

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2021年10月15日提出
<b>【発行者名】</b>	フィデリティ投信株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 デレック・ヤング
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都港区六本木七丁目7番7号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	照沼 加奈子
<b>【電話番号】</b>	03 - 4560 - 6000
<b>【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】</b>	フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース(為替ヘッジ付き) フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース(為替ヘッジなし)
<b>【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】</b>	各ファンドにつき2兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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、2021年4月16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）

マザーファンドの資産・アロケーション、米国国債／政府機関債、米国高利回り社債（ハイ・イールド・ボンド）、エマージング諸国等に関する運用にあたっては、FIAM LLC<sup>(注)</sup>に、運用の指図に関する権限を委託します。

（注）当該運用の委託先は2020年11月30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・エルエルシー」から「FIAM LLC」に変更になりました。なお、当該変更は、運用担当者所属の組織変更によるもので、当該マザーファンドおよびファンドに係る運用方針や運用スタイル等に変更ありません。

（略）

<訂正後>

（略）

ファンドの特色

（略）

マザーファンドの資産・アロケーション、米国国債／政府機関債、米国高利回り社債（ハイ・イールド・ボンド）、エマージング諸国等に関する運用にあたっては、FIAM LLCに、運用の指図に関する権限を委託します。

（略）

##### （3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（略）

委託会社の概況（2021年2月末日現在）

（略）

<訂正後>

（略）

委託会社の概況（2021年8月末日現在）

（略）

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

&lt;訂正前&gt;

(略)

ファンドのベンチマーク<sup>\*1</sup>

(略)

債券セクター	ベンチマーク	構成割合
米国国債 / 政府機関債	ブルームバーグ・バークレイズ米国政府債インデックス	30%
(略)		

(略)

運用方針

(a) ファンドの運用について

(略)

&lt;ファンドの投資対象債券セクター&gt;

安定性・流動性重視 / グローバル分散

債券セクター	概要	ベンチマーク	基本配分
米国国債 / 政府機関債	米国政府や米国の政府系機関が発行する債券	ブルームバーグ・バークレイズ米国政府債インデックス	30%
(略)			

(略)

上記の文中で示された考え方は、2021年2月末日現在のものであり、今後、変更となる場合があります。

&lt;訂正後&gt;

(略)

ファンドのベンチマーク<sup>\*1</sup>

(略)

債券セクター	ベンチマーク	構成割合
米国国債 / 政府機関債	ブルームバーグ米国政府債インデックス	30%
(略)		

(略)

運用方針

## (a) ファンドの運用について

(略)

## &lt;ファンドの投資対象債券セクター&gt;

## 安定性・流動性重視 / グローバル分散

債券セクター	概要	ベンチマーク	基本配分
米国国債 / 政府機関債	米国政府や米国の政府系機関が発行する債券	ブルームバーグ米国政府債インデックス	30%
(略)			

(略)

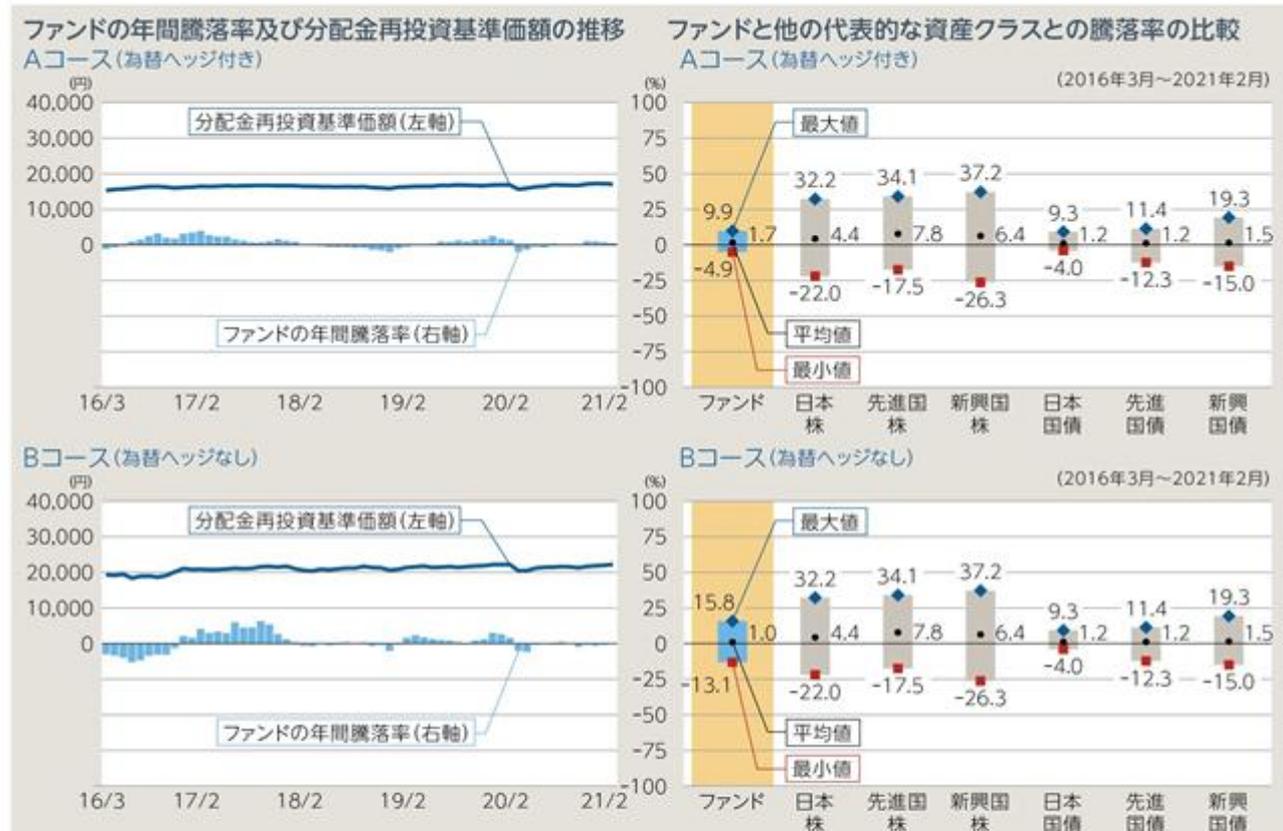
上記の文中で示された考え方は、2021年8月末日現在のものであり、今後、変更となる場合があります。

### 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2016年3月～2021年2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、当該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。

※2016年3月～2021年2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

<b>日本株</b> 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。
<b>先進国株</b> 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。
<b>新興国株</b> 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。
<b>日本国債</b> NOMURA-BPI 国債	NOMURA-BPI 国債は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI 国債の知的財産権およびその他一切の権利は野村證券に帰属します。なお、野村證券株式会社はNOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて運用される当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
<b>先進国債</b> 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。
<b>新興国債</b> JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円ベース)	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。当指数の著作権はジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属しております。指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利はJPMorgan Chase & Co.及び関係会社(「JPモルガン」)に帰属しております。JPモルガンは、指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。JPモルガンは、指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドを推奨するものでもなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

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

&lt;訂正後&gt;

(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

Aコース(為替ヘッジ付き)



Bコース(為替ヘッジなし)



ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

Aコース(為替ヘッジ付き)



Bコース(為替ヘッジなし)



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2016年9月～2021年8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。

※2016年9月～2021年8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(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、およびその他の知的所有権は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、およびその他の知的所有権はMSCI Inc.に帰属しております。
日本国債 NOMURA-BPI 国債	NOMURA-BPI 国債は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI 国債の知的財産権およびその他の権利は野村證券に帰属します。なお、野村證券株式会社はNOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて運用される当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債 JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円ベース)	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。当指数の著作権はジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属しております。指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利はJPMorgan Chase & Co.及び関係会社([JPモルガン])に帰属しております。JPモルガンは、指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。JPモルガンは、指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドを推奨するものでもなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

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



#### 4【手数料等及び税金】

##### （５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、2021年2月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更となる場合があります。

（略）

<訂正後>

（略）

上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、2021年8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（為替ヘッジ付き）

（2021年8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	34,618,367,965	100.19
預金・その他の資産（負債控除後）	-	67,078,726	0.19
合計（純資産総額）		34,551,289,239	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

（2021年8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	33,970,602,876	98.32

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

Bコース（為替ヘッジなし）

（2021年8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	4,217,584,002	100.05
預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,104,222	0.05
合計（純資産総額）		4,215,479,780	100.00

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

（参考）マザーファンドの投資状況

フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

（2021年8月31日現在）

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	967,761,028	2.15
	小計	967,761,028	2.15
新株予約権証券	アメリカ	76,998,466	0.17
	ケイマン諸島	2,457,619	0.01
	小計	79,456,085	0.18
国債証券	アメリカ	11,086,553,004	24.58
	ドイツ	2,343,230,651	5.20
	イスラエル	1,155,716,980	2.56
	日本	1,094,943,267	2.43
	イギリス	1,089,726,207	2.42
	カナダ	1,086,999,996	2.41
	フランス	519,489,726	1.15
	ウクライナ	438,142,658	0.97
	イタリア	278,216,487	0.62
	トルコ	243,295,059	0.54
	エジプト	211,186,653	0.47
	インドネシア	196,487,627	0.44
	カタール	164,314,512	0.36
	ベトナム	157,993,734	0.35
	オランダ	138,651,514	0.31
	ナイジェリア	137,929,995	0.31
	メキシコ	113,264,347	0.25
	アルゼンチン	112,908,809	0.25
	パラグアイ	106,409,461	0.24
	ドミニカ共和国	105,898,316	0.23
	コロンビア	104,288,550	0.23
	ロシア	93,117,721	0.21
	ブラジル	90,379,639	0.20
	アラブ首長国連邦	87,614,918	0.19
	オマーン	81,890,815	0.18
	アンゴラ	73,608,421	0.16
	ケニア	70,955,561	0.16
	エクアドル	62,157,964	0.14
	コートジボアール	54,407,369	0.12
	ペルー	53,321,211	0.12
	ガーナ	49,240,695	0.11
	ガボン	49,040,928	0.11
パナマ	44,860,960	0.10	
パキスタン	44,316,735	0.10	

	ヴェネズエラ	39,985,741	0.09
	エルサルバドル	39,410,827	0.09
	ルーマニア	37,579,343	0.08
	ウルグアイ	32,410,609	0.07
	スリランカ	30,009,734	0.07
	バルバドス	28,483,495	0.06
	グアテマラ	26,242,581	0.06
	レバノン	26,079,056	0.06
	モンゴル	23,108,893	0.05
	ヨルダン	22,941,625	0.05
	グルジア	22,337,175	0.05
	ルワンダ	22,331,680	0.05
	ウズベキスタン	21,622,825	0.05
	サウジアラビア	21,595,350	0.05
	モロッコ	21,210,700	0.05
	セルビア	21,091,129	0.05
	コスタリカ	18,400,821	0.04
	ジャマイカ	15,386,000	0.03
	ベラルーシ	10,453,551	0.02
	ザンビア	6,780,830	0.02
	アルメニア	3,766,823	0.01
	チュニジア	967,120	0.00
	小計	22,232,756,398	49.30
地方債証券	アルゼンチン	40,561,031	0.09
	小計	40,561,031	0.09
特殊債券	アメリカ	727,895,310	1.61
	メキシコ	434,580,625	0.96
	イギリス領バージン諸島	110,744,032	0.25
	カタール	69,967,835	0.16
	アルゼンチン	43,131,868	0.10
	アゼルバイジャン	42,235,944	0.09
	インドネシア	39,576,221	0.09
	チリ	35,846,424	0.08
	アラブ首長国連邦	25,500,756	0.06
	オランダ	23,158,568	0.05
	ウズベキスタン	22,584,450	0.05
	モロッコ	22,172,325	0.05
	オマーン	22,144,850	0.05
	ヴェネズエラ	11,932,118	0.03
	小計	1,631,471,326	3.62
社債券	アメリカ	12,688,354,514	28.13
	オランダ	1,063,990,030	2.36
	カナダ	775,872,338	1.72

ケイマン諸島	586,370,750	1.30	
ルクセンブルグ	401,246,021	0.89	
マーシャル諸島	364,843,410	0.81	
イギリス	310,704,362	0.69	
アイルランド	277,724,933	0.62	
パナマ	264,608,472	0.59	
バミューダ	207,908,628	0.46	
ブラジル	207,180,128	0.46	
フランス	153,453,200	0.34	
サウジアラビア	139,853,190	0.31	
ロシア	114,356,225	0.25	
リベリア	111,205,876	0.25	
メキシコ	99,758,978	0.22	
マレーシア	76,012,994	0.17	
バーレーン	73,922,565	0.16	
オーストラリア	66,614,962	0.15	
インドネシア	64,450,547	0.14	
グルジア	63,970,043	0.14	
イギリス領バージン 諸島	62,927,366	0.14	
シンガポール	60,101,013	0.13	
南アフリカ	53,208,085	0.12	
オーストリア	48,721,637	0.11	
イスラエル	46,913,563	0.10	
チリ	45,538,577	0.10	
カザフスタン	45,298,307	0.10	
ドミニカ共和国	40,515,569	0.09	
ペルー	36,958,309	0.08	
ウクライナ	34,480,438	0.08	
パラグアイ	28,828,144	0.06	
香港	23,103,618	0.05	
コロンビア	22,664,018	0.05	
アラブ首長国連邦	22,584,450	0.05	
スペイン	22,034,950	0.05	
ジャージー	21,870,100	0.05	
ベトナム	20,771,100	0.05	
フィンランド	14,929,228	0.03	
ポーランド	12,891,270	0.03	
小計	18,776,741,908	41.63	
預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,370,103,672	3.04
合計（純資産総額）		45,098,851,448	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

(2021年8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	1,098,823	0.00
為替予約取引(売建)	日本	1,461,610	0.00
貸付債権	アメリカ	412,623,506	0.91

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

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## Aコース(為替ヘッジ付き)

(2021年8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・スト ラテジック・インカ ム・マザーファンド	日本	10,181,573,473	3.3759	34,372,096,264	3.4001	34,618,367,965	100.19

## Bコース(為替ヘッジなし)

(2021年8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・スト ラテジック・インカ ム・マザーファンド	日本	1,240,429,400	3.3759	4,187,567,762	3.4001	4,217,584,002	100.05

## 種類別投資比率

## Aコース(為替ヘッジ付き)

(2021年8月31日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.19

## Bコース(為替ヘッジなし)

(2021年8月31日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.05

## （参考）マザーファンドの投資有価証券の主要銘柄

## フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

（2021年8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	USTB 2.50% 02/15/45	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	12,466,000	12,451.67 1,552,225,182	12,308.80 1,534,415,008	2.500 2045/02/15	3.40
2	AID 5.5% 9/18/23	アメリカ・ドル イスラエル	国債証券	9,504,000	12,209.78 1,160,417,500	12,149.99 1,154,735,477	5.500 2023/09/18	2.56
3	CANADA GOVT .25% 11/01/22	カナダ・ドル カナダ	国債証券	10,665,000	8,710.24 928,947,911	8,709.95 928,915,666	0.250 2022/11/01	2.06
4	UST NOTES 2.875% 11/30/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	7,161,000	12,058.00 863,473,967	12,013.83 860,310,251	2.875 2025/11/30	1.91
5	UNITED KING 0.125% 01/31/23 RGS	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	5,460,000	15,139.11 826,595,749	15,128.21 826,000,274	0.125 2023/01/31	1.83
6	USTN 2.75% 06/30/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	6,712,000	11,932.72 800,924,314	11,894.04 798,327,790	2.750 2025/06/30	1.77
7	USTN 1.25% 08/15/31	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	6,938,000	10,992.56 762,664,276	10,960.77 760,457,986	1.250 2031/08/15	1.69
8	USTB 3% 02/15/49	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	5,390,000	13,818.16 744,799,179	13,649.91 735,730,132	3.000 2049/02/15	1.63
9	UST NOTES 2% 07/31/2024	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	5,738,000	11,566.53 663,687,801	11,547.63 662,603,158	2.125 2024/07/31	1.47
10	USTB 4.75% 2/15/37	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,128,000	16,092.10 664,282,197	15,954.29 658,593,210	4.750 2037/02/15	1.46
11	GERMANY GOVT 0% 02/15/31 REGS	ユーロ ドイツ	国債証券	4,600,000	13,518.36 621,844,874	13,572.97 624,356,451	0.000 2031/02/15	1.38
12	USTB 6.125%	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,002,000	15,336.54 613,768,530	15,213.35 608,838,150	6.125 2029/08/15	1.35
13	GERMANY GOVT 0% 08/15/31 REGS	ユーロ ドイツ	国債証券	4,450,000	13,568.94 603,818,094	13,545.86 602,790,819	0.000 2031/08/15	1.34
14	INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	アメリカ・ドル オランダ	社債券	5,535,000	10,852.62 600,692,793	10,880.10 602,213,535	7.000 2023/06/30	1.34
15	USTN 2.25% 12/31/24	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,703,000	11,662.69 548,496,682	11,636.87 547,282,061	2.250 2024/12/31	1.21
16	FRANCE GOVT .75% 05/25/53 144A REGS	ユーロ フランス	国債証券	3,995,000	12,960.31 517,764,415	13,003.50 519,489,726	0.750 2053/05/25	1.15
17	UST NOTES 1.25% 06/30/2028	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,555,000	11,188.43 509,633,127	11,137.60 507,317,484	1.250 2028/06/30	1.12
18	USTN .75% 03/31/26	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	4,597,000	11,030.33 507,064,421	11,006.70 505,978,219	0.750 2026/03/31	1.12
19	323 10年国債	日本・円 日本	国債証券	479,800,000	100.93 484,295,420	100.82 483,734,360	0.900 2022/06/20	1.07
20	GERMANY GOVT 0% 10/10/25 REGS	ユーロ ドイツ	国債証券	3,000,000	13,373.63 401,208,984	13,385.43 401,563,037	0.000 2025/10/10	0.89

21	GERMANY GOVT 0% 04/05/24	ユーロ ドイツ	国債証券	2,875,000	13,242.79 380,730,271	13,234.99 380,506,082	0.000 2024/04/05	0.84
22	356 10年国債	日本・円 日本	国債証券	368,000,000	101.60 373,888,000	101.42 373,214,560	0.100 2029/09/20	0.83
23	GERMANY GOVT 0% 08/15/50	ユーロ ドイツ	国債証券	2,600,000	12,688.68 329,905,681	12,846.70 334,014,260	0.000 2050/08/15	0.74
24	USTN .375% 12/31/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	2,639,000	10,862.40 286,658,896	10,847.46 286,264,461	0.375 2025/12/31	0.63
25	BTP .95% 12/01/31 144A RGS	ユーロ イタリア	国債証券	2,086,000	13,228.76 275,952,122	13,337.32 278,216,486	0.950 2031/12/01	0.62
26	ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	1,714,000	15,884.94 272,267,974	16,087.71 275,743,375	8.000 2031/11/01	0.61
27	UK GILT 2.5% 07/22/65 REGS	イギリス・ポンド イギリス	国債証券	1,100,000	23,765.34 261,418,755	23,975.08 263,725,933	2.500 2065/07/22	0.58
28	USTN 1.75% 06/30/22	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	2,274,000	11,164.19 253,873,714	11,145.40 253,446,364	1.750 2022/06/30	0.56
29	USTN .25% 07/31/25	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券	2,281,000	10,848.66 247,458,130	10,841.85 247,302,707	0.250 2025/07/31	0.55
30	SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32	アメリカ・ドル アメリカ	社債券	1,435,000	16,897.12 242,473,743	16,841.85 241,680,480	8.750 2032/03/15	0.54

