | OKB証券株式会社 | 1,500百万円 | |
| | 株式会社西日本シティ銀行 | 85,745百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| | 株式会社大垣共立銀行 | 46,733百万円 | |
| | 株式会社みなと銀行 | 27,484百万円 | |
| | 株式会社大分銀行 | 19,598百万円 | |
| | スルガ銀行株式会社 | 30,043百万円 | |
| | 株式会社東京スター銀行 | 26,000百万円 | |
| | 株式会社三重銀行 | 15,295百万円 | |
| | 株式会社ジャパンネット銀行 | 37,250百万円 | |
| | 株式会社イオン銀行 | 51,250百万円 | |
| | 株式会社長崎銀行 | 6,121百万円 | |
| | 株式会社第四銀行 | 32,776百万円 | |
| | 株式会社福岡銀行 | 82,329百万円 | |
| | 株式会社親和銀行 | 36,878百万円 | |
| | 株式会社熊本銀行 | 33,847百万円 | |
| | 株式会社北海道銀行 | 93,524百万円 | |
| | 株式会社常陽銀行 | 85,113百万円 | |
| | 株式会社静岡銀行 | 90,845百万円 | |
| | 株式会社筑邦銀行 | 8,000百万円 | |
| | 株式会社関西みらい銀行 | 38,971百万円 | |
| | 株式会社きらぼし銀行 | 43,734百万円 | |
| | 株式会社十八銀行 | 24,404百万円 | |
| 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。 |
| | FILインベストメント・マネジメント(香港)・リミテッド | 178,000,000香港ドル (約2,504百万円 [*]) [*] 1香港ドル14.07円で換算 (2019年12月末日現在) | 主として香港においてファンドの運用、調査、販売業務を営んでいます。 |

新規募集は行なっておりません。

独立監査人の監査報告書

2020年5月26日

フィデリティ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
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・グローバル・ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）の2019年9月28日から2020年3月27日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ・グローバル・ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）の2020年3月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

その他の事項

ファンドの2019年9月27日をもって終了した前特定期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2019年11月20日付けで無限定適正意見を表明している。

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

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。