(参考) マザーファンドの種類別および業種別投資比率  
 フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

(2021年8月31日現在)

種類	国内/外国	業種/種別	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	1.35
		小売	0.24
		食品・生活必需品小売り	0.11
		各種金融	0.11
		電気通信サービス	0.12
		公益事業	0.21
	小計		2.15
新株予約権証券	外国	-	0.18
	小計		0.18
公社債券	国内	国債証券	2.43
	小計		2.43
	外国	国債証券	46.87
		地方債証券	0.09
		特殊債券	3.62
		社債券	41.63
小計		92.21	
合計(対純資産総額比)			96.96

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

Aコース(為替ヘッジ付き)

(2021年8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	イギリス・ポンド	売建	5,582,800	836,960,536	844,294,101	2.44
	カナダ・ドル	売建	9,695,800	833,431,576	844,613,742	2.44
	ユーロ	売建	19,135,900	2,463,357,901	2,482,289,812	7.18
	アメリカ・ドル	売建	271,245,700	29,786,450,527	29,799,405,221	86.25

## Bコース（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

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

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

（参考）マザーファンドのその他投資資産の主要なもの  
フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

（2021年8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	9,998	1,098,441	1,098,823	0.00
	アメリカ・ドル	売建	13,299	1,460,085	1,461,610	0.00
貸付債権	アメリカ・ドル	-	4,279,507.31	413,258,679	412,623,506	0.91

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

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

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

## （ 3 ）【運用実績】

## 【純資産の推移】

2021年8月末日および同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次のとおりです。

## Aコース（為替ヘッジ付き）

年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり純資産額 (円) (分配落)	1口当たり純資産額 (円) (分配付)
2012年1月20日 (第27特定期間)	1,116	1,123	0.8418	0.8473
2012年7月20日 (第28特定期間)	2,273	2,289	0.8424	0.8484
2013年1月21日 (第29特定期間)	31,182	31,406	0.8320	0.8380
2013年7月22日 (第30特定期間)	185,900	187,324	0.7833	0.7893
2014年1月20日 (第31特定期間)	243,576	244,861	0.7583	0.7623
2014年7月22日 (第32特定期間)	222,359	223,531	0.7588	0.7628
2015年1月20日 (第33特定期間)	179,464	180,451	0.7276	0.7316
2015年7月21日 (第34特定期間)	143,717	144,531	0.7056	0.7096
2016年1月20日 (第35特定期間)	114,103	114,807	0.6487	0.6527
2016年7月20日 (第36特定期間)	100,945	101,537	0.6826	0.6866
2017年1月20日 (第37特定期間)	79,649	80,009	0.6634	0.6664
2017年7月20日 (第38特定期間)	71,081	71,402	0.6625	0.6655
2018年1月22日 (第39特定期間)	62,879	63,072	0.6493	0.6513
2018年7月20日 (第40特定期間)	55,034	55,210	0.6277	0.6297
2019年1月21日 (第41特定期間)	48,511	48,671	0.6067	0.6087
2019年7月22日 (第42特定期間)	45,222	45,369	0.6141	0.6161
2020年1月20日 (第43特定期間)	41,747	41,884	0.6083	0.6103
2020年7月20日 (第44特定期間)	38,536	38,667	0.5885	0.5905

2021年1月20日 (第45特定期間)	36,723	36,846	0.5961	0.5981
2021年7月20日 (第46特定期間)	34,718	34,835	0.5956	0.5976
2020年8月末日	38,393	-	0.5936	-
2020年9月末日	37,721	-	0.5884	-
2020年10月末日	37,143	-	0.5855	-
2020年11月末日	37,430	-	0.5962	-
2020年12月末日	37,154	-	0.5991	-
2021年1月末日	36,670	-	0.5961	-
2021年2月末日	35,921	-	0.5890	-
2021年3月末日	35,077	-	0.5855	-
2021年4月末日	34,968	-	0.5890	-
2021年5月末日	34,768	-	0.5890	-
2021年6月末日	34,771	-	0.5934	-
2021年7月末日	34,685	-	0.5962	-
2021年8月末日	34,551	-	0.5967	-

## Bコース(為替ヘッジなし)

年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり純資産額 (円) (分配落)	1口当たり純資産額 (円) (分配付)
2012年1月20日 (第27特定期間)	1,265	1,273	0.6202	0.6242
2012年7月20日 (第28特定期間)	1,290	1,298	0.6359	0.6399
2013年1月21日 (第29特定期間)	2,289	2,301	0.7192	0.7232
2013年7月22日 (第30特定期間)	8,214	8,257	0.7587	0.7627
2014年1月20日 (第31特定期間)	10,564	10,619	0.7739	0.7779
2014年7月22日 (第32特定期間)	10,855	10,912	0.7580	0.7620
2015年1月20日 (第33特定期間)	12,399	12,474	0.8332	0.8382
2015年7月21日 (第34特定期間)	13,115	13,192	0.8483	0.8533
2016年1月20日 (第35特定期間)	11,021	11,096	0.7353	0.7403
2016年7月20日 (第36特定期間)	9,137	9,202	0.7012	0.7062
2017年1月20日 (第37特定期間)	8,678	8,738	0.7345	0.7395
2017年7月20日 (第38特定期間)	8,066	8,123	0.7136	0.7186
2018年1月22日 (第39特定期間)	7,617	7,672	0.6878	0.6928
2018年7月20日 (第40特定期間)	7,146	7,200	0.6602	0.6652
2019年1月21日 (第41特定期間)	6,567	6,621	0.6115	0.6165
2019年7月22日 (第42特定期間)	5,884	5,908	0.6141	0.6166
2020年1月20日 (第43特定期間)	5,471	5,493	0.6246	0.6271
2020年7月20日 (第44特定期間)	5,052	5,073	0.5896	0.5921
2021年1月20日 (第45特定期間)	4,406	4,425	0.5806	0.5831
2021年7月20日 (第46特定期間)	4,216	4,234	0.6080	0.6105
2020年8月末日	4,928	-	0.5860	-
2020年9月末日	4,843	-	0.5814	-

2020年10月末日	4,734	-	0.5716	-
2020年11月末日	4,729	-	0.5796	-
2020年12月末日	4,525	-	0.5817	-
2021年1月末日	4,280	-	0.5836	-
2021年2月末日	4,234	-	0.5864	-
2021年3月末日	4,324	-	0.6051	-
2021年4月末日	4,300	-	0.6008	-
2021年5月末日	4,352	-	0.6057	-
2021年6月末日	4,265	-	0.6125	-
2021年7月末日	4,216	-	0.6092	-
2021年8月末日	4,215	-	0.6109	-

## 【分配の推移】

## Aコース(為替ヘッジ付き)

期	1口当たりの分配金(円)
第27特定期間(152期～157期計算期間合計)	0.0330
第28特定期間(158期～163期計算期間合計)	0.0360
第29特定期間(164期～169期計算期間合計)	0.0360
第30特定期間(170期～175期計算期間合計)	0.0360
第31特定期間(176期～181期計算期間合計)	0.0320
第32特定期間(182期～187期計算期間合計)	0.0240
第33特定期間(188期～193期計算期間合計)	0.0240
第34特定期間(194期～199期計算期間合計)	0.0240
第35特定期間(200期～205期計算期間合計)	0.0240
第36特定期間(206期～211期計算期間合計)	0.0240
第37特定期間(212期～217期計算期間合計)	0.0210
第38特定期間(218期～223期計算期間合計)	0.0180
第39特定期間(224期～229期計算期間合計)	0.0140
第40特定期間(230期～235期計算期間合計)	0.0120
第41特定期間(236期～241期計算期間合計)	0.0120
第42特定期間(242期～247期計算期間合計)	0.0120
第43特定期間(248期～253期計算期間合計)	0.0120
第44特定期間(254期～259期計算期間合計)	0.0120
第45特定期間(260期～265期計算期間合計)	0.0120
第46特定期間(266期～271期計算期間合計)	0.0120

## Bコース(為替ヘッジなし)

期	1口当たりの分配金(円)
第27特定期間(152期~157期計算期間合計)	0.0240
第28特定期間(158期~163期計算期間合計)	0.0240
第29特定期間(164期~169期計算期間合計)	0.0240
第30特定期間(170期~175期計算期間合計)	0.0240
第31特定期間(176期~181期計算期間合計)	0.0240
第32特定期間(182期~187期計算期間合計)	0.0240
第33特定期間(188期~193期計算期間合計)	0.0270
第34特定期間(194期~199期計算期間合計)	0.0300
第35特定期間(200期~205期計算期間合計)	0.0300
第36特定期間(206期~211期計算期間合計)	0.0300
第37特定期間(212期~217期計算期間合計)	0.0300
第38特定期間(218期~223期計算期間合計)	0.0300
第39特定期間(224期~229期計算期間合計)	0.0300
第40特定期間(230期~235期計算期間合計)	0.0300
第41特定期間(236期~241期計算期間合計)	0.0300
第42特定期間(242期~247期計算期間合計)	0.0150
第43特定期間(248期~253期計算期間合計)	0.0150
第44特定期間(254期~259期計算期間合計)	0.0150
第45特定期間(260期~265期計算期間合計)	0.0150
第46特定期間(266期~271期計算期間合計)	0.0150

## 【収益率の推移】

## Aコース（為替ヘッジ付き）

期	収益率(%)
第27特定期間（152期～157期計算期間合計）	1.9
第28特定期間（158期～163期計算期間合計）	4.3
第29特定期間（164期～169期計算期間合計）	3.0
第30特定期間（170期～175期計算期間合計）	1.5
第31特定期間（176期～181期計算期間合計）	0.9
第32特定期間（182期～187期計算期間合計）	3.2
第33特定期間（188期～193期計算期間合計）	0.9
第34特定期間（194期～199期計算期間合計）	0.3
第35特定期間（200期～205期計算期間合計）	4.7
第36特定期間（206期～211期計算期間合計）	8.9
第37特定期間（212期～217期計算期間合計）	0.3
第38特定期間（218期～223期計算期間合計）	2.6
第39特定期間（224期～229期計算期間合計）	0.1
第40特定期間（230期～235期計算期間合計）	1.5
第41特定期間（236期～241期計算期間合計）	1.4
第42特定期間（242期～247期計算期間合計）	3.2
第43特定期間（248期～253期計算期間合計）	1.0
第44特定期間（254期～259期計算期間合計）	1.3
第45特定期間（260期～265期計算期間合計）	3.3
第46特定期間（266期～271期計算期間合計）	1.9

## Bコース（為替ヘッジなし）

期	収益率(%)
第27特定期間（152期～157期計算期間合計）	1.3
第28特定期間（158期～163期計算期間合計）	6.4
第29特定期間（164期～169期計算期間合計）	16.9
第30特定期間（170期～175期計算期間合計）	8.8
第31特定期間（176期～181期計算期間合計）	5.2
第32特定期間（182期～187期計算期間合計）	1.0
第33特定期間（188期～193期計算期間合計）	13.5
第34特定期間（194期～199期計算期間合計）	5.4
第35特定期間（200期～205期計算期間合計）	9.8
第36特定期間（206期～211期計算期間合計）	0.6
第37特定期間（212期～217期計算期間合計）	9.0
第38特定期間（218期～223期計算期間合計）	1.2
第39特定期間（224期～229期計算期間合計）	0.6
第40特定期間（230期～235期計算期間合計）	0.3
第41特定期間（236期～241期計算期間合計）	2.8
第42特定期間（242期～247期計算期間合計）	2.9
第43特定期間（248期～253期計算期間合計）	4.2
第44特定期間（254期～259期計算期間合計）	3.2
第45特定期間（260期～265期計算期間合計）	1.0
第46特定期間（266期～271期計算期間合計）	7.3

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

## （４）【設定及び解約の実績】

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

## Aコース（為替ヘッジ付き）

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第27特定期間 (2011年7月21日～2012年1月20日)	289,992,304	639,456,056	1,326,341,239
第28特定期間 (2012年1月21日～2012年7月20日)	1,848,841,716	476,914,630	2,698,268,325
第29特定期間 (2012年7月21日～2013年1月21日)	35,614,303,030	834,470,520	37,478,100,835
第30特定期間 (2013年1月22日～2013年7月22日)	207,720,317,789	7,858,662,665	237,339,755,959
第31特定期間 (2013年7月23日～2014年1月20日)	103,054,822,532	19,171,017,287	321,223,561,204
第32特定期間 (2014年1月21日～2014年7月22日)	5,734,683,340	33,898,897,608	293,059,346,936
第33特定期間 (2014年7月23日～2015年1月20日)	3,499,306,575	49,916,272,734	246,642,380,777
第34特定期間 (2015年1月21日～2015年7月21日)	3,596,247,688	46,561,253,127	203,677,375,338
第35特定期間 (2015年7月22日～2016年1月20日)	2,226,982,240	29,997,608,732	175,906,748,846
第36特定期間 (2016年1月21日～2016年7月20日)	2,455,253,194	30,468,076,524	147,893,925,516
第37特定期間 (2016年7月21日～2017年1月20日)	4,724,528,557	32,556,241,247	120,062,212,826
第38特定期間 (2017年1月21日～2017年7月20日)	1,990,275,525	14,764,073,453	107,288,414,898
第39特定期間 (2017年7月21日～2018年1月22日)	1,684,150,435	12,137,892,490	96,834,672,843
第40特定期間 (2018年1月23日～2018年7月20日)	1,085,851,077	10,244,484,814	87,676,039,106
第41特定期間 (2018年7月21日～2019年1月21日)	789,852,203	8,499,456,125	79,966,435,184
第42特定期間 (2019年1月22日～2019年7月22日)	1,332,638,391	7,657,553,042	73,641,520,533
第43特定期間 (2019年7月23日～2020年1月20日)	1,097,240,529	6,110,360,440	68,628,400,622
第44特定期間 (2020年1月21日～2020年7月20日)	1,163,406,908	4,313,273,856	65,478,533,674
第45特定期間 (2020年7月21日～2021年1月20日)	833,871,090	4,704,450,792	61,607,953,972
第46特定期間 (2021年1月21日～2021年7月20日)	1,288,274,199	4,600,098,344	58,296,129,827

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

## Bコース（為替ヘッジなし）

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第27特定期間 (2011年7月21日～2012年1月20日)	71,064,657	210,032,661	2,040,294,153
第28特定期間 (2012年1月21日～2012年7月20日)	354,385,919	365,547,403	2,029,132,669
第29特定期間 (2012年7月21日～2013年1月21日)	1,485,014,674	331,251,739	3,182,895,604
第30特定期間 (2013年1月22日～2013年7月22日)	8,735,735,391	1,091,443,165	10,827,187,830
第31特定期間 (2013年7月23日～2014年1月20日)	4,921,358,277	2,096,763,116	13,651,782,991
第32特定期間 (2014年1月21日～2014年7月22日)	3,122,846,363	2,452,692,794	14,321,936,560
第33特定期間 (2014年7月23日～2015年1月20日)	4,095,213,340	3,535,550,986	14,881,598,914
第34特定期間 (2015年1月21日～2015年7月21日)	3,291,320,164	2,712,129,314	15,460,789,764
第35特定期間 (2015年7月22日～2016年1月20日)	1,895,711,296	2,367,878,050	14,988,623,010
第36特定期間 (2016年1月21日～2016年7月20日)	637,630,281	2,594,815,506	13,031,437,785
第37特定期間 (2016年7月21日～2017年1月20日)	1,066,001,308	2,281,243,506	11,816,195,587
第38特定期間 (2017年1月21日～2017年7月20日)	1,058,355,864	1,571,046,562	11,303,504,889
第39特定期間 (2017年7月21日～2018年1月22日)	1,051,981,323	1,280,119,063	11,075,367,149
第40特定期間 (2018年1月23日～2018年7月20日)	997,351,639	1,247,612,287	10,825,106,501
第41特定期間 (2018年7月21日～2019年1月21日)	993,886,135	1,079,069,207	10,739,923,429
第42特定期間 (2019年1月22日～2019年7月22日)	384,781,851	1,542,623,573	9,582,081,707
第43特定期間 (2019年7月23日～2020年1月20日)	784,142,062	1,606,285,069	8,759,938,700
第44特定期間 (2020年1月21日～2020年7月20日)	648,314,837	838,162,736	8,570,090,801
第45特定期間 (2020年7月21日～2021年1月20日)	199,208,176	1,181,015,738	7,588,283,239
第46特定期間 (2021年1月21日～2021年7月20日)	595,389,382	1,248,197,041	6,935,475,580

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## &lt; 参考情報 &gt;

(2021年8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



※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。

	Aコース (為替ヘッジ付き)	Bコース (為替ヘッジなし)
基準価額	5,967円	6,109円
純資産総額	345.5億円	42.2億円

## 分配の推移

(1万円当たり/税引前)

決算期	分配金	
	Aコース (為替ヘッジ付き)	Bコース (為替ヘッジなし)
2021年 4月	20円	25円
2021年 5月	20円	25円
2021年 6月	20円	25円
2021年 7月	20円	25円
2021年 8月	20円	25円
直近1年間累計	240円	300円
設定来累計	8,780円	10,415円

## 主要な資産の状況 (マザーファンド)

資産別組入状況		組入上位10銘柄					
債券等	95.2%	銘柄	クーポン	償還日	格付	比率	
転換社債	0.3%	1 米国国債	2.5%	2045/2/15	AA/Aa	3.4%	
株式	2.1%	2 米国政府保証債	5.5%	2023/9/18	AA/Aa	2.6%	
新株予約権証券(ワラント)	0.2%	3 カナダ国債	0.25%	2022/11/1	AAA/Aaa	2.1%	
現金・その他	2.1%	4 米国国債	2.875%	2025/11/30	AA/Aa	1.9%	
		5 英国国債	0.125%	2023/1/31	AA/Aa	1.8%	
		6 米国国債	2.75%	2025/6/30	AA/Aa	1.8%	
		7 米国国債	1.25%	2031/8/15	AA/Aa	1.7%	
		8 米国国債	3%	2049/2/15	AA/Aa	1.6%	
		9 米国国債	2%	2024/7/31	AA/Aa	1.5%	
		10 米国国債	4.75%	2037/2/15	AA/Aa	1.5%	

国・地域別組入状況	格付別組入状況 (対投資債券比率)	通貨別組入状況 (対投資資産比率)	組入債券種別内訳 (対投資資産比率)
アメリカ	57.4%	AAA/Aaa	8.6%
ドイツ	5.2%	AA/Aa	34.2%
カナダ	4.1%	A	3.6%
イギリス	3.1%	BBB/Baa	7.5%
オランダ	2.7%	BB/Ba	19.1%
イスラエル	2.7%	B	17.7%
日本	2.4%	CCC/Caa	6.9%
フランス	1.5%	CC/Ca以下	0.3%
メキシコ	1.4%	格付なし	2.2%
その他	17.3%		
		アメリカ・ドル	85.2%
		ユーロ	7.4%
		日本・円	2.5%
		イギリス・ポンド	2.5%
		カナダ・ドル	2.5%
		米国国債・政府機関債	30.0%
		ハイ・イールド・ポンド	38.9%
		先進国債券(除く米国)	14.8%
		エマージング債券	16.2%

※別途記載がない限り、主要な資産の状況は対純資産総額比率です。

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

※債券等には、金銭債権が含まれます。

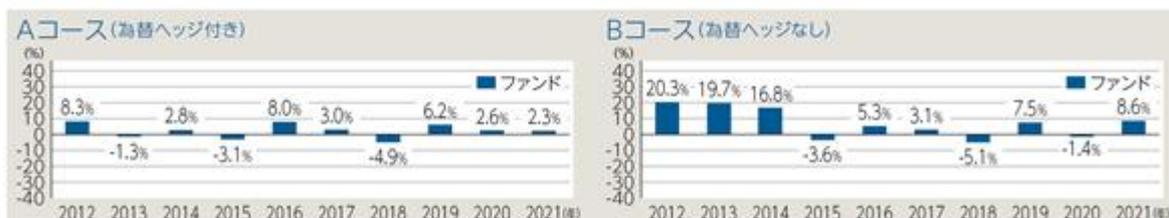
※銘柄はご参考のため、英文表記の一部をカタカナで表記しております。実際の発行体名と異なる場合があります。

※クーポンは、銘柄属性として発行時に定められたものを表示しております。

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

※国・地域は発行国・地域を表示しています。

## 年間収益率の推移



※Aコース(為替ヘッジ付き)は、ベンチマークを設定しておりません。

※ファンドの収益率は、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。

※2021年は年初以降8月末までの実績となります。

### 第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

ファンドの計算期間は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46特定期間（2021年1月21日から2021年7月20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・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース(為替ヘッジ付き)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第45特定期間 2021年1月20日現在	第46特定期間 2021年7月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	1,981,829	1,760,176
親投資信託受益証券	36,930,192,988	34,543,452,473
派生商品評価勘定	9,713,183	-
未収入金	200,286,403	402,303,764
流動資産合計	37,142,174,403	34,947,516,413
資産合計		
	37,142,174,403	34,947,516,413
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	231,563,893	15,368,023
未払金	-	4,296,310
未払収益分配金	123,215,907	116,592,259
未払解約金	13,024,175	45,949,375
未払受託者報酬	1,674,528	1,521,708
未払委託者報酬	46,217,191	41,999,303
その他未払費用	3,110,438	3,016,851
流動負債合計	418,806,132	228,743,829
負債合計		
	418,806,132	228,743,829
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	61,607,953,972	58,296,129,827
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	24,884,585,701	23,577,357,243
(分配準備積立金)	-	36,126
元本等合計	36,723,368,271	34,718,772,584
純資産合計	36,723,368,271	34,718,772,584
負債純資産合計	37,142,174,403	34,947,516,413

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第45特定期間 自 2020年7月21日 至 2021年1月20日	第46特定期間 自 2021年1月21日 至 2021年7月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	48	4
有価証券売買等損益	695,498,577	2,829,348,199
為替差損益	851,693,275	1,883,743,333
<b>営業収益合計</b>	<b>1,547,191,900</b>	<b>945,604,870</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	10,480,324	9,643,455
委託者報酬	289,258,140	266,160,699
その他費用	3,116,378	3,016,851
<b>営業費用合計</b>	<b>302,854,842</b>	<b>278,821,005</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>1,244,337,058</b>	<b>666,783,865</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>	<b>1,244,337,058</b>	<b>666,783,865</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>1,244,337,058</b>	<b>666,783,865</b>
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（ ）	8,572,170	4,240,408
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>26,941,599,985</b>	<b>24,884,585,701</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>1,919,580,065</b>	<b>1,884,308,681</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,919,580,065	1,884,308,681
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>339,314,577</b>	<b>526,659,019</b>
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	339,314,577	526,659,019
<b>分配金</b>	<b>759,016,092</b>	<b>712,964,661</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>24,884,585,701</b>	<b>23,577,357,243</b>

## （３）【注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	第45特定期間 2021年1月20日現在	第46特定期間 2021年7月20日現在
1．元本の推移		
期首元本額	65,478,533,674 円	61,607,953,972 円
期中追加設定元本額	833,871,090 円	1,288,274,199 円
期中一部解約元本額	4,704,450,792 円	4,600,098,344 円
2．受益権の総数	61,607,953,972 口	58,296,129,827 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	24,884,585,701 円	23,577,357,243 円
4．1口当たり純資産額	0.5961 円	0.5956 円

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第45特定期間 自 2020年 7月21日 至 2021年 1月20日</p>	<p style="text-align: center;">第46特定期間 自 2021年 1月21日 至 2021年 7月20日</p>
<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.33%以内の額</p>	<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左</p>
<p>2．分配金の計算過程 （自2020年 7月21日 至2020年 8月20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（84,935,290円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,419,417,268円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,504,352,558円（1口当たり0.023220円）であり、うち129,572,891円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年 8月21日 至2020年 9月23日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（85,632,327円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,365,399,114円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,451,031,441円（1口当たり0.022554円）であり、うち128,674,407円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年 9月24日 至2020年10月20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（81,433,198円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,307,667,368円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,389,100,566円（1口当たり0.021835円）であり、うち127,237,440円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p>	<p>2．分配金の計算過程 （自2021年 1月21日 至2021年 2月22日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（64,485,740円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,111,888,484円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,176,374,224円（1口当たり0.019272円）であり、うち122,083,384円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2021年 2月23日 至2021年 3月22日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（61,575,823円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,036,421,178円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,097,997,001円（1口当たり0.018300円）であり、うち119,997,435円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2021年 3月23日 至2021年 4月20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（96,208,434円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（969,159,172円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,065,367,606円（1口当たり0.017920円）であり、うち118,902,678円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。</p>

(自2020年10月21日 至2020年11月20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(105,054,402円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,248,483,265円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は1,353,537,667円(1口当たり0.021506円)であり、うち125,877,677円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2020年11月21日 至2020年12月21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(104,774,952円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,213,759,910円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は1,318,534,862円(1口当たり0.021192円)であり、うち124,437,770円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2020年12月22日 至2021年1月20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(62,760,854円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,182,476,126円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は1,245,236,980円(1口当たり0.020212円)であり、うち123,215,907円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2021年4月21日 至2021年5月20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(64,298,412円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(939,617,394円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は1,003,915,806円(1口当たり0.017013円)であり、うち118,018,461円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2021年5月21日 至2021年6月21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(101,465,130円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(881,334,971円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は982,800,101円(1口当たり0.016747円)であり、うち117,370,444円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

(自2021年6月22日 至2021年7月20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(89,758,838円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(859,933,957円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は949,692,795円(1口当たり0.016291円)であり、うち116,592,259円(1口当たり0.002000円)を分配金額としております。

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

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

## ．金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第45特定期間 2021年1月20日現在	第46特定期間 2021年7月20日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	273,164,583	115,824,490
合 計	273,164,583	115,824,490

## （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45特定期間 2021年1月20日 現在			第46特定期間 2021年7月20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	36,445,850,633	-	36,667,701,343	221,850,710	33,790,090,677	-	33,805,458,700	15,368,023
アメリ カ・ド ル	31,742,111,180	-	31,954,299,290	212,188,110	29,696,657,350	-	29,709,460,147	12,802,797
イギリ ス・ポ ンド	958,152,747	-	970,562,250	12,409,503	835,659,185	-	836,078,453	419,268
カナ ダ・ド ル	940,587,064	-	947,553,344	6,966,280	784,740,747	-	785,319,093	578,346
ユーロ	2,804,999,642	-	2,795,286,459	9,713,183	2,473,033,395	-	2,474,601,007	1,567,612
合計	36,445,850,633	-	36,667,701,343	221,850,710	33,790,090,677	-	33,805,458,700	15,368,023

## （注1）時価の算定方法

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

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

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

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

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

(注2) デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておられません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(ア) 株式

該当事項はありません。

(イ) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド	10,268,259,705	34,543,452,473	
親投資信託受益証券 合計		10,268,259,705	34,543,452,473	
合計		10,268,259,705	34,543,452,473	

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

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第45特定期間 2021年1月20日現在	第46特定期間 2021年7月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	106,002	208,415
親投資信託受益証券	4,403,421,767	4,214,759,086
未収入金	28,448,642	28,192,216
流動資産合計	4,431,976,411	4,243,159,717
資産合計	4,431,976,411	4,243,159,717
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	18,970,708	17,338,688
未払解約金	426,418	3,015,838
未払受託者報酬	203,586	188,040
未払委託者報酬	5,619,256	5,190,188
その他未払費用	685,705	679,517
流動負債合計	25,905,673	26,412,271
負債合計	25,905,673	26,412,271
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,588,283,239	6,935,475,580
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,182,212,501	2,718,728,134
(分配準備積立金)	157,589,686	95,215,306
元本等合計	4,406,070,738	4,216,747,446
純資産合計	4,406,070,738	4,216,747,446
負債純資産合計	4,431,976,411	4,243,159,717

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第45特定期間 自 2020年7月21日 至 2021年1月20日	第46特定期間 自 2021年1月21日 至 2021年7月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	5	-
有価証券売買等損益	87,491,363	339,508,613
営業収益合計	87,491,368	339,508,613
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,330,288	1,171,896
委託者報酬	36,717,554	32,345,734
その他費用	685,705	679,517
営業費用合計	38,733,547	34,197,147
営業利益又は営業損失（ ）	48,757,821	305,311,466
経常利益又は経常損失（ ）	48,757,821	305,311,466
当期純利益又は当期純損失（ ）	48,757,821	305,311,466
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（ ）	2,891,433	6,032,196
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,517,578,527	3,182,212,501
剰余金増加額又は欠損金減少額	494,010,179	506,512,534
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	494,010,179	506,512,534
剰余金減少額又は欠損金増加額	82,787,116	235,590,650
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	82,787,116	235,590,650
分配金	121,723,425	106,716,787
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,182,212,501	2,718,728,134

## （３）【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。
-----------------	--

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第45特定期間 2021年 1 月20日現在	第46特定期間 2021年 7 月20日現在
1．元本の推移 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	8,570,090,801 円 199,208,176 円 1,181,015,738 円	7,588,283,239 円 595,389,382 円 1,248,197,041 円
2．受益権の総数	7,588,283,239 口	6,935,475,580 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	3,182,212,501 円	2,718,728,134 円
4．1口当たり純資産額	0.5806 円	0.6080 円

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第45特定期間 自 2020年 7月21日 至 2021年 1月20日</p>	<p style="text-align: center;">第46特定期間 自 2021年 1月21日 至 2021年 7月20日</p>
<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.33%以内の額</p>	<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左</p>
<p>2．分配金の計算過程 （自2020年 7月21日 至2020年 8月20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（8,954,034円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（197,660,160円）及び分配準備積立金（240,429,207円）より分配対象収益は447,043,401円（1口当たり0.052485円）であり、うち21,293,922円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年 8月21日 至2020年 9月23日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（10,762,681円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（193,415,836円）及び分配準備積立金（222,321,632円）より分配対象収益は426,500,149円（1口当たり0.051280円）であり、うち20,792,542円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年 9月24日 至2020年10月20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（11,831,522円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（193,364,379円）及び分配準備積立金（210,999,927円）より分配対象収益は416,195,828円（1口当たり0.050210円）であり、うち20,722,904円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p>	<p>2．分配金の計算過程 （自2021年 1月21日 至2021年 2月22日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（12,207,556円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（170,460,388円）及び分配準備積立金（149,698,308円）より分配対象収益は332,366,252円（1口当たり0.046012円）であり、うち18,058,858円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p> <p>（自2021年 2月23日 至2021年 3月22日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（11,688,397円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（168,731,936円）及び分配準備積立金（141,641,606円）より分配対象収益は322,061,939円（1口当たり0.045153円）であり、うち17,831,670円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p> <p>（自2021年 3月23日 至2021年 4月20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（10,962,689円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（172,768,132円）及び分配準備積立金（133,037,756円）より分配対象収益は316,768,577円（1口当たり0.044204円）であり、うち17,915,029円（1口当たり0.002500円）を分配金額としております。</p>

(自2020年10月21日 至2020年11月20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(8,730,309円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(191,046,640円)及び分配準備積立金(198,481,623円)より分配対象収益は398,258,572円(1口当たり0.048782円)であり、うち20,410,253円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2020年11月21日 至2020年12月21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(12,487,573円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(183,546,668円)及び分配準備積立金(178,093,499円)より分配対象収益は374,127,740円(1口当たり0.047884円)であり、うち19,533,096円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2020年12月22日 至2021年1月20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(10,880,566円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(178,722,470円)及び分配準備積立金(165,679,828円)より分配対象収益は355,282,864円(1口当たり0.046820円)であり、うち18,970,708円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2021年4月21日 至2021年5月20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(11,566,537円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(171,676,751円)及び分配準備積立金(124,398,260円)より分配対象収益は307,641,548円(1口当たり0.043338円)であり、うち17,746,603円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2021年5月21日 至2021年6月21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(12,922,075円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(176,858,471円)及び分配準備積立金(114,591,227円)より分配対象収益は304,371,773円(1口当たり0.042687円)であり、うち17,825,939円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

(自2021年6月22日 至2021年7月20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(7,551,443円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(173,813,139円)及び分配準備積立金(105,002,551円)より分配対象収益は286,367,133円(1口当たり0.041290円)であり、うち17,338,688円(1口当たり0.002500円)を分配金額としております。

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドおよび主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権および金銭債務であり、その内容を当ファンドおよび親投資信託受益証券の貸借対照表、有価証券に関する注記、デリバティブ取引に関する注記および附属明細表に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、為替変動リスク、価格変動リスクの回避および信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的としております。</p> <p>当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク等があります。</p>
3．金融商品に係るリスク管理体制	投資リスクの管理および投資行動のチェックについては、運用部門が自ら行う方法と運用部門から独立したコンプライアンス部門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45特定期間 2021年1月20日現在	第46特定期間 2021年7月20日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	32,577,232	13,856,899
合 計	32,577,232	13,856,899

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

（ア）株式

該当事項はありません。

（イ）株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド	1,252,863,793	4,214,759,086	
親投資信託受益証券	合計	1,252,863,793	4,214,759,086	
合計		1,252,863,793	4,214,759,086	

（注）親投資信託受益証券における券面総額の数値は証券数を表示しております。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考情報）

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

なお、同親投資信託の状況は以下のとおりです。

「フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

（１）貸借対照表

区 分	2021年 1月20日現在	2021年 7月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	236,226,112	562,301,404
貸付債権	746,202,977	664,932,006
株式	719,428,138	985,569,890
新株予約権証券	41,460,977	71,375,421
国債証券	23,712,105,637	21,929,613,168
地方債証券	39,467,098	39,512,706
特殊債券	1,376,545,214	1,623,585,415
社債券	20,066,315,819	19,103,684,124
派生商品評価勘定	526,930	1,382,066
未収入金	321,797,507	18,055,836
未収利息	455,731,115	415,004,669
前払金	-	6,352,029
前払費用	8,702,879	5,028,071
流動資産合計	47,724,510,403	45,426,396,805
資産合計	47,724,510,403	45,426,396,805
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	383
未払金	441,838,746	179,758,564
未払解約金	275,566,022	301,473,970
流動負債合計	717,404,768	481,232,917
負債合計	717,404,768	481,232,917
純資産の部		
元本等		
元本	15,120,765,509	13,360,348,390
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	31,886,340,126	31,584,815,498
元本等合計	47,007,105,635	44,945,163,888
純資産合計	47,007,105,635	44,945,163,888
負債純資産合計	47,724,510,403	45,426,396,805

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2021年1月20日現在	2021年7月20日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	16,222,992,057 円	15,120,765,509 円
期中追加設定元本額	523,893,384 円	365,797,382 円
期中一部解約元本額	1,626,119,932 円	2,126,214,501 円
2. 期末元本額及びその内訳		
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）	11,879,243,756 円	10,268,259,705 円
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）	1,416,437,779 円	1,252,863,793 円
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド（資産成長型）Cコース（為替ヘッジ付き）	879,051,908 円	825,846,704 円
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド（資産成長型）Dコース（為替ヘッジなし）	946,032,066 円	1,013,378,188 円
計	15,120,765,509 円	13,360,348,390 円
3. 受益権の総数	15,120,765,509 口	13,360,348,390 口
4. 1口当たり純資産額	3.1088 円	3.3641 円

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

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

## ・金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2021年1月20日現在	2021年7月20日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	179,186,263	427,753,499
新株予約権証券	40,823,455	70,721,818
国債証券	331,981,230	439,593,332
地方債証券	857,128	3,412,368
特殊債券	54,160,022	58,811,905
社債券	1,038,806,505	927,309,854
合 計	981,852,143	1,048,416,112

(注) 2021年7月20日現在の当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(2020年7月21日から2021年7月20日まで)に対応するものとなっております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

種類	2021年1月20日 現在			2021年7月20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	273,240,469	-	272,713,539	526,930	293,593,347	-	292,211,664	1,381,683
アメリカ・ドル	273,240,469	-	272,713,539	526,930	293,593,347	-	292,211,664	1,381,683
合計	273,240,469	-	272,713,539	526,930	293,593,347	-	292,211,664	1,381,683

## （注1）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## （注2）デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておりません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

(3) 附属明細表  
有価証券明細表  
(ア) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	VISTRA CORP	46,118	17.79	820,439.22	
	MESQUITE ENERGY INC	11,182	36.22	405,012.04	
	DENBURY INC	18,488	63.20	1,168,441.60	
	EP ENERGY CORP	19,360	93.14	1,803,190.40	
	CALIFORNIA RES CORP	9,382	25.28	237,176.96	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	19,140	48.90	935,946.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP PIPE	194	48.90	9,486.60	
	NOBLE CORPORATION	495	21.01	10,399.95	
	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC A	2,894	25.60	74,086.40	
	FRONTIER COMMS PARENT INC	17,015	28.27	481,014.05	
	SOUTHEASTERN GROCERS INC	45,701	18.60	850,038.60	
	TOPS MARKETS CORP	1,325	351.56	465,817.00	
	LEGACY RESERVES INC NEW	9,287	10.00	92,870.00	
	LEGACY RESERVES INC 144A	59,461	10.00	594,610.00	
	NEW COTAI LLC / CAP P/P	170,219	3.17	539,594.23	
JONAH EGY LLC / JONAH EGY FIN	10,826	46.81	506,765.06		
アメリカ・ドル	小計	441,087		8,994,888.11 (985,569,890)	
合計		441,087		985,569,890 (985,569,890)	

## (イ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	アメリカ・ドル	CALIFORNIA RES CRP WT 10/27/24	1,626.00	8,373.90	
		DENBURY INC WT 09/18/25	17,519.00	621,924.50	
		NOBLE CORPORATION TRANCHE 1 WT	2,011.00	10,557.75	
		NOBLE CORPORATION TRANCHE 2 WT	2,011.00	10,557.75	
	アメリカ・ドル	小計	23,167.00	651,413.90 (71,375,421)	
新株予約権証券	合計		71,375,421 (71,375,421)		
国債証券	日本円	323 10年国債	439,800,000	443,947,314	
		356 10年国債	388,000,000	394,227,400	
		9 40年国債	240,750,000	219,987,720	
	日本円	小計	1,068,550,000	1,058,162,434	
	アメリカ・ドル	AID 5.5% 9/18/23	9,504,000.00	10,558,848.96	
		AID UKRAINE 1.471% 09/29/21	1,959,000.00	1,964,250.12	
		ANGOLA GOVT 8.25% 5/9/28 144A	285,000.00	297,787.95	
		ANGOLA REP 9.5% 11/12/25 144A	335,000.00	368,352.60	
		ARAB RP EGYPT 5.875% 6/25 144A	200,000.00	212,850.00	
		ARGENTINA GOVT 1% 07/09/29	154,312.00	58,175.62	
		ARGENTINA GOVT STEP 01/09/38	371,540.00	143,042.90	
		ARGENTINA GOVT STEP 07/09/30	1,225,378.00	435,928.22	
		ARGENTINA GOVT STEP 07/09/35	959,621.00	302,760.42	
		BANQUE CENTRL 5.75% 1/25 144A	10,000.00	8,958.10	
		BARBADOS 6.5% 10/01/29 144A	258,000.00	259,013.94	
		BELARUS REPUB 6.875% 2/23 144A	95,000.00	94,572.50	
		BRAZIL GLBL 7.125% 1/20/37	30,000.00	37,946.10	
		BRAZIL GLBL 8.25% 1/20/34	150,000.00	208,012.50	
		BRAZIL GOVT 3.875% 06/12/30	480,000.00	481,737.60	
		BRAZIL GOVT 5% 01/27/45	250,000.00	251,842.50	

COLOMBIA GOVT 3.125% 04/15/31	200,000.00	195,912.00	
COLOMBIA GOVT 5% 06/15/45	380,000.00	406,907.80	
COLOMBIA REP 7.375% 9/18/37	120,000.00	158,047.20	
COLOMBIA REP OF 3% 01/30/30	200,000.00	195,786.00	
COSTA RICA 5.625% 4/30/43 144A	180,000.00	169,176.60	
DOMIN REP 4.875% 09/23/32 144A	150,000.00	157,500.00	
DOMIN REP 5.875% 01/30/60 144A	420,000.00	425,985.00	
DOMINICAN REP 6.4% 6/5/49 144A	125,000.00	137,015.00	
DOMINICAN REP 7.45% 04/44 144A	200,000.00	245,974.00	
DUBAI GOVT INT 3.9% 9/9/50 RGS	400,000.00	374,000.00	
ECUADOR REP STEP 07/31/30 REGS	170,770.00	146,862.20	
ECUADOR REP STEP 7/31/35 RGS	434,689.00	298,305.32	
EGYPT 7.6003% 3/1/29 144A	330,000.00	357,802.50	
EGYPT GOVT 7.5% 02/16/61 144A	200,000.00	185,500.00	
EGYPT GOVT 7.903% 2/21/48 144A	390,000.00	380,807.70	
EGYPT REP OF 7.5% 1/31/27 144A	460,000.00	509,965.20	
EGYPT REP OF 8.5% 1/31/47 144A	260,000.00	269,471.80	
EL SALVADOR 7.75% 1/24/23 144A	200,000.00	194,000.00	
EL SALVADOR REPUBLIC OF 7.1246	205,000.00	167,075.00	
EMIRATE OF AB 1.7% 3/2/31 144A	200,000.00	193,900.00	
EMIRATE OF AB 3.125% 4/30 144A	200,000.00	218,000.00	
GABONESE GOVT 6.375 12/24 144A	211,351.00	223,873.54	
GABONESE REP 6.95 6/16/25 144A	200,000.00	215,850.00	
GEORGIA GOVT 2.75% 4/26 144A	200,000.00	203,500.00	
GHANA GOVT 8.125% 01/26 144A	635,000.00	676,986.20	

GUATEMALA GOV 6.125% 6/50 144A	200,000.00	242,724.00	
HAZINE MU 5.125% 06/22/26 144A	200,000.00	199,500.00	
INDONESIA 7.75% 1/17/38 144A	505,000.00	774,478.10	
INDONESIA 8.5% 10/12/35 REGS	635,000.00	1,025,639.30	
ISRAEL GLBL 5.5% 12/4/23	8,000.00	8,915.44	
IVORY COAST 6.375% 3/3/28 144A	445,000.00	487,355.10	
JAMAICA 8% 3/14/39	100,000.00	140,500.00	
JORDAN GOVT 7.375% 10/47 144A	200,000.00	209,100.00	
JORDAN KINGD 4.95% 7/7/25 144A	200,000.00	207,250.00	
KENYA GOVT 7% 05/22/27 144A	165,000.00	180,241.05	
KENYA REP 6.875% 06/24/24 144A	425,000.00	465,982.75	
LEBANE 144A 5.8% 4/14/20 REGS	885,000.00	107,465.55	
LEBANESE REP 6.15% 6/20	180,000.00	21,576.60	
LEBANON REP 6.375% 3/09/20	840,000.00	100,690.80	
MEXICO GOVT 3.25% 04/16/30	200,000.00	209,162.00	
MEXICO UNITED MEX 3.75% 1/28	200,000.00	220,286.00	
MONGOLIA GOVT 5.125% 04/07/26	200,000.00	211,250.00	
MOROCCO GOVT 3% 12/15/32 144A	200,000.00	194,500.00	
NIGERIA GOVT 7.696% 2/38 144A	200,000.00	204,724.00	
NIGERIA REP 7.625% 11/25 144A	400,000.00	449,700.00	
NIGERIA REPUBL 6.5% 11/27 144A	580,000.00	613,274.60	
OMAN SULTAN 6.5% 3/8/47 144A	110,000.00	107,167.50	
OMAN SULTANA 6% 08/29 144A	120,000.00	126,884.40	
OMAN SULTANATE 6.75% 1/48 144A	200,000.00	199,974.00	
OMAN SULTANT 4.875% 02/01/25 144A	200,000.00	209,224.00	

PAKISTAN GOV 6.875% 12/27 144A	200,000.00	205,474.00	
PAKISTAN ISLAM 0% 4/6/26 144A	200,000.00	202,000.00	
PANAMA GOVT 2.252% 09/29/32	200,000.00	194,600.00	
PANAMA GOVT 3.16% 01/23/30	200,000.00	211,724.00	
PARAGUAY REP 2.739% 01/29/33 144A	200,000.00	195,974.00	
PARAGUAY REP 4.95% 04/31 144A	465,000.00	537,451.65	
PARAGUAY REP 5.4% 3/30/50 144A	200,000.00	238,036.00	
PERU 7.35% 7/21/25	45,000.00	55,287.90	
PERU GOVT 3.55% 03/10/51	45,000.00	48,195.00	
PERU REPUBLIC 2.783% 1/23/31	375,000.00	387,255.00	
QATAR GOVT 3.75% 04/16/30 144A	200,000.00	227,036.00	
QATAR GOVT 4.4% 04/16/50 144A	380,000.00	467,875.00	
QATAR ST 4.817% 03/14/49 144A	285,000.00	370,106.70	
QATAR ST 5.103% 4/23/48 144A	320,000.00	427,657.60	
REP OF ARMENIA 7.15% 3/25 144A	30,000.00	34,027.50	
ROMANIA GOVT 5.125% 06/48 144A	210,000.00	261,160.20	
ROMANIA REPUBLIC 3% 02/31 144A	77,000.00	79,805.11	
RUSSIAN FEDN 5.25% 06/47 144A	400,000.00	507,572.00	
RUSSIAN FEDN 5.625 4/4/42 144A	250,000.00	324,500.00	
RWANDA INTL GOV6.625 5/23 144A	445,000.00	470,667.60	
SAUDI ARABIA 2.25% 02/02/33 144A	200,000.00	194,686.00	
SERBIA GOVT 2.125% 12/01/30 144A	200,000.00	190,662.00	
SRI LANKA GOVT 6.2% 05/27 144A	200,000.00	124,850.00	
SRI LANKA GOVT 6.75% 4/28 144A	230,000.00	144,152.50	
TURKEY GOVT 4.875% 4/16/2043	700,000.00	562,975.00	

TURKEY GOVT 5.125% 2/17/28	120,000.00	117,247.20	
TURKEY GOVT 5.75% 05/11/2047	405,000.00	349,640.55	
TURKEY GOVT BD 4.25% 04/14/26	70,000.00	67,475.10	
TURKEY REP 6.375% 10/14/25	400,000.00	420,072.00	
TURKEY REP GOVT 4.75% 01/26/26	200,000.00	196,500.00	
TURKEY REPUBLI 4.875% 10/09/26	145,000.00	142,488.60	
TURKEY REPUBLIC OF 4.25% 03/25	140,000.00	137,663.40	
UKRAINE 6.876% 05/21/29 144A	200,000.00	208,200.00	
UKRAINE 7.253% 03/15/33 144A	200,000.00	208,100.00	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/23 144A	480,000.00	516,000.00	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/24 144A	540,000.00	588,529.80	
UKRAINE CAB 7.75% 9/1/26 144A	200,000.00	220,224.00	
UKRAINE CABINET VAR 0% 5/31/40	245,000.00	286,160.00	
UNITED MEXICAN 4.35% 1/15/47	560,000.00	600,527.20	
URUGUAY REPUBLICA ORIENTAL DL	220,000.00	292,364.60	
UST NOTES 1.25% 06/30/2028	6,072,000.00	6,183,906.96	
UST NOTES 1.5% 08/15/2022	900,000.00	913,500.00	
UST NOTES 2% 07/31/2024	5,738,000.00	6,039,015.48	
UST NOTES 2.125% 06/30/22	129,000.00	131,483.25	
UST NOTES 2.5% 01/15/2022	242,000.00	244,843.50	
UST NOTES 2.875% 11/30/25	7,161,000.00	7,856,905.98	
USTB 2.375% 05/15/51	633,000.00	713,504.94	
USTB 2.50% 02/15/45	12,466,000.00	14,123,978.00	
USTB 3% 02/15/49	5,390,000.00	6,777,062.60	
USTB 3.5% 2/15/39	200,000.00	259,320.00	
USTB 4.75% 2/15/37	4,128,000.00	6,044,424.00	
USTB 6.125%	4,002,000.00	5,584,791.00	

USTN .125% 05/31/22	491,000.00	491,265.14	
USTN .125% 06/30/22	57,000.00	57,026.22	
USTN .125% 08/15/23	1,071,000.00	1,068,740.19	
USTN .125% 08/31/22	190,000.00	190,058.90	
USTN .125% 10/15/23	493,000.00	491,555.51	
USTN .25% 05/15/24	376,000.00	374,969.76	
USTN .25% 07/31/25	2,281,000.00	2,251,666.34	
USTN .25% 09/30/25	1,393,000.00	1,372,745.78	
USTN .375% 12/31/25	2,639,000.00	2,608,361.21	
USTN .75% 03/31/26	4,597,000.00	4,613,870.99	
USTN 1.5% 01/31/27	326,000.00	338,886.78	
USTN 1.625% 05/15/31	6,571,000.00	6,834,825.65	
USTN 1.625% 05/31/23	1,365,000.00	1,401,199.80	
USTN 1.625% 09/30/26	1,060,000.00	1,108,569.20	
USTN 1.75% 06/30/22	2,274,000.00	2,310,042.90	
USTN 1.75% 07/15/22	1,938,000.00	1,969,860.72	
USTN 2% 05/31/24	1,620,000.00	1,695,864.60	
USTN 2.25% 03/31/26	494,000.00	530,180.56	
USTN 2.25% 04/15/22	1,350,000.00	1,371,721.50	
USTN 2.25% 12/31/24	4,703,000.00	4,990,870.63	
USTN 2.375% 04/30/26	1,107,000.00	1,195,471.44	
USTN 2.5% 02/28/26	90,000.00	97,533.90	
USTN 2.625% 12/31/23	299,000.00	316,028.05	
USTN 2.625% 12/31/25	750,000.00	815,535.00	
USTN 2.75% 06/30/25	6,712,000.00	7,287,755.36	
UZBEKISTAN 3.7% 11/25/30 144A	200,000.00	196,800.00	
VENEZUELA 11.95% 8/31 REGS	1,470,000.00	148,837.50	
VENEZUELA REP 9.25% 9/15/27	1,805,000.00	180,500.00	
VENEZUELA REPUB 12.75% 8/23/22	345,000.00	34,500.00	
VIETNAM PAR 3/5.5% 3/12/28	1,429,750.00	1,437,156.09	
アメリカ・ドル 小計	137,476,411.00	142,979,906.92 (15,666,308,401)	
イギリス・ポンド	UK GILT 2.5% 07/22/65 REGS	1,045,000.00	1,640,838.10
	UNITED KING 0.125% 01/31/23 RGS	5,315,000.00	5,319,252.00
イギリス・ポンド 小計	6,360,000.00	6,960,090.10 (1,042,621,497)	

カナダ・ドル	CANADA GOVT .25% 11/01/22	9,095,000.00	9,089,906.80	
	CANADA GOVT 2% 12/01/51	2,560,000.00	2,750,566.40	
カナダ・ドル 小計		11,655,000.00	11,840,473.20 (1,018,043,886)	
ユーロ	BTP .6% 08/01/31 144A RGS	2,600,000.00	2,573,922.00	
	BTP .95% 12/01/31 144A RGS	4,086,000.00	4,167,842.58	
	FRANCE GOVT .75% 05/25/53 144A REGS	3,995,000.00	3,992,323.35	
	GERMANY GOVT 0% 02/15/31 REGS	4,940,000.00	5,149,258.40	
	GERMANY GOVT 0% 04/05/24	2,235,000.00	2,280,996.30	
	GERMANY GOVT 0% 08/15/50	2,050,000.00	1,999,549.50	
	GERMANY GOVT 0% 10/10/25 REGS	3,000,000.00	3,093,600.00	
	NETHERLANDS 0% 1/24 144A RGS	1,050,000.00	1,069,267.50	
ユーロ 小計		23,956,000.00	24,326,759.63 (3,144,476,950)	
国債証券 合計			21,929,613,168 (20,871,450,734)	
地方債証券	アメリカ・ドル	BUENOS AIRES 10.875% 1/21 144A	216,666.63	103,999.93
		PROVINCE CRDB 7.125% 6/21 144A	337,156.00	256,616.17
	アメリカ・ドル 小計		553,822.63	360,616.10 (39,512,706)
地方債証券 合計			39,512,706 (39,512,706)	
特殊債券	アメリカ・ドル	1MDB GLB INV 4.4% 3/09/23 REGS	1,000,000.00	1,004,200.00
		ABU DHABI NA 4% 10/03/49 144A	200,000.00	229,786.00
		CODELCO INC 4.25% 7/17/42 144A	95,000.00	109,772.50
		CORPO NAC 4.375% 02/05/49 144A	100,000.00	119,581.00
		EMPRESA NAC 4.5% 9/14/47 144A	95,000.00	95,551.95
		FHLB 0.5% 04/14/25	145,000.00	144,947.80
		FHLG 15YR 2.5% 03/01/2033#G186	47,403.96	49,767.99
		FHLG 15YR 2.5% 03/01/2033#G186	16,243.27	17,053.32

FHLG 15YR 2.5% 05/33#G18687	9,279.50	9,739.39	
FHLG 15YR 2.5% 08/32#G18654	8,767.74	9,210.42	
FHLG 15YR 2.5% 11/32#G18665	9,472.59	9,944.98	
FHLG 15YR 2.5% 12/01/2032#G186	47,372.05	49,734.49	
FHLG 20YR 3% 04/01/2033#K90336	27,597.19	29,166.91	
FHLG 20YR 3% 06/01/2033#K90632	70,016.80	73,999.35	
FHLG 20YR 3% 06/01/2033#K90684	32,489.26	34,337.24	
FHLG 20YR 3% 06/33#K90806	46,687.35	49,342.92	
FHLG 20YR 3% 07/01/2033#C91714	134,232.31	141,867.44	
FHLG 20YR 3.0% 06/01/2033#C917	29,166.50	30,825.49	
FHLM .375% 04/20/23	1,150,000.00	1,153,300.50	
FHMS 21-F113 AS SOF30A+22 5/28	700,000.00	701,799.00	
FHMS K-F111 AS SOFR30A+24 3/31	399,994.32	400,554.31	
FHMS K-F112 AS .25% 04/31	1,200,000.00	1,203,300.00	
FNMA 0.625% 04/22/25	110,000.00	110,213.40	
FNMA 20YR 3% 05/01/2033#AT3000	27,166.45	28,702.16	
FNMA 20YR 3% 06/33#AT6090	26,933.43	28,455.97	
FNMA 20YR 3% 07/01/2033#MA1490	124,874.07	131,933.20	
HUTAMA KARYA P 3.75% 5/30 144A	200,000.00	215,536.00	
MDC GMTN BV 2.875% 5/21/30 RGS	200,000.00	209,412.00	
NAT BK OF UZBEK 4.85% 10/21/25	200,000.00	208,412.00	
OCP SA 3.75% 06/23/31 144A	200,000.00	202,750.00	
OMAN OIL 5.125% 05/06/28 144A	200,000.00	200,460.00	
PDVSA 12.75% 2/17/22 144A	400,000.00	16,000.00	
PDVSA PETR VENZ 5.375% 4/12/27	325,000.00	13,812.50	

PEMEX 6.49% 01/23/27	460,000.00	485,070.00	
PEMEX 6.5% 01/23/29	235,000.00	241,521.25	
PEMEX 6.875% 10/16/25 144A	70,000.00	77,280.00	
PEMEX 6.95% 01/28/60	460,000.00	401,879.00	
PEMEX 7.69% 01/23/50	678,000.00	646,642.50	
PEMEX PRO FDG 6.625% 6/15/35	915,000.00	870,869.55	
PETROL VENEZUELA 6% 11/26 144A	1,090,000.00	46,325.00	
PETROLEOS MEX 3.5% 1/30/23	170,000.00	172,740.40	
PETROLEOS MEX 4.25% 01/25 WI	330,000.00	337,365.60	
PETROLEOS MEX 6.5% 6/02/41	500,000.00	444,780.00	
PETROLEOS MEXCNS 6.75% 9/21/47	495,000.00	434,362.50	
PETROLEOS MEXI 4.625% 09/21/23	210,000.00	217,980.00	
PETROLEOS MEXICA 6.5% 03/13/27	60,000.00	63,021.00	
PETROLEOS MEXICANOS FRN 3ML+ 0	150,000.00	151,308.00	
PETROLEOS MX 4.875% 1/24 WI	250,000.00	261,607.50	
PETROLEOS VENZ 9.75 5/35 144A	670,000.00	26,800.00	
PRIVATE EXPORT 1.75% 11/15/24	920,000.00	954,270.00	
PT PERTA PR 4.15% 2/25/60 144A	140,000.00	142,825.20	
QATAR PETE 1.375% 09/12/26 144A	200,000.00	199,750.00	
QATAR PETE 2.25% 07/12/31 144A	230,000.00	230,287.50	
QATAR PETE 3.3% 07/12/51 144A	200,000.00	206,000.00	
SOUTHERN GAS 6.875% 03/26 144A	325,000.00	387,013.25	
TVA 5.25% 9/15/39	267,000.00	394,222.83	
TVA 5.5% 6/15/38	4,000.00	5,959.76	
YPF SA 8.5% 03/23/25 RGS	189,000.00	171,020.43	
YPF SOCIEDAD 8.75% 4/4/24 144A	240,000.00	213,420.00	

	アメリカ・ドル	小計	17,035,696.79	14,817,791.50 (1,623,585,415)	
特殊債券 合計				1,623,585,415 (1,623,585,415)	
社債券	アメリカ・ドル	1011778 BC ULC 4% 10/15/30 144A	525,000.00	512,531.25	
		1011778 ULC 3.875% 01/28 144A	160,000.00	160,400.00	
		ACADEMY LTD 6% 11/15/27 144A	235,000.00	251,450.00	
		ACRISURE 10.125% 08/01/26 144A	110,000.00	123,750.00	
		ACRISURE LLC 7% 11/15/25 144A	875,000.00	887,486.25	
		ADARO INDO 4.25% 10/31/24 144A	345,000.00	354,766.95	
		ADT SECURITY CO 4.125% 08/01/2	160,000.00	159,400.00	
		ADTALEM GLOBA 5.5% 03/01/28 144A	230,000.00	236,143.30	
		ADVANCED DRAIN 5% 9/30/27 144A	40,000.00	41,700.00	
		AEROPUERTO INT 5.625 5/36 144A	200,000.00	224,124.00	
		AFFINTY GME 6.875% 12/15/27 144A	65,000.00	68,155.75	
		AHP HEALTH PAR 5.75% 7/29 144A	190,000.00	191,425.00	
		ALBERTSONS 3.5% 03/15/29 144A	115,000.00	114,450.30	
		ALBERTSONS 4.625% 1/15/27 144A	325,000.00	340,453.75	
		ALBERTSONS 4.875% 2/15/30 144A	540,000.00	576,450.00	
		ALCOA INC GLB 5.95 2/1/37	115,000.00	142,600.00	
		ALCOA NEDERLAND 4.125% 03/31/29 144A	205,000.00	212,638.30	
		ALFA BANK 8%/VAR PERP RGS	400,000.00	408,072.00	
		ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 5.8	190,000.00	199,025.00	
		ALLEN MEDIA 10.5% 02/28 144A	455,000.00	481,162.50	
ALLIANT HLDG 6.75% 10/27 144A	730,000.00	761,025.00			
ALLIED UN 4.625% 06/01/28 144A	147,000.00	146,632.50			

ALLIED UNV 6% 06/01/29 144A	75,000.00	74,695.50	
ALLY 8% GLOBAL	470,000.00	669,496.20	
ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31	1,714,000.00	2,477,415.60	
ALLY FINL INC 5.8% 05/01/2025	2,000.00	2,326.78	
ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18 Escrow	610,000.00	-	
ALROSA FINA 3.1% 06/25/27 144A	200,000.00	205,000.00	
ALTICE FING 5% 01/15/28 144A	200,000.00	194,188.00	
ALTICE FING SA 7.5% 05/26 144A	355,000.00	369,061.55	
ALTICE FR HLDS 6% 2/15/28 144A	190,000.00	186,675.00	
ALTICE FRAN 10.5% 5/15/27 RGS	430,000.00	470,183.50	
ALTICE FRANCE 5.125% 01/15/29 144A	155,000.00	154,759.75	
ALTICE FRANCE 5.125% 7/29 144A	320,000.00	319,904.00	
ALTICE FRANCE 8.125% 2/27 144A	480,000.00	518,073.60	
ALTICE FRANCE SA 5.5% 01/15/20	385,000.00	392,700.00	
AMWINS GROUP 4.875% 06/30/29 144A	100,000.00	100,400.00	
ANTERO MIDS 5.75% 1/15/28 144A	185,000.00	192,862.50	
ANTERO RES CORP 7.625% 02/01/29 144A	165,000.00	179,457.30	
ANTOFAGASTA PLC 2.375% 10/14/30 144A	200,000.00	192,000.00	
APACHE CORP 0% 08/31/25	175,000.00	185,937.50	
APACHE CORP 0% 08/31/27	405,000.00	428,890.95	
APX GROUP INC 7.625% 09/01/23	235,000.00	240,945.50	
ARCHES BUYER 4.25% 06/01/28 144A	110,000.00	109,587.50	
ARCHES BUYER 6.125% 12/01/28 144A	40,000.00	41,400.00	

ARCHROCK PR 6.25% 4/1/28 144A	185,000.00	189,625.00	
ARCONIC ROLLED 6% 5/15/25 144A	110,000.00	115,967.50	
ARD FIN SA 6.5% 06/30/27 144A	185,000.00	193,325.00	
ASBURY AUTOMOTI 4.5% 03/01/28	54,000.00	55,620.00	
ASBURY AUTOMOTI 4.75% 03/01/30	52,000.00	54,275.00	
ASGN INC 4.625% 05/15/28 144A	445,000.00	462,800.00	
ASHTON WO 6.625% 01/15/28 144A	5,000.00	5,337.50	
ASHTON WOODS 9.875% 04/01/27 144A	150,000.00	167,250.00	
ASSUREDPARTNE 5.625% 01/15/29 144A	100,000.00	100,000.00	
ATLAS LUX 4.625% 06/01/28 144A	98,000.00	97,272.84	
AVANTOR FUNDING 4.625% 07/15/28 144A	235,000.00	246,247.10	
AVIS BUDGET 5.375% 03/01/29 144A	115,000.00	118,018.75	
AVOLON HLD 4.375% 5/01/26 144A	2,000.00	2,195.06	
AVOLON HLDGS 3.95% 7/24 144A	2,000.00	2,135.22	
AVOLON HLDGS 5.125% 10/23 144A	290,000.00	313,898.90	
AZUL INVEST 5.875% 10/27 144A	225,000.00	214,353.00	
AZUL INVTS LLP 7.25% 06/15/26 144A	200,000.00	191,000.00	
B2W DIGITAL 4.375% 12/30/30 144A	265,000.00	266,126.25	
BAIDU INC 1.72% 04/09/26	200,000.00	203,036.00	
BAIDU INC 2.375% 10/09/30	200,000.00	203,912.00	
BAIDU INC 3.075% 04/07/2025	200,000.00	212,792.00	
BALL CORP 4.875% 3/15/26	250,000.00	279,750.00	
BANCO DE RESERVAS 7% 2/23 144A	350,000.00	360,500.00	
BANCO MERC 6.875/VAR PERP 144A	450,000.00	465,691.50	

BANFF MERGER 9.75% 9/26 144A	400,000.00	420,020.00	
BANK OF AMERICA 5.86%/VAR PERP	375,000.00	431,085.00	
BCPE CYCLE MERGER SUB II INC 1	110,000.00	117,647.20	
BCPE ULYSS IN 7.75% 04/01/27 144A	210,000.00	211,050.00	
BERRY GBL ES 4.875% 7/26 144A	120,000.00	126,752.40	
BERRY GBL ES 5.625% 7/27 144A	100,000.00	105,299.00	
BGEO GROUP JSC 6% 7/26/23 144A	295,000.00	311,962.50	
BIG RIV STL LLC 6.625% 01/31/2	520,000.00	569,400.00	
BIM LAND JSC 7.375% 5/26 RGS	200,000.00	189,000.00	
BIZ FIN (UKRXB) 9.625% 4/22 144	105,833.34	108,829.47	
BK OF AMERCA CORP 4.3%/VAR PRP	420,000.00	432,751.20	
BLACK KNIGHT 3.625% 09/28 144A	185,000.00	185,697.45	
BOBOMBARDIER 7.125% 06/26 144A	240,000.00	247,800.00	
BOMBARDIER 7.875% 04/27 144A	630,000.00	640,187.10	
BOMBARDIER INC 7.5% 03/25 144A	455,000.00	461,574.75	
BOMBARDIER INC 7.5% 12/24 144A	330,000.00	342,375.00	
BOOZ ALLEN 3.875% 9/01/28 144A	170,000.00	172,125.00	
BOYD GAMING 4.75% 12/01/27	340,000.00	347,905.00	
BRAND ENERGY 8.5% 7/25 144A	920,000.00	933,800.00	
C AND S GRP 5% 12/15/28 144A	130,000.00	129,025.00	
C&W SR FIN 6.875% 9/15/27 144A	1,455,000.00	1,547,756.25	
CABLE ONDA 4.5% 01/30/30 144A	200,000.00	210,912.00	
CABLEVS LHT 5.625% 09/15/28 144A	70,000.00	71,582.00	
CABLEVS LT LLC 3.875% 9/15/27 144A	90,000.00	89,662.50	
CALIFORNIA 7.125% 02/01/26 144A	295,000.00	295,368.75	

CAMELOT FIN SA 4.5% 11/26 144A	175,000.00	182,218.75	
CAMPOSOL SA 6% 02/03/2027 144A	275,000.00	288,200.00	
CANPACK SA 3.125% 11/01/25 144A	115,000.00	116,889.45	
CARNIVAL COR 5.75% 3/1/27 144A	405,000.00	405,081.00	
CARNIVAL CORP 0% 01/31/26 144A	240,000.00	273,000.00	
CARNIVAL CORP 9.875% 08/01/27 144A	640,000.00	728,000.00	
CARVANA CO 5.875% 10/01/28 144A	175,000.00	182,670.25	
CATALENT PHARM 5% 6/30/27 144A	70,000.00	73,201.10	
CCO HLDGS 4.75% 03/01/30 144A	415,000.00	437,285.50	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 04/33 144A	320,000.00	328,400.00	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 05/01/32	145,000.00	149,877.80	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 08/30 144A	390,000.00	407,550.00	
CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144	920,000.00	961,492.00	
CDK GLOBAL INC 5.25% 5/29 144A	100,000.00	108,719.00	
CDW LLC / CDW F 4.25% 04/01/28	235,000.00	242,849.00	
CEC ENT CO LLC 6.75% 5/26 144A	160,000.00	160,600.00	
CEMEX SAB 5.125/VAR PERP 144A	200,000.00	208,060.00	
CENTENE CORP 3% 10/15/30	175,000.00	179,415.25	
CENTENE CORP 3.375% 2/15/30 WI	155,000.00	160,572.25	
CENTENE CORP 4.625% 12/15/29	290,000.00	316,738.00	
CENTENE CORP 5.375% 08/15/26 R	155,000.00	161,138.00	
CENTENE ESCRO 5.375% 6/26 144A	690,000.00	718,372.80	
CENTRAL GARDEN 4.125% 10/15/30	115,000.00	117,846.25	
CENTURYLINK 5.125% 12/26 144A	500,000.00	515,625.00	

CENTURYLINK INC 4% 02/27 144A	310,000.00	317,750.00	
CF INDUS INC 5.375% 03/15/44	465,000.00	587,062.50	
CF INDUSTRI INC 5.15% 03/15/34	305,000.00	375,024.95	
CF INDUSTRIES INC 4.95% 6/43	220,000.00	266,068.00	
CHARLES RIV 4.25% 5/1/28 144A	55,000.00	57,131.25	
CHARLES RIVER L 3.75% 03/15/29 144A	55,000.00	55,756.25	
CHARLES RIVER L 4% 03/15/31 144A	160,000.00	166,296.00	
CHEMOURS CO 5.375% 05/15/2027	725,000.00	783,507.50	
CHEMOURS CO 5.75% 11/15/28 144A	465,000.00	489,412.50	
CHEMOURS CO 7% 05/15/2025	350,000.00	360,640.00	
CHENIERE ENER 4.625% 10/15/28	570,000.00	599,605.80	
CHENIERE ENERG 5.625% 10/01/26	275,000.00	283,167.50	
CHESAPEAKE 5.5% 02/01/26 144A	160,000.00	165,816.00	
CHESAPEAKE 5.875% 2/01/29 144A	170,000.00	178,840.00	
CHOBANI LLC/FIN 4.625% 11/15/28	100,000.00	103,125.00	
CHS/CMNTY HEA 6.875% 04/15/29 144A	220,000.00	228,525.00	
CHS/CMNTY HEALT 4.75% 02/15/31 144A	225,000.00	225,000.00	
CHS/CMNTY HEALT 6% 01/15/29 144A	175,000.00	184,156.00	
CHS/CMNTY HEALT 6.125% 04/01/30 144A	290,000.00	286,360.50	
CHS/CMNTY HEALTH 8% 3/26 144A	850,000.00	903,907.00	
CHS/CMNTY HLT 5.625% 03/15/27 144A	170,000.00	179,350.00	
CHUKCHANSI ECO 8% 04/15/28 RGS	8,367.91	7,447.43	
CITGO HLDG INC 9.25% 08/01/24 144A	210,000.00	207,536.70	

CITGO PETE COR 7% 6/15/25 144A	410,000.00	419,606.30	
CITGO PETROL 6.375% 06/26 144A	205,000.00	210,125.00	
CITIGROUP 5.35% PERP	875,000.00	904,531.25	
CITIGROUP INC 4.7%/VAR PERP	235,000.00	242,931.25	
CITIGROUP INC 5%/VAR PERP	350,000.00	367,167.50	
CLEAR CHAN 7.75% 04/15/28 144A	110,000.00	112,029.50	
CLEAR CHAN IN 6.625% 08/01/25 144A	200,000.00	208,750.00	
CLEARWY ENR 4.75% 3/15/28 144A	110,000.00	114,675.00	
CLEVELAND-CLIF 4.625% 3/1/29 144A	115,000.00	120,750.00	
CLEVELAND-CLIF 4.875% 3/1/31 144A	115,000.00	122,475.00	
CNX RESOURCES C 6% 01/15/29 144A	85,000.00	90,206.25	
COGENT COMM 3.5% 05/01/26 144A	125,000.00	126,641.25	
COLGATE ENERGY 5.875% 07/01/29	100,000.00	102,500.00	
COMMERCIAL META 3.875% 02/15/31	90,000.00	91,126.80	
COMSTOCK 5.875% 01/15/30 144A	115,000.00	115,287.50	
COMSTOCK RESO 6.75% 03/29 144A	265,000.00	272,775.10	
CONSLIDATED COM 5% 10/28 144A	100,000.00	99,390.00	
CONSOLIDATED 6.5% 5/26 144A	505,000.00	513,837.50	
CONTINENTAL OK 5.75% 1/31 144A	230,000.00	271,975.00	
CONTINENTAL RES 4.5% 4/23 WI	7,000.00	7,195.86	
CORECIVIC INC 0% 04/30/26	265,000.00	275,600.00	
CORPORACION NA 3.75% 1/31 144A	200,000.00	219,750.00	
COSAN OVERSEAS 8.25% PERP	325,000.00	332,575.75	
COVEY PK 7.5% 5/15/25 144A	215,000.00	222,525.00	

CQP HOLDCO 5.5% 06/15/31 144A	530,000.00	551,200.00	
CRC ESCROW 5.25% 10/15/25 144A	720,000.00	723,794.40	
CRESTWOOD M P/F 6% 02/01/29 144A	580,000.00	595,950.00	
CROCS INC 4.25% 03/15/29 144A	115,000.00	117,012.50	
CROWDSTRIKE HOL 3% 02/15/29	205,000.00	206,793.75	
CROWNROCK LP / 5% 05/1/29 144A	60,000.00	61,650.00	
CSC HLDGS LLC 3.375% 02/15/31 144A	230,000.00	215,944.70	
CSC HLDGS LLC 4.125% 12/01/30 144A	170,000.00	168,886.50	
CSC HLDGS LLC 4.5% 11/15/31 144A	160,000.00	159,851.20	
CSC HLDGS LLC 4.625% 12/01/30 144A	400,000.00	391,000.00	
CSC HLDGS LLC 5% 11/15/31 144A	170,000.00	170,212.50	
CSC HOLDINGS 5.75% 01/30 144A	305,000.00	317,215.25	
CSC HOLDINGS 6.5% 2/1/29 144A	490,000.00	538,387.50	
CSC HOLDINGS 7.5% 4/1/28 144A	690,000.00	748,022.10	
CVR ENERGY 5.25% 2/15/25 144A	370,000.00	355,200.00	
CVR ENERGY 5.75% 02/15/28 144A	370,000.00	362,507.50	
CVR PART LP/FIN 6.125% 06/15/28 144A	220,000.00	222,294.60	
DAE FDG LLC 1.55% 08/01/24 144A	200,000.00	199,000.00	
DANA INC 4.25% 09/01/30	105,000.00	107,474.85	
DANA INC 5.625% 6/15/28	160,000.00	171,091.20	
DAVITA INC 0% 05/31/30 144A	480,000.00	492,096.00	
DAVITA INC 3.75% 02/15/31 144A	175,000.00	168,000.00	
DCP MIDSTR 5.85% 5/21/43 144A	185,000.00	171,125.00	

DCP MIDSTREAM 5.125% 05/15/29	320,000.00	353,200.00	
DCP MIDSTREAM 5.625% 07/15/27	145,000.00	164,575.00	
DCP MIDSTREAM OP 5.375% 07/25	400,000.00	436,892.00	
DEL MONTE 11.875% 5/15/25 144A	60,000.00	68,100.00	
DELEK LOGISTIC 7.125% 06/01/28 144A	110,000.00	116,023.60	
DIAMOND SPORTS GROUP LLC / DIA	220,000.00	128,700.00	
DISH DBS CORP 5.875% 11/24	160,000.00	170,635.20	
DISH DBS CORP 5.875% 7/22	485,000.00	501,945.90	
DISH NETWK CV 3.375% 8/26 144A	653,000.00	651,367.50	
DP WORLD CRESC 3.875% 7/29 RGS	400,000.00	433,500.00	
DPL INC 4.125% 07/01/25	550,000.00	584,034.00	
DPL INC 4.35% 04/15/29	529,000.00	573,922.68	
DT MIDSTREAM 4.125% 06/15/29 144A	185,000.00	187,775.00	
DT MIDSTREAM 4.375% 06/15/31 144A	185,000.00	189,859.95	
EG GLOBAL 8.5% 10/30/25 144A	115,000.00	119,226.25	
EG GLOBAL FINANCE PLC 6.75% 02	670,000.00	688,425.00	
ELASTIC 4.125% 07/15/29 144A	90,000.00	89,887.50	
ELDORADO RESRT 8.125% 07/01/27	845,000.00	929,500.00	
EMBRAER NETHER 5.05% 6/15/25	150,000.00	157,995.00	
EMERGENT BIO 3.875% 08/15/30 144A	110,000.00	107,250.00	
EMIRATES NBD PJ VAR PERP REGS	200,000.00	205,000.00	
ENDEAVOR 6.625% 7/15/25 144A	165,000.00	173,629.50	
ENDEAVOR ENERGY 5.75 1/28 144A	375,000.00	387,483.75	
ENDURANCE ACQ 6% 02/15/29 144A	115,000.00	114,163.95	

ENER 4.875% 3/30/26 144A RGS	125,000.00	127,810.00	
ENFRAGEN ENERG 5.375% 12/30/30 144	200,000.00	199,500.00	
ENLINK MID 5.625% 01/15/28 144A	75,000.00	78,937.50	
ENN CLEAN ENE 3.375% 5/26 144A	200,000.00	204,890.00	
ENSCO PLC 5.2% 3/15/25	140,000.00	14,000.00	
ENTERCOM MED 6.5% 5/01/27 144A	120,000.00	123,600.00	
ENTERCOM MEDIA 6.75% 03/31/29 144A	135,000.00	137,025.00	
ENVIVA PT LP 6.5% 1/15/26 144A	250,000.00	260,625.00	
EQT CORP 5% 01/15/29	175,000.00	195,912.50	
EQT MIDSTR 6.5% 07/01/27 144A	215,000.00	240,800.00	
ESKOM HLDGS 7.125% 2/25 144A	460,000.00	482,797.60	
FERRELLGAS/FG 5.375% 04/01/26 144A	135,000.00	132,837.30	
FFCB .375% 04/08/22	1,500,000.00	1,503,330.00	
FIRST QUANT 6.875% 10/27 144A	585,000.00	637,287.30	
FIRST QUANTUM 6.5% 3/24 144A	305,000.00	311,289.10	
FIRST QUANTUM 6.875% 3/26 144A	305,000.00	319,627.80	
FIRST QUANTUM 7.25% 4/23 144A	890,000.00	904,462.50	
FIRST QUANTUM 7.5% 4/25 144A	385,000.00	398,070.75	
FLY LEASING 5.25% 10/15/24	160,000.00	161,600.00	
FMG RES AUG LTD 4.375% 04/01/31 144A	120,000.00	129,300.00	
FORD MOTOR 9% 04/22/25	360,000.00	441,219.60	
FORD MOTOR 9.625% 4/22/30	130,000.00	186,352.40	
FORD MTR CR 5.125% 6/16/25	515,000.00	562,637.50	
FORD MTR CR CO 3.087% 1/9/23	370,000.00	376,241.90	

FORD MTR CR LLC 2.9% 02/16/28	155,000.00	153,643.75	
FORD MTR CR LLC 3.375% 11/13/25	115,000.00	119,278.00	
FORD MTR CR LLC 4% 11/13/30	115,000.00	120,246.30	
FREEMPORT MCMOR 4.625% 08/01/30	175,000.00	188,798.75	
FREEMPORT MCMORAN INC5.4% 11/34	80,000.00	99,600.00	
FRONT RANGE BID 4% 3/1/27 144A	300,000.00	296,625.00	
FRONT RANGE BIDCO INC 6.125% 0	165,000.00	166,230.90	
FRONTIER 5.875% 11/01/29 144A	52,213.00	53,061.46	
FRONTIER COM 5.875% 10/15/27 144A	170,000.00	181,918.70	
FRONTIER COMM 5% 05/01/28 144A	175,000.00	180,250.00	
FRONTIER COMM 6.75% 05/01/29 144A	195,000.00	206,653.20	
GALAXY PIPE 2.625% 03/31/36 144A	200,000.00	196,650.00	
GEMS MENAS 7.125% 7/31/26 144A	1,015,000.00	1,042,151.25	
GENESIS ENERGY LP 8% 01/15/27	200,000.00	204,690.00	
GENM CAPITAL LA 3.882% 04/19/3	200,000.00	201,422.00	
GEO GROUP 5.125% 4/1/23 WI	125,000.00	117,812.50	
GEO GROUP INC 5.875% 10/15/24	50,000.00	45,375.00	
GEO GROUP INC 6% 04/15/26	445,000.00	357,962.45	
GEOPARK LTD 5.5% 01/17/27 144A	200,000.00	201,786.00	
GEOPARK LTD 6.5% 09/24 144A	200,000.00	206,100.00	
GEORGIA BK 11.125/VAR PERP RGS	250,000.00	269,812.50	
GLOBAL PARTNER 6.875% 01/15/29	175,000.00	185,463.25	
GLP CAP LP / GLP 5.25% 6/25	265,000.00	298,450.95	
GLP CAP LP/ FIN II 5.375% 4/26	210,000.00	241,810.80	
GO DADDY OP 5.25% 12/1/27 144A	170,000.00	177,966.20	

GOLDEN NUGGET 8.75% 10/25 144A	235,000.00	247,631.25	
GPC MERGER SU 7.125% 8/15/28 144A	100,000.00	107,000.00	
GRAFTECH 4.625% 12/15/28 144A	160,000.00	164,884.80	
GUARA NORTE S 5.198% 6/34 144A	93,317.55	96,874.81	
GYPSUM MANAGEME 4.625% 05/01/29 144A	155,000.00	155,889.70	
H&E EQUIPMENT S 3.875% 12/15/28	285,000.00	279,570.75	
HARVEST MIDSTRE 7.5% 9/28 144A	400,000.00	431,000.00	
HAWAIIAN BRAND 5.75% 01/20/26 144A	170,000.00	178,231.40	
HCA INC 5.625% 09/01/28	305,000.00	361,638.50	
HCA INC 5.875% 02/01/2029	130,000.00	156,812.50	
HCA INC 5.875% 02/15/26	595,000.00	687,225.00	
HCA INC 5.875% 5/01/23	65,000.00	70,293.60	
HCRX INVESTM 4.5% 08/01/29 144A	80,000.00	81,080.00	
HERTZ 5.5% 10/15/24 144A	210,000.00	-	
HERTZ CORP 6% 01/15/2028 144A	265,000.00	-	
HERTZ CORP 6.25% 10/15/22	190,000.00	-	
HERTZ CORP 7.125% 08/01/2026 1	265,000.00	-	
HESS MIDST 5.125% 6/15/28 144A	220,000.00	229,112.40	
HESS MIDSTREAM 5.625% 02/15/26	365,000.00	378,687.50	
HIGHTOWER 6.75% 04/15/29 144A	70,000.00	71,225.00	
HILTON DOMEST 3.625% 02/15/32 144A	115,000.00	114,137.50	
HILTON DOMESTIC 3.75% 05/01/29	115,000.00	115,575.00	
HILTON DOMESTIC 4% 05/01/31 144A	115,000.00	116,408.75	
HOLOGIC INC 3.25% 02/15/29 144A	175,000.00	175,217.00	

HTA GROUP LTD/M 7% 12/18/25 14	200,000.00	212,036.00	
HUB INTEL LTD 7% 5/01/26 144A	260,000.00	268,775.00	
HUBBAY MINERAL 6.125% 4/01/29 144A	330,000.00	350,625.00	
ICAHN LP/FN COR 5.25% 05/15/27	435,000.00	452,400.00	
ICAHN LP/FN COR 6.25% 05/15/26	320,000.00	336,358.40	
ICAHN LP/FN COR 6.375% 12/15/2	500,000.00	515,000.00	
IHS MARKIT LTD 4% 3/1/26 144A	125,000.00	138,593.75	
IHS NETHERLAND 8% 9/18/27 144A	200,000.00	215,750.00	
IHS NTHLND 7.125% 3/18/25 144A	200,000.00	207,224.00	
IMS HEALTH 5% 10/15/26 144A	325,000.00	333,001.50	
INDIGO NATURAL 5.375 02/01/29 144A	350,000.00	358,750.00	
INDIKA ENERG 5.875% 11/24 144A	200,000.00	203,600.00	
INDONESIA ASA 5.45% 05/30 144A	200,000.00	233,162.00	
INFRABUILD AUST 12% 10/24 144A	450,000.00	465,750.00	
INTELSAT J H SA 5.5% 08/01/23	575,000.00	327,750.00	
INTELSAT JACKS 8.5% 10/24 144A	120,000.00	69,600.00	
INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A	5,535,000.00	5,465,812.50	
INTERTAPE POLYM 4.375% 06/15/29 144A	105,000.00	106,575.00	
INVESTMENT EGY 6.25% 4/29 144A	200,000.00	216,584.00	
ION TRADIN 5.75% 05/15/28 144A	200,000.00	208,500.00	
ITAU UNIBA 6.125/VAR PERP 144A	520,000.00	525,980.00	
JAZZ SECU DAC 4.375% 01/15/29	145,000.00	149,381.90	
JBS INV II GMBH 7% 1/26 144A	220,000.00	232,432.20	
JBS INVEST 5.75% 1/15/28 144A	200,000.00	210,176.00	

JBS USA LLC 6.5% 4/15/29 144A	295,000.00	331,875.00	
JBS USA/FIN 6.75% 02/28 144A	595,000.00	650,781.25	
JBS USA/LUX/FI 5.5% 01/30 144A	355,000.00	393,822.80	
JOSEPH T RYER 8.5% 8/1/28 144A	115,000.00	126,634.55	
JPMORGAN CHASE 5.15% PERP	1,810,000.00	1,866,562.50	
KAZAKHSTAN TEMR 6.95 7/42 144A	100,000.00	137,800.00	
KAZMUNAIGAZ 6.375% 10/48 144A	75,000.00	98,812.50	
KAZMUNAIGAZ FI 5.75% 4/47 144A	85,000.00	105,612.50	
KAZMUNAYGAS 3.5% 04/14/33 144A	200,000.00	207,200.00	
KEHE DISTR LLC / KEHE FIN COR	152,000.00	166,060.00	
KENNEDY-WILSON 4.75% 03/01/29	170,000.00	174,471.00	
KENNEDY-WILSON 5% 03/01/31	170,000.00	174,046.00	
KFC CO/PIZZA 4.75% 6/1/27 144A	255,000.00	265,059.75	
KLX ENERGY 11.5% 11/1/25 144A	245,000.00	165,375.00	
KOSMOS ENERGY 7.125% 4/26 144A	335,000.00	331,650.00	
KRAFT HEINZ CO 4.375% 6/1/46	50,000.00	57,149.50	
KRAFT HEINZ FD 4.875% 10/01/49	255,000.00	313,257.30	
KRAFT HEINZ FD 5.5% 06/01/50	70,000.00	92,083.60	
KRONOS ACQ 7% 12/31/27 144A	50,000.00	48,114.00	
KRONOS ACQ K 5% 12/31/26 144A	40,000.00	40,576.80	
L BRANDS INC 6.625% 10/01/30 144A	350,000.00	406,000.00	
LAMAR MEDIA CRP 4.875% 01/15/2	140,000.00	147,350.00	
LANDRYS 6.75% 10/15/24 144A	710,000.00	713,550.00	
LBC TANK TRM 6.875 5/15/23 144	555,000.00	553,890.00	

LCM INVESTMENTS 4.875% 05/01/29 144A	190,000.00	193,330.70	
LCPR SENIOR 5.125% 7/29 144A	400,000.00	410,500.00	
LCPR SR 6.75% 10/15/27 144A	200,000.00	212,754.00	
LENOVO GROUP LT 3.421% 11/02/30 144A	200,000.00	211,286.00	
LEVEL 3 FIN 3.75% 07/15/29 144A	295,000.00	284,371.15	
LEVEL 3 FINANCI 4.25% 07/01/28	230,000.00	232,063.10	
LEVIATHAN 6.125% 6/30/25 144A	275,000.00	299,750.00	
LIQUID TELECOMM 5.5% 09/26 144A	200,000.00	204,000.00	
LIVE NATIN 4.75% 10/15/27 144A	230,000.00	234,600.00	
MADISON IAQ 4.125% 06/28 144A	130,000.00	129,675.00	
MADISON IAQ 5.875% 6/29 144A	200,000.00	202,500.00	
MAGIC MERG 5.25% 05/1/28 144A	170,000.00	171,541.90	
MAGIC MERG 7.875% 05/1/29 144A	255,000.00	258,812.25	
MAGNOLIA OIL & GAS OPER LLC /	255,000.00	262,012.50	
MARRIOTT OWNERS 4.5% 06/15/29	170,000.00	169,887.80	
MATCH GROUP INC 4.125% 08/01/2	180,000.00	184,500.00	
MATCH GROUP INC 5% 12/27 144A	225,000.00	235,887.75	
MATCH GRP 5.625% 02/15/29 144A	195,000.00	211,087.50	
MATTEL INC 3.375% 04/01/26 144A	55,000.00	56,712.15	
MATTEL INC 3.75% 04/01/29 144A	55,000.00	57,736.25	
MC BRAZIL DWNST 7.25% 06/31 144A	790,000.00	813,305.00	
MEDCO BELL PTE 6.375% 01/30/27	340,000.00	352,223.00	
MEG ENERGY 7.125% 2/01/27 144A	370,000.00	388,500.00	

MEG ENERGY CRP 5.875% 02/01/29 144A	335,000.00	334,621.45	
MEGLBL CANADA 5% 5/18/25 144A	200,000.00	223,536.00	
MEITUAN 3.05% 10/28/30 144A	200,000.00	198,260.00	
MEITUAN D 2.125% 10/28/25 144A	200,000.00	199,350.00	
MESQUITE 15% PIK CONV 7/23 PP	78,888.00	295,830.00	
MESQUITE 15% PIK CONV 7/23 PP	135,419.00	460,424.60	
MGIC INVT CORP 5.25% 08/15/28	125,000.00	133,125.00	
MGM GROWTH/MGP 4.625% 06/15/25 144A	345,000.00	365,406.75	
MGM GROWTH/MGP 5.75% 02/01/27	205,000.00	227,318.35	
MGM RESORTS INTERNATIONAL 6.75	240,000.00	255,600.00	
MICROSTRATEGY 6.125% 06/15/28	125,000.00	123,437.50	
MILEAGE PLUS 6.5% 6/20/27 144A	180,000.00	195,525.00	
MILLICOM INTL 4.5% 04/27/31 144A	200,000.00	208,450.00	
MOLINA HEA 4.375% 6/15/28 144A	120,000.00	125,245.20	
MOLINA HEALTHCA 3.875% 11/15/30 144A	170,000.00	178,481.30	
MOOG INC 4.25% 12/15/2027 144A	55,000.00	56,375.00	
MPT OPER PARTNER 5% 10/15/27	911,000.00	961,105.00	
MPT OPER PARTNERSHIP LP/CORP 4	535,000.00	571,781.25	
MPT OPER PARTNERSHP 5.25% 8/26	300,000.00	308,250.00	
MUMTALAKAT 4.1% 01/21/27 RGS	200,000.00	202,100.00	
MUMTALAKAT SUKUK HOLDING COMPA	200,000.00	211,724.00	
MURPHY OIL 5.875% 12/01/27	115,000.00	119,025.00	
MURPHY OIL USA 3.75% 02/15/31 144A	75,000.00	74,062.50	

MURPHY OIL USA INC 4.75% 09/15	120,000.00	125,524.80	
NAGACORP 7.95% 07/06/24 RGS	200,000.00	204,350.00	
NAK NAFTA 7.625% 11/08/26 144A	200,000.00	205,474.00	
NATURA COSME 4.125% 5/28 144A	200,000.00	204,760.00	
NAVIOS 8.125% 11/15/21 144A	935,000.00	785,400.00	
NAVIOS LOG/FI 10.75% 7/25 144A	150,000.00	165,000.00	
NAVIOS MARIT 11.25% 8/22 144A	475,000.00	479,750.00	
NAVIOS MARITIM 7.375 1/22 144A	1,565,000.00	1,351,768.75	
NBM US HO 6.625% 08/06/29 144A	75,000.00	84,000.00	
NCL COR 10.25% 02/01/26 144A	365,000.00	414,267.70	
NCL CORP LTD 5.875 03/15/26 144A	55,000.00	54,943.35	
NCL FINANCE LTD 6.125% 03/15/28 144A	70,000.00	71,208.90	
NESCO HOLDING 5.5% 04/15/29 144A	135,000.00	139,050.00	
NETFLIX 5.875% 11/15/28	410,000.00	501,827.70	
NEW FORTRESS EN 6.75% 09/15/25	175,000.00	177,444.75	
NEW HOME CO 7.25% 10/15/25 144A	115,000.00	121,900.00	
NEXA RESOURCES 6.5% 01/18/28 1	200,000.00	227,090.00	
NEXSTAR 5.625% 7/15/27 144A	220,000.00	232,034.00	
NEXTERA ENERGY 4.25% 9/24 144A	21,000.00	22,155.00	
NEXTERA ENERGY 4.5% 9/27 144A	145,000.00	156,234.60	
NGL ENERGY OP 7.5% 02/01/26 144A	575,000.00	592,250.00	
NIELSEN FIN 5.875% 10/01/30 144A	175,000.00	189,603.75	
NIELSEN FINAN 5.625% 10/01/28 144A	175,000.00	184,406.25	

NORTHWEST FIN 10.75% 06/01/28 144A	95,000.00	106,480.75	
NORTHWEST FIN 6% 02/15/28 144A	60,000.00	59,808.00	
NOSTRUM OIL 8% 7/25/22 144A	805,000.00	221,375.00	
NRG ENERGY 5.25% 06/15/29 144A	185,000.00	194,808.70	
NRG ENERGY INC 3.375% 02/15/29	80,000.00	78,800.00	
NRG ENERGY INC 3.625% 02/15/31	160,000.00	158,262.40	
NRG ENERGY INC 6.625% 01/15/27	1,175,000.00	1,213,775.00	
NTH OIL & GAS 8.125% 03/01/28 144A	270,000.00	282,825.00	
OCCIDENTAL PETE 4.5% 07/15/44	65,000.00	62,562.50	
OCCIDENTAL PETE 5.5% 12/01/25	115,000.00	125,364.95	
OCCIDENTAL PETE 5.55% 03/15/26	212,000.00	229,490.00	
OCCIDENTAL PETE 5.875% 9/01/25	115,000.00	126,034.25	
OCCIDENTAL PETE 6.2% 03/15/40	75,000.00	86,250.00	
OCCIDENTAL PETE 6.45% 09/15/36	130,000.00	154,375.00	
OCCIDENTAL PETE 6.6% 03/15/46	170,000.00	205,700.00	
OCCIDENTAL PETE 6.95% 07/01/24	195,000.00	216,668.40	
OCCIDENTAL PETE 7.5% 05/01/31	725,000.00	901,298.25	
OCCIDENTAL PETR 6.375% 9/01/28	175,000.00	203,000.00	
OCCIDENTAL PETRO 4.3% 08/15/39	70,000.00	67,200.00	
OCCIDENTAL PETRO 6.125% 01/01/31	430,000.00	496,650.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM 4.4% 4/46	137,000.00	131,520.00	
OCCIDENTL PETE 8.875% 07/15/30	450,000.00	590,949.00	
OCI NV 5.25% 11/01/24 144A	282,000.00	288,195.54	
ODEBRECHT HOL 0% 09/10/58 144A	1,055,787.00	10,557.87	

OEC FIN LTD 7.125% 06/26/42 14	481,340.00	45,727.29	
OEC FIN LTD 7.5% PERP 144A	422,151.00	42,004.01	
OIL & GAS HLDG 7.5% 10/27 144A	610,000.00	676,831.60	
OLEODUCTO CENT 4% 7/14/27 144A	200,000.00	206,536.00	
ON SEMICONDUCT 3.875% 09/01/28 144A	215,000.00	221,235.00	
OORED00 2.625% 04/08/31 144A	200,000.00	202,000.00	
OPEN TEXT 4.125% 2/15/30 144A	245,000.00	251,125.00	
ORGANON F 4.125% 04/30/28 144A	215,000.00	217,423.05	
ORGANON FINAN 5.125% 04/30/31 144A	215,000.00	218,822.70	
ORTHO-CLI 7.25% 02/01/28 144A	45,000.00	48,937.50	
ORTHO-CLI D 7.375% 6/1/25 144A	89,000.00	95,118.75	
PAC DRLL 2LN PIK VAR 4/24 144A	24,395.00	975.80	
PACIFIC GAS & ELEC 3.95% 12/47	165,000.00	154,935.00	
PACIFIC GAS & ELE 3.75% 8/15/42	30,000.00	28,161.90	
PAO TMK 4.3% 02/12/27 RGS	200,000.00	200,974.00	
PARTY CITY HLD 8.75% 2/15/26 144A	85,000.00	89,250.00	
PBF HLD LL 9.25% 05/15/25 144A	460,000.00	430,100.00	
PBF HLD LLC/FIN 6% 02/15/28	425,000.00	233,750.00	
PBF HLDG / FIN 7.25% 06/15/25	250,000.00	155,625.00	
PBF LOGISTICS 6.875% 05/23	515,000.00	484,743.75	
PENINSULA 8.5% 11/15/27 144A	210,000.00	225,225.00	
PERFORMANCE FO 4.25% 08/01/29 144A	95,000.00	95,831.25	
PETRONAS CAP 4.8% 4/21/60 144A	200,000.00	274,422.00	
PETRONAS CAP LTD 3.5% 04/21/20	200,000.00	220,724.00	

PETRORIO LX 6.125% 6/9/26 144A	200,000.00	206,200.00	
PG&E 4.55% 07/01/30	1,177,500.00	1,269,757.12	
PG&E 4.95% 07/01/50	1,277,500.00	1,322,123.07	
PG&E CORP 5% 07/01/28	225,000.00	221,838.75	
PG&E CORP 5.25% 07/01/30	655,000.00	655,000.00	
PIKE CORP 5.5% 9/01/28 144A	140,000.00	144,858.00	
PLASTIPAK HLD 6.25% 10/25 144A	85,000.00	86,700.00	
POLYONE CO 5.75% 5/15/25 144A	140,000.00	146,941.20	
POST HLDGS 5.625% 01/28 144A	405,000.00	424,873.35	
POST HLDGS IN 4.625% 4/30 144A	270,000.00	273,555.90	
POST HLDGS INC 4.5% 09/15/31 144	115,000.00	114,936.75	
PRIDE INTL INC 7.875% 8/15/40	685,000.00	116,450.00	
PROSUS NV 4.027% 8/3/50 144A	200,000.00	197,000.00	
QNB FINANCE 2.75% 02/27 RGS	200,000.00	209,536.00	
QORVO INC 4.375% 10/15/29	130,000.00	141,661.00	
RACKSPACE INC 5.375% 12/01/28 144A	100,000.00	101,750.00	
RADIANT F 6.375% 02/15/29 144A	55,000.00	58,402.30	
RADIATE HOLDC 4.5% 9/15/26 144A	470,000.00	483,977.80	
RADIATE HOLDC 6.5% 9/15/28 144A	350,000.00	364,437.50	
RADIOLOGY PAR 0% 01/31/28 144A	695,000.00	760,955.50	
RATTLER MIDST 5.625% 07/31/25 144A	160,000.00	165,552.00	
RAYONIER AM 7.625% 15/01/26 144A	135,000.00	139,542.75	
REAL HERO 6.25% 02/01/29 144A	55,000.00	56,900.80	
REALOGY G 7.625% 06/15/25 144A	80,000.00	86,200.00	
REALOGY GROUP 5.75% 01/15/29 144A	90,000.00	94,050.00	

ROLLS-ROYCE PLC 5.75% 10/15/27	175,000.00	190,312.50	
ROYAL CARI 11.5% 06/01/25 144A	160,000.00	183,392.00	
ROYAL CARI 9.125% 6/15/23 144A	260,000.00	279,858.80	
ROYAL CARIBBEAN 4.25% 07/01/26 144A	315,000.00	299,250.00	
RP ESCROW ISS 5.25% 12/15/25 144A	160,000.00	165,600.00	
RURAL/METRO C 10.125 7/19 REGS	10,000.00	-	
RUSSIAN AGR BK 8.5% 10/23 144A	200,000.00	225,500.00	
SABIC CAPITAL I 2.15% 09/14/30	200,000.00	194,000.00	
SABLE INTL 5.75% 9/7/27 144A	225,000.00	235,597.50	
SABRE GLBL 9.25% 04/15/25 144A	135,000.00	159,300.00	
SABRE GLBL INC 7.375% 09/01/25 144A	175,000.00	187,502.00	
SASOL FING USA 4.375% 09/18/26	200,000.00	204,750.00	
SAUDI ARABIAN OIL 4.25% 04/39	1,115,000.00	1,259,950.00	
SBA COMMUNICATI 3.875% 02/27	650,000.00	669,500.00	
SCIH SALT 4.875% 05/01/28 144A	190,000.00	189,477.50	
SCIH SALT 6.625% 05/01/29 144A	125,000.00	123,512.50	
SCOTTS MIRACLE 4% 4/31 144A	115,000.00	115,000.00	
SCRIPPS ESC I 3.875% 01/15/29 144A	160,000.00	159,739.20	
SCRIPPS ESC II 5.375% 01/15/31 144A	80,000.00	80,130.40	
SCRIPPS ESCRO 5.875% 7/27 144A	180,000.00	186,008.40	
SEASPAN CORPORA 5.5% 08/01/29 144A	260,000.00	260,000.00	
SEASPAN CORPORA 6.5% 4/26 144A	200,000.00	214,250.00	
SEAWORLD PARK 9.5% 08/25 144A	134,000.00	143,380.00	

SEG HLD LLC 5.625% 10/15/28 144A	175,000.00	183,531.25	
SENSATA TECHNOL 4% 04/15/29 14	190,000.00	192,137.50	
SERVICE CO INTL 5.125% 6/1/29	105,000.00	112,754.25	
SERVICE PPTYS T 7.5% 09/15/25	290,000.00	324,620.20	
SIBUR SECS D 2.95% 7/8/25 144A	200,000.00	204,250.00	
SIMMONS FOOD IN 4.625% 03/29 144A	115,000.00	115,862.50	
SIRIUS XM 4.625% 7/15/24 144A	290,000.00	297,743.00	
SIRIUS XM R 4.125% 7/1/30 144A	230,000.00	234,887.50	
SLM CORP 5.5% 12/31/23	180,000.00	188,330.40	
SM ENERGY CO 5.0% 01/15/2024	50,000.00	49,250.00	
SM ENERGY CO 6.5% 07/15/28	65,000.00	61,897.55	
SM ENERGY CO 6.625% 1/15/27	190,000.00	181,596.30	
SM ENERGY CO 6.75% 09/15/26	210,000.00	199,995.60	
SOTHEBYS 7.375% 10/15/27 144A	245,000.00	262,762.50	
SOUTHWESTERN EN 8.375% 9/15/28	175,000.00	193,812.50	
SPA HOLDINGS 4.875% 2/28 144A	135,000.00	135,540.00	
SPECTRUM BRAN 3.875% 03/15/31 144A	115,000.00	113,418.75	
SPIRIT LOYALT 8% 09/20/25 144A	125,663.00	141,848.39	
SPRINGLEAF CORP 4% 09/15/30	205,000.00	203,107.85	
SPRINGLEAF CORP 8.875% 06/1/25	235,000.00	257,785.60	
SPRINGLEAF FIN 6.875% 3/15/25	240,000.00	270,528.00	
SPRINGLEAF FIN CRP 7.125% 3/26	535,000.00	626,618.75	
SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32	1,435,000.00	2,206,312.50	
SPRINT CAP CRP 6.875% 11/15/28	130,000.00	167,050.00	

SQUARE INC 2.75% 06/01/26 144A	190,000.00	193,581.50	
SQUARE INC 3.5% 06/01/31 144A	190,000.00	195,099.60	
SRS DISTRIBUTIO 4.625% 07/01/28 144A	135,000.00	138,375.00	
SRS DISTRIBUTIO 6.125% 07/01/29 144A	75,000.00	76,978.50	
STATION CAS 4.5% 02/15/28 144A	5,000.00	5,057.00	
STATION CASINOS 5.0% 10/25	177,000.00	179,212.50	
STERICYCL 3.875% 01/15/29 144A	115,000.00	115,289.80	
STUDIO CITY 6.5% 1/15/28 144A	355,000.00	379,406.25	
SUNOCO LP /CORP 0% 02/15/26	265,000.00	268,150.85	
SUNOCO LP /CORP 4.5% 05/15/29	160,000.00	162,400.00	
SUNOCO LP /CORP 6% 04/15/27	520,000.00	539,973.20	
SUPERIOR PLUS 4.5% 03/15/29 144A	125,000.00	127,812.50	
SURGERY CTR 10% 04/15/27 144A	315,000.00	343,350.00	
SYNAPTICS INC 4% 06/15/29 144A	90,000.00	91,012.50	
T-MOBILE USA IN 3.5% 03/31/31	135,000.00	140,908.95	
TALLGRASS LP 6% 12/31/30 144A	175,000.00	181,900.25	
TARGA RES 4.875% 2/01/31 144A	170,000.00	183,175.00	
TARGA RES 6.5% 7/15/27	125,000.00	135,781.25	
TARGA RES 6.875% 1/15/29	220,000.00	241,604.00	
TARGA RES LP/FI 5.5% 03/01/30	190,000.00	208,331.20	
TARGA RES P 5.875% 4/26	210,000.00	219,187.50	
TAYLOR MOR 5.875% 6/15/27 144A	165,000.00	185,625.00	
TAYLOR MORRISON CMNTY/ MONARCH	240,000.00	268,200.00	
TEGNA INC 5% 09/15/29	445,000.00	466,137.50	

TELEFONICA PY 5.875% 4/27 144A	250,000.00	262,232.50	
TELESAT CDA 6.5% 10/15/27 144A	135,000.00	122,512.50	
TEMPUR SEALY 4% 04/15/29 144A	180,000.00	183,592.80	
TENCENT HLD 2.39% 6/3/30 144A	200,000.00	202,662.00	
TENET HEALTH 4.25% 06/01/29 144A	625,000.00	630,250.00	
TENET HEALTH 6.125% 10/01/28 144A	755,000.00	790,945.55	
TENET HEALTH 6.875% 11/15/31	25,000.00	28,250.00	
TENET HEALTHCARE 6.75% 6/15/23	840,000.00	907,359.60	
TENET HEALTHCRE 4.625% 7/15/24	410,000.00	415,125.00	
TENGIZCHEVR 3.25% 8/15/30 144A	200,000.00	204,000.00	
TERMOCANDELARIA POWER LTD 7.87	212,750.00	225,155.44	
TERRAFORM 4.75% 01/15/30 144A	235,000.00	243,507.00	
TERRAFORM POWE 4.25% 1/23 144A	145,000.00	148,330.65	
TERRAFORM POWER 5% 1/28 144A	175,000.00	186,873.75	
TERRIER M 8.875% 12/15/27 144A	245,000.00	262,674.30	
TINKOFF CRDT 9.25/VAR PERP RGS	200,000.00	209,600.00	
TKC HOLDIN 10.5% 05/15/29 144A	190,000.00	204,725.00	
TOPS MARKETS CORP ESCROW	1,325,000.00	-	
TOPS MKTS LLC PIK VAR 11/19/24	270,730.00	262,608.10	
TRANSDIGM INC 5.5% 11/15/27	895,000.00	917,375.00	
TRANSDIGM INC 7.5% 03/15/27	595,000.00	625,690.10	
TRANSDIGM UK 6.875% 05/15/26	270,000.00	284,512.50	
TRANSOCEAN 11.5% 01/30/27 144A	235,000.00	229,418.75	
TRANSOCEAN 5.375% 5/15/23 144A	225,148.16	212,765.01	
TREEHOUSE FOODS 4% 09/01/28	60,000.00	59,661.60	

TRI POINTE GROUP 5.7% 06/15/28	55,000.00	60,500.00	
TRIPADVISOR I 7% 07/15/25 144A	120,000.00	128,400.00	
TRITON WAT 6.25% 04/01/29 144A	80,000.00	80,900.00	
TRIVIUM PACKING 5.5% 8/26 144A	125,000.00	130,153.75	
TRONOX INC 4.625% 03/15/29 144A	170,000.00	172,550.00	
TTM TECH INC 4% 03/01/29 144A	170,000.00	170,850.00	
TULLOW OI 10.25% 05/15/26 144A	810,000.00	847,462.50	
TULLOW OIL 7% 03/01/25 144A	395,000.00	344,637.50	
TV AZTECA SAB 8.25% 8/9/24 RGS	400,000.00	196,948.00	
TWILIO INC 3.625% 03/15/29	130,000.00	132,402.40	
TWILIO INC 3.875% 03/15/31	140,000.00	144,533.20	
TWIN RIVER WORLDWID 6.75% 6/27	245,000.00	259,087.50	
UBER TECH 7.5% 05/15/25 144A	350,000.00	374,524.50	
UBER TECH INC 6.25% 01/15/28 144A	150,000.00	161,062.50	
ULTRA RESCS PIK 11% 07/12/24	167,419.00	8,370.95	
UNISYS 6.875% 11/01/27 144A	95,000.00	103,668.75	
UNITED AIRLIN 4.625% 04/30/29 144A	215,000.00	219,284.95	
UNITED NATURA 6.75% 10/15/28 144A	125,000.00	133,000.00	
UNITI/FIN 4.75% 04/15/28 144A	145,000.00	143,767.50	
UNITI/FIN/CSL 6.5% 02/15/29 144A	260,000.00	260,364.00	
UNIVISION 6.625% 06/01/27 144A	340,000.00	364,099.20	
US AWYS 12-2 A 4.625% 12/03/26	19,868.12	20,087.46	
US FOODS INC 4.75% 02/15/29 144A	245,000.00	249,593.75	
USA COMPRESSIO 6.875% 04/01/26	100,000.00	104,375.00	

USIMINAS INTL 5.875% 7/26 144A	200,000.00	215,974.00	
USIS MERGER 6.875% 05/25 144A	405,000.00	412,674.75	
VAIL RESORT 6.25% 05/15/2025 144A	100,000.00	106,090.00	
VALARIS PLC 7.75% 02/01/2026	305,000.00	30,500.00	
VALEANT PHARM 5.5% 11/25 144A	145,000.00	147,772.40	
VALEANT PHARMA 9.25% 4/26 144A	700,000.00	756,665.00	
VALVOLINE INC 4.25% 2/30 144A	125,000.00	129,062.50	
VEON HOLD 3.375% 11/25/27 144A	200,000.00	200,900.00	
VIACOM INC 6.25/VAR 02/28/57	185,000.00	210,589.20	
VICI PROPE 4.125% 8/15/30 144A	190,000.00	198,369.50	
VICI PROPER 3.5% 02/15/25 144A	230,000.00	233,100.40	
VICI PROPERT 3.75% 02/27 144A	145,000.00	148,063.85	
VICTORIA'S 4.625% 07/29 144A	120,000.00	119,542.80	
VIKING CRUIS 13% 05/15/25 144A	150,000.00	173,325.00	
VIPER ENER 5.375% 11/1/27 144A	85,000.00	88,612.50	
VISTRA OPERATIO 4.375% 05/01/29 144A	270,000.00	273,091.50	
VIZIENT 6.25% 05/15/27 144A	50,000.00	52,625.00	
VOLCAN CO 4.375% 02/11/26 144A	55,000.00	54,666.15	
VTR COMMUN 5.125% 1/15/28 144A	71,000.00	73,875.50	
VTR COMMUNICACI 4.375% 04/15/2	120,000.00	119,700.00	
WALTER ENERGY 9.5% 10/19 144A	735,000.00	-	
WASH MULT 5.75% 4/15/26 144A	115,000.00	120,031.25	
WEEKLEY HOMES L 4.875% 09/15/28	80,000.00	82,104.80	
WESTERN GLO 10.375% 8/25 144A	185,000.00	209,512.50	

	WINDSTREA 7.75% 08/15/28 144A	245,000.00	249,885.30	
	WINNEBAGO IND 6.25% 7/28 144A	145,000.00	156,237.50	
	WOLVERINE 8.5% 11/24 144A	124,000.00	119,040.00	
	WP ROCKET MRGR 10.125 7/19 REG	15,000.00	-	
	WR GRACE & CO 4.875% 6/27 144A	215,000.00	227,900.00	
	WYNN MACAU 5.5% 01/15/26 144A	200,000.00	208,072.00	
	WYNN RESORTS LTD 7.75% 04/15/2	365,000.00	386,556.90	
	XPO LOGISTICS INC 6.25% 05/01/	365,000.00	385,987.50	
	YUM BRANDS 7.75% 4/1/25 144A	65,000.00	70,443.75	
	YUM BRANDS INC 4.625% 01/31/32	195,000.00	204,176.70	
	ZIGGO BOND CO 5.125% 02/28/30 144A	90,000.00	92,025.00	
	ZIGGO BV 4.875% 01/15/2030 144	135,000.00	137,700.00	
	ZIGGO SEC 5.5% 1/15/27 144A	732,000.00	753,769.68	
	アメリカ・ドル 小計	173,421,290.08	174,351,411.19 (19,103,684,124)	
社債券 合計			19,103,684,124 (19,103,684,124)	
合計			42,767,770,834 (41,709,608,400)	

（注）新株予約権証券における券面総額の数値は証券数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株 予約権証券 時価比率	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 16銘柄	2.63%	-%	-%	87.81%
	新株予約権証券 4銘柄	-%	0.19%	-%	
	国債証券 148銘柄	-%	-%	41.79%	
	地方債証券 2銘柄	-%	-%	0.11%	
	特殊債券 59銘柄	-%	-%	4.33%	
	社債券 632銘柄	-%	-%	50.96%	
イギリス・ポンド	国債証券 2銘柄	-%	-%	100%	2.44%
カナダ・ドル	国債証券 2銘柄	-%	-%	100%	2.38%

ユーロ	国債証券	8銘柄	-%	-%	100%	7.36%
-----	------	-----	----	----	------	-------

## 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## その他特定資産の明細表

特定資産の種類/通貨	銘柄	数量	帳簿単価 帳簿金額	評価単価 評価金額	評価損益	備考
貸付債権/ アメリカ・ ドル	AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C1	23,047.02	98.78 22,767.69	99.04 22,826.22	58.53	-
	AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C2	11,602.98	98.78 11,462.35	99.04 11,491.82	29.47	-
	ALLIANT TERM B-2 1LN 05/10/25 C1	186,200.00	96.45 179,597.34	98.88 184,129.45	4,532.11	-
	BOYD GAMING TERM B-1 09/15/23 C1	48,771.32	95.18 46,422.00	99.76 48,654.26	2,232.26	-
	CITGO HOLDING TM B 1LN 8/1/23 C1	24,562.50	94.49 23,210.58	99.25 24,378.28	1,167.70	-
	CITGO TERM LOAN B 1LN 03/28/24 C1	441,096.85	96.49 425,640.81	100.17 441,886.41	16,245.60	-
	CONSOLIDATE TM INCR B 1LN 5/25 C1	420,000.00	97.50 409,500.00	96.50 405,300.00	4,200.00	-
	CSC SERVICEWORKS TM B 1LN 2/28 C1	114,712.50	99.24 113,852.15	100.00 114,712.50	860.35	-
	ENDURE DIGI TERM B 1LN DD 1/28 C1	48,437.50	99.49 48,195.31	98.95 47,928.90	266.41	-
	ENDURE DIGITAL TM B 1LN 01/28 C1	201,562.50	99.50 200,554.69	98.95 199,446.09	1,108.60	-
	FRST EAGLE TERM B 1LN 2/1/27 C1	81,535.80	96.38 78,590.72	98.33 80,181.49	1,590.77	-
	GREAT AMER TERM B 1LN 02/26/28 C1	472,625.00	99.49 470,257.14	100.12 473,215.78	2,958.64	-
	INFO RES TERM B 1LN 11/30/25 C1	298,781.49	94.99 283,833.45	99.79 298,160.02	14,326.57	-
	MISYS LIMITED TERM 2LN 06/25 C1	115,000.00	95.25 109,537.50	100.69 115,796.95	6,259.45	-
	NEW COTAI 1LN EXIT TERM 09/25 C1	49,465.65	100.00 49,465.65	100.00 49,465.65	-	-
	PROJECT EPIC TRM B 1LN 3/1/26 C1	803,925.00	76.78 617,334.00	76.33 613,660.07	3,673.93	-
	RED ROCK RE TERM B 1LN 2/7/27 C1	596,362.76	91.91 548,146.83	98.62 588,162.77	40,015.94	-
	SANCHEZ DIP ROLL UP TL 5/11/20 C1	89,000.00	4.76 4,243.33	0.00 0.00	4,243.33	-

SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C1	108,722.08	4.76 5,183.63	0.00 0.00	5,183.63	-
SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C2	98,160.45	4.76 4,680.07	0.00 0.00	4,680.07	-
TRANSDIGM TERM G 1LN 08/22/24 C1	278,592.90	92.79 258,534.21	98.55 274,575.59	16,041.38	-
TRAVELPORT TERM 1LN 02/28/2025	11,964.00	99.00 11,844.36	102.27 12,236.18	391.82	-
TRAVELPORT TERM 1LN 02/28/2025 C1	115,009.40	99.17 114,059.40	102.27 117,625.86	3,566.46	-
TRAVELPORT TERM 1LN 05/29/26 C1	110,997.54	38.36 42,579.76	86.62 96,151.61	53,571.85	-
ULTIMATE SOFTWARE TERM 1LN 5/26 C1	68,775.00	98.40 67,674.60	99.99 68,768.12	1,093.52	-
ULTIMATE SOFTWARE TL 1LN 05/26 C1	238,203.00	99.77 237,676.57	99.93 238,041.02	364.45	-
ULTIMATE SOFTWARE TL 2LN 05/27 C1	35,000.00	101.50 35,525.00	101.37 35,481.25	43.75	-
US RENAL CARE TM B 1LN 6/13/26 C1	967,762.50	97.34 942,116.79	100.19 969,659.31	27,542.52	-
VEEAM SOFTWARE TERM B 1LN 2/27 C1	34,562.50	97.62 33,740.25	99.25 34,303.28	563.03	-
貸付債権 / アメリカ・ドル 小計		5,396,226.18 (591,264,503)	5,566,238.88 (609,892,794)	170,012.70 (18,628,291)	
貸付債権 / ユーロ	HERTZ INTERNATI TM DD 8/30/21	425,802.35	100.00 425,802.35	100.00 425,802.35	- -
貸付債権 / ユーロ 小計		425,802.35 (55,039,212)	425,802.35 (55,039,212)	- ( - )	
貸付債権 合 計		646,303,715 (646,303,715)	664,932,006 (664,932,006)	18,628,291 (18,628,291)	
合 計		646,303,715 (646,303,715)	664,932,006 (664,932,006)	18,628,291 (18,628,291)	

1. 小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## Aコース（為替ヘッジ付き）

（2021年8月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	34,641,125,049	円
負債総額	89,835,810	円
純資産総額（ - ）	34,551,289,239	円
発行済数量	57,900,889,120	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.5967	円

## Bコース（為替ヘッジなし）

（2021年8月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	4,217,591,715	円
負債総額	2,111,935	円
純資産総額（ - ）	4,215,479,780	円
発行済数量	6,900,755,648	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6109	円

## （参考）マザーファンドの純資産額計算書

## フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

（2021年8月31日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	45,331,220,457	円
負債総額	232,369,009	円
純資産総額（ - ）	45,098,851,448	円
発行済数量	13,264,154,264	口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.4001	円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

< 訂正前 >

(1) 資本金等（2021年2月末日現在）

（略）

< 訂正後 >

(1) 資本金等（2021年8月末日現在）

（略）

## 2【事業の内容及び営業の概況】

< 訂正前 >

（略）

2021年2月26日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、追加型株式投資信託161本、親投資信託44本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,358,461,648,658円です。

< 訂正後 >

（略）

2021年8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168本、親投資信託44本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額3,959,141,851,223円です。

### 3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

当社の財務諸表は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

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

## （１）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第34期 (2020年3月31日)	第35期 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	1,814,655	3,247,762
立替金	77,706	55,896
前払費用	23,391	33,253
未収委託者報酬	5,452,894	6,757,847
未収運用受託報酬	539,020	9,468,144
未収収益	94,632	7,227
未収入金	* 1 558,652	197,099
未収還付法人税等	42,699	-
流動資産計	8,603,652	19,767,230
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 2,420,123	4,012,754
長期差入保証金	14,570	13,505
繰延税金資産	227,879	378,891
その他	230	230
投資その他の資産合計	2,662,803	4,405,381
固定資産計	2,670,290	4,412,868
資産合計	11,273,943	24,180,098
負債の部		
流動負債		
預り金	37	7
未払金	* 1	
未払手数料	2,403,887	2,988,518
その他未払金	1,209,713	6,727,569
未払費用	518,188	349,227
未払法人税等	-	483,198
未払消費税等	344,568	1,276,957
賞与引当金	750,040	1,074,712
その他流動負債	355	355
流動負債合計	5,226,791	12,900,547
固定負債		
長期賞与引当金	316,834	210,912
退職給付引当金	1,906,773	1,942,812
関係会社引当金	370,080	-
固定負債合計	2,593,688	2,153,725
負債合計	7,820,479	15,054,272
純資産の部		
株主資本		
資本金	1,000,000	1,000,000
利益剰余金		
利益準備金	250,000	250,000
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	2,203,463	7,875,826
利益剰余金合計	2,453,463	8,125,826
株主資本合計	3,453,463	9,125,826
純資産合計	3,453,463	9,125,826
負債・純資産合計	11,273,943	24,180,098

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第35期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	36,061,978	35,304,609
運用受託報酬	2,617,783	10,862,519
その他営業収益	207,255	113,747
営業収益計	38,887,017	46,280,877
営業費用	* 1	
支払手数料	16,651,629	16,235,726
広告宣伝費	700,958	265,312
調査費		
調査費	393,179	515,713
委託調査費	6,973,949	9,748,114
営業雑経費		
通信費	31,784	30,346
印刷費	61,362	48,792
協会費	24,701	22,019
諸会費	282	-
その他	-	288
営業費用計	24,837,847	26,866,314
一般管理費		
給料		
給料・手当	2,507,196	2,533,226
賞与	2,193,019	2,260,530
福利厚生費	612,591	578,598
交際費	24,462	6,471
旅費交通費	154,257	15,854
租税公課	110,239	209,635
弁護士報酬	9,913	14,658
不動産賃貸料・共益費	610,202	559,825
退職給付費用	212,987	224,469
消耗器具備品費	8,261	3,121
事務委託費	4,925,533	4,604,958
諸経費	330,336	268,414
一般管理費計	11,698,999	11,279,765
営業利益	2,350,170	8,134,797
営業外収益		
受取利息	* 1	
保険配当金	7,305	8,005
為替差益	-	9,074
雑益	3,555	2,461
営業外収益計	114,986	39,452
営業外費用		
為替差損	11,668	-
営業外費用計	11,668	-
経常利益	2,453,488	8,174,250
特別利益		
賞与引当金戻入益	797,838	-
特別利益計	797,838	-
特別損失		
特別退職金	29,218	37,362
事務過誤損失	16	24,478
特別損失計	29,235	61,841
税引前当期純利益	3,222,091	8,112,409
法人税、住民税及び事業税	240,866	2,591,057
法人税等調整額	861,516	(151,011)
法人税等合計	1,102,382	2,440,046
当期純利益	2,119,707	5,672,362

## (3)【株主資本等変動計算書】

第34期(自2019年4月1日至2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本				株主資本合計
	資本金	利益剰余金			
		利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	100,000	20,233,755	20,333,755	21,333,755
当期変動額					
準備金の積立	-	150,000	(150,000)	-	-
剰余金の配当	-	-	(20,000,000)	(20,000,000)	(20,000,000)
当期純利益	-	-	2,119,707	2,119,707	2,119,707
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	150,000	(18,030,293)	(17,880,293)	(17,880,293)
当期末残高	1,000,000	250,000	2,203,463	2,453,463	3,453,463

	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	-	-	21,333,755
当期変動額			
準備金の積立	-	-	-
剰余金の配当	-	-	(20,000,000)
当期純利益	-	-	2,119,707
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-
当期変動額合計	-	-	(17,880,293)
当期末残高	-	-	3,453,463

第35期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

(単位:千円)

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

	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	-	-	3,453,463
当期変動額			
当期純利益	-	-	5,672,362
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-
当期変動額合計	-	-	5,672,362
当期末残高	-	-	9,125,826

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

総平均法による原価法を採用しております。

### 2. 引当金の計上基準

#### (1)退職給付引当金

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

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

#### (2)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)関係会社引当金

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

### 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### (1)消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

#### (2)グループ通算制度への移行に係る税効果会計

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

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

#### (未適用の会計基準等)

##### 1. 「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日)

「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 2020年3月31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。

##### 2. 「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 令和元年7月4日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 令和元年7月4日)

「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 令和元年7月4日)

###### (1)概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

###### (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. 貸借対照表

「未収運用受託報酬」の表示方法は、従来、貸借対照表上、「未収収益」（前事業年度633,653千円）に含めて表示していましたが、重要性が増したため、当事業年度より、独立掲記することとしました。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「未収収益」に表示していた539,020千円は、「未収運用受託報酬」539,020千円として組み替えております。

## 2. 損益計算書

「運用受託報酬」の表示方法は、従来、損益計算書上、「営業収益」の「その他営業収益」（前事業年度2,825,039千円）に含めて表示していましたが、重要性が増したため、当事業年度より、独立掲記することとしました。この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業収益」の「その他営業収益」に表示していた2,617,783千円は、「運用受託報酬」2,617,783千円として組み替えております。

## 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34期 (2020年3月31日)	第35期 (2021年3月31日)
未収入金	481,355 千円	1,646 千円
その他未払金	909,606 千円	6,519,813 千円
長期貸付金	1,880,000 千円	3,680,000 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34期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第35期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業費用	9,335,190 千円	12,554,987 千円
受取利息	43,406 千円	4,830 千円

## (株主資本等変動計算書関係)

第34期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

金銭による配当

該当事項はありません。

金銭以外による配当

2019年11月29日の取締役会において、次のとおり決議しております。

- |               |               |
|---------------|---------------|
| (1) 配当財産の種類   | 長期貸付金         |
| (2) 配当財産の帳簿価格 | 20,000,000 千円 |
| (3) 1株当たりの配当額 | 1,000 千円      |
| (4) 効力発生日     | 2019年11月29日   |

第35期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

金銭による配当

該当事項はありません。

金銭以外による配当

該当事項はありません。

## (リース取引関係)

該当事項はありません。

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

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

## (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2. 金融商品の時価に関する事項

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34期（2020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	1,814,655	1,814,655	-
(2) 未収委託者報酬	5,452,894	5,452,894	-
(3) 未収運用受託報酬	539,020	539,020	-
(4) 未収収益	94,632	94,632	-
(5) 未収入金	558,652	558,652	-
(6) 長期貸付金	2,420,123	2,420,123	-
資産計	10,879,976	10,879,976	-
(1) 未払手数料	2,403,887	2,403,887	-
(2) その他未払金	1,209,713	1,209,713	-
(3) 未払費用	518,188	518,188	-
(4) 未払消費税等	344,568	344,568	-
負債計	4,476,356	4,476,356	-

## 第35期（2021年3月31日）

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

## (注) 1. 金融商品の時価の算定方法に関する事項

第34期 (2020年3月31日)

## 資産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬、(4) 未収収益、(5) 未収入金  
これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (6) 長期貸付金

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

## 負債

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

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

第35期 (2021年3月31日)

## 資産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬、(4) 未収収益、(5) 未収入金  
これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (6) 長期貸付金

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

## 負債

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

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

## (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34期 (2020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	1,814,655	-	-	-
未収委託者報酬	5,452,894	-	-	-
未収運用受託報酬	539,020	-	-	-
未収収益	94,632	-	-	-
未収入金	558,652	-	-	-
合計	8,459,855	-	-	-

金銭債権のうち長期貸付金(2,420,123千円)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35期 (2021年3月31日)

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

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

## (有価証券関係)

第34期 (2020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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第35期 (2021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 2020年4月1日 至 2021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34期（自 2019年4月1日 至 2020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	4,704,708
勤務費用	168,372
利息費用	7,558
数理計算上の差異の発生額	31,353
退職給付の支払額	2,920,688
制度改定による変動額	-
為替変動による影響額	11,362
その他	16,455
退職給付債務の期末残高	1,900,779

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

	(千円)
非積立型制度の退職給付債務	1,900,779
未認識過去勤務費用	5,994
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,906,773

退職給付引当金	1,906,773
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,906,773

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	168,372
利息費用	7,558
数理計算上の差異の費用処理額	31,353
過去勤務債務の費用処理額	1,874
確定給付型年金制度に係る退職給付費用	142,702

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎  
割引率 0.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は87,966千円であります。

第35期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は確定給付型年金制度及び確定拠出型年金制度を採用しております。

## 2. 確定給付型年金制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	1,942,812
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,942,812

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎  
割引率 0.8%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は93,260千円であります。

(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34期 (2020年3月31日)	第35期 (2021年3月31日)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払費用	140,844	116,119
賞与引当金	217,927	326,665
退職給付引当金	583,853	594,889
資産除去債務	2,685	2,685
その他	242,912	209,769
繰延税金資産小計	1,188,221	1,250,127
評価性引当額	812,395	690,287
繰延税金資産合計	375,826	559,840
繰延税金負債		
未払金	147,947	180,949
繰延税金負債合計	147,947	180,949
繰延税金資産又は繰延税金負債( )の純額	227,879	378,891

## 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34期 (2020年3月31日)	第35期 (2021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	3.34%	0.94%
評価性引当額	0.28%	1.51%
過年度法人税等	0.49%	0.00%
その他	0.04%	0.02%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.21%	30.08%

(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34期(自2019年4月1日至2020年3月31日)及び第35期(自2020年4月1日至2021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34期(自2019年4月1日至2020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	関連するセグメント名
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	8,974,384	資産運用業
フィデリティ・USリート・ファンドB(為替ヘッジなし)	8,352,497	資産運用業
フィデリティ・日本成長株・ファンド	5,276,573	資産運用業

第35期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

## 1. サービスごとの情報

(単位:千円)

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

## 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

## (1) 委託者報酬

(単位:千円)

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

## (2) 運用受託報酬

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

## 関連当事者情報

第34期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称	会社等の所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
親会社	FIL Limited	英領バミューダ、ペンブローック市	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兼任	委託調査等報酬（注3）	千円 -	未収入金	千円 477,134
							共通発生経費負担額（注4）	6,299,993	未払金	495,523
親会社	フィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社	東京都港区	千円 4,510,000	グループ会社経営管理	被所有直接100%	当社事業活動の管理等役員兼任	貸付金の回収（注1）	千円 19,970,000	長期貸付金	千円 1,880,000
							利息の受取（注1）	43,406	未収入金	4,221
							共通発生経費負担額（注4）	406,439	未払金	81,434
							連結法人税の個別帰属額	-	未払金	66,142
							剰余金の配当	20,000,000	未払金	-
親会社	FIL Asia Holdings Pte Limited	シンガポール、ブルバード市	千米ドル 189,735	グループ会社経営管理	被所有間接100%	営業取引	共通発生経費負担額（注4）	千円 2,628,757	未払金	千円 266,506

## (2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

属性	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
同一の親会社をもつ会社	フィデリティ証券株式会社	東京都港区	千円 10,007,500	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）	千円 637,950	未払金	千円 4,469
							投資信託販売に係る代行手数料（注5）	801,519	未払金	174,463
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 784,703	未払金	千円 108,258

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 資金の貸付については、市場金利等を勘案して利率を合理的に決定しております。
- (注2) 取引金額には消費税等を含めておりません。期末残高には消費税等を含めております。
- (注3) 当社の主要な事業領域である投信・投資顧問業から包括的に発生する収益であります。
- (注4) 共通発生経費については、直課可能なものは実際発生額に基づき、直課不可能なものは各社の規模に応じた一定の比率により負担しております。
- (注5) 代行手数料については、一般取引条件を基に、両社協議の上合理的に決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

## 第35期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社

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

## (2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

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

## (1株当たり情報)

	第34期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第35期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	172,673円19銭	456,291円33銭
1株当たり当期純利益	105,985円40銭	283,618円14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34期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第35期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(千円)	2,119,707	5,672,362
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)	2,119,707	5,672,362
期中平均株式数	20,000株	20,000株

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

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

<更新・訂正後>

ファンドの運営における役割	名称	資本金の額 (2021年3月末日現在)	事業の内容
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。
<参考情報> 再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	
販売会社	auカブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
	大和証券株式会社	100,000百万円	
	野村証券株式会社	10,000百万円	
	岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	
	フィデリティ証券株式会社	10,857百万円	
	S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
	株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	
	楽天証券株式会社	7,495百万円	
	マネックス証券株式会社	12,200百万円	
	静銀ティーエム証券株式会社	3,000百万円	
	エース証券株式会社	8,831百万円	
	西日本シティ T T 証券株式会社	3,000百万円	
	松井証券株式会社	11,945百万円	
十六 T T 証券株式会社	3,000百万円		
O K B 証券株式会社	1,500百万円		

	三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。
	株式会社名古屋銀行	25,090百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
	株式会社京都銀行	42,103百万円	
	株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958百万円	
	株式会社第四北越銀行	32,776百万円	
	株式会社イオン銀行	51,250百万円	
	株式会社新生銀行	512,204百万円	
	株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
	株式会社三井住友銀行	1,770,900百万円	
	株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
	ソニー銀行株式会社	36,000百万円	
	スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
	株式会社北陸銀行	140,409百万円	
	株式会社福岡銀行	82,329百万円	
	株式会社三十三銀行	37,461百万円 (2021年5月1日現在)	
	株式会社熊本銀行	10,000百万円	
	株式会社十八親和銀行	36,878百万円	
	日本生命保険相互会社	1,400,000百万円* *相互会社であるため、「基金」の額です。	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
	明治安田生命保険相互会社	980,000百万円* *相互会社であるため、「基金」の額です。	
運用の委託先	FILインベストメンツ・インターナショナル	225,365英ポンド (約31百万円*) * 1英ポンド139.82円で換算 (2020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。
	FIAM LLC	57,381,911米ドル (約5,939百万円*) * 1米ドル103.50円で換算 (2020年12月末日現在)	主として米国においてファンドに対する投資顧問業務を営んでいます。

新規募集は行ないません。



# 独立監査人の監査報告書

2021年9月14日

フィデリティ投信株式会社

取締役会 御中

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているフィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）の2021年1月21日から2021年7月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）の2021年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以上

---

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

2021年9月14日

フィデリティ投信株式会社

取締役会 御中

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているフィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）の2021年1月21日から2021年7月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）の2021年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以上

---

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

2021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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているフィデリティ投信株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ投信株式会社の2021年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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記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。