

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年4月11日提出
【発行者名】	フィデリティ投信株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　　デレック・ヤング
【本店の所在の場所】	東京都港区六本木七丁目7番7号
【事務連絡者氏名】	照沼 加奈子
【電話番号】	03 - 4560 - 6000
【届出の対象とした募集 （売出）内国投資信託受益 証券に係るファンドの名称】	フィデリティ世界バリュー株式ファンド Aコース（年2回決算・為替ヘッジあり） フィデリティ世界バリュー株式ファンド Bコース（年2回決算・為替ヘッジなし） フィデリティ世界バリュー株式ファンド Cコース（毎月決算・予想分配金提示型・為替ヘッジあり） フィデリティ世界バリュー株式ファンド Dコース（毎月決算・予想分配金提示型・為替ヘッジなし）
【届出の対象とした募集 （売出）内国投資信託受益 証券の金額】	各ファンドにつき2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出致しましたので、2023年10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】

（3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（略）

委託会社の概況（2023年8月末日現在）

（略）

<訂正後>

（略）

委託会社の概況（2024年2月末日現在）

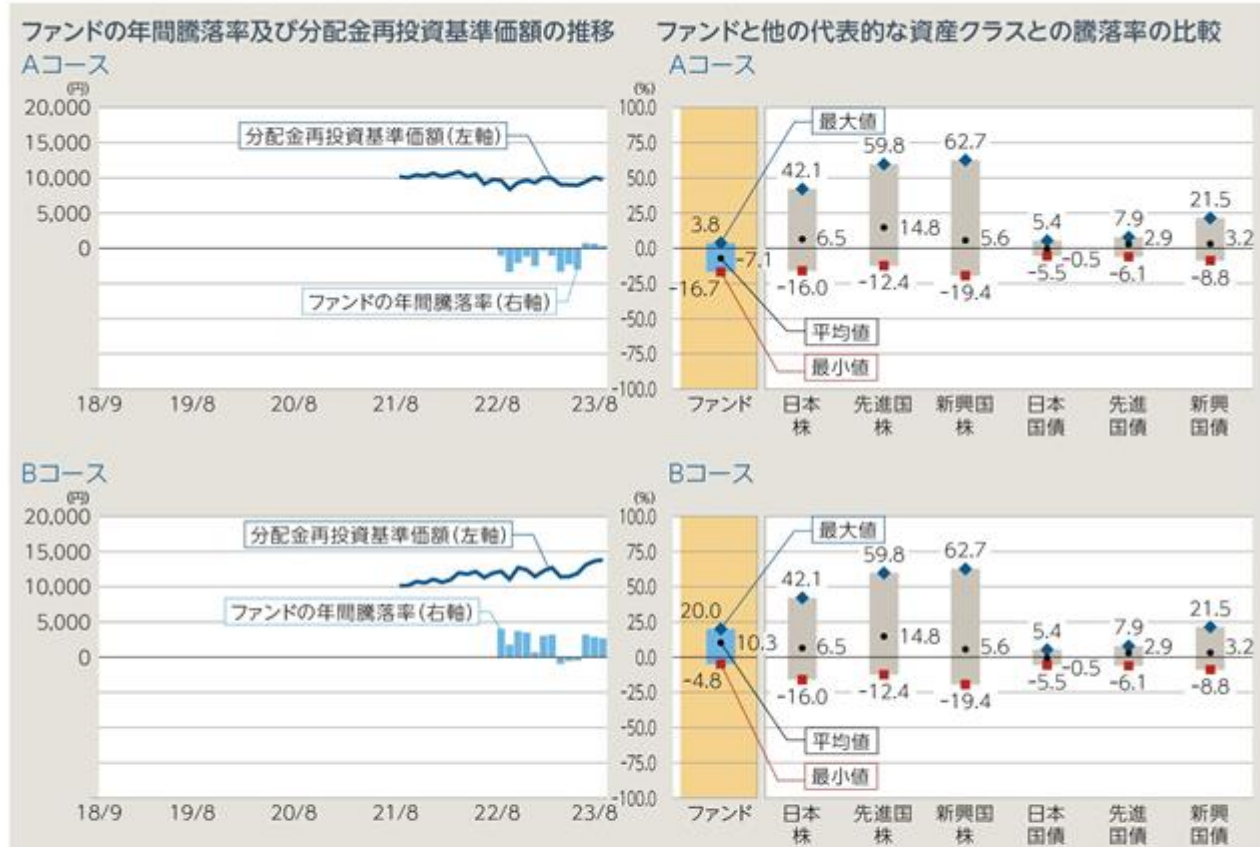
（略）

3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドが2021年8月10日に設定されたため、2022年8月～2023年8月の期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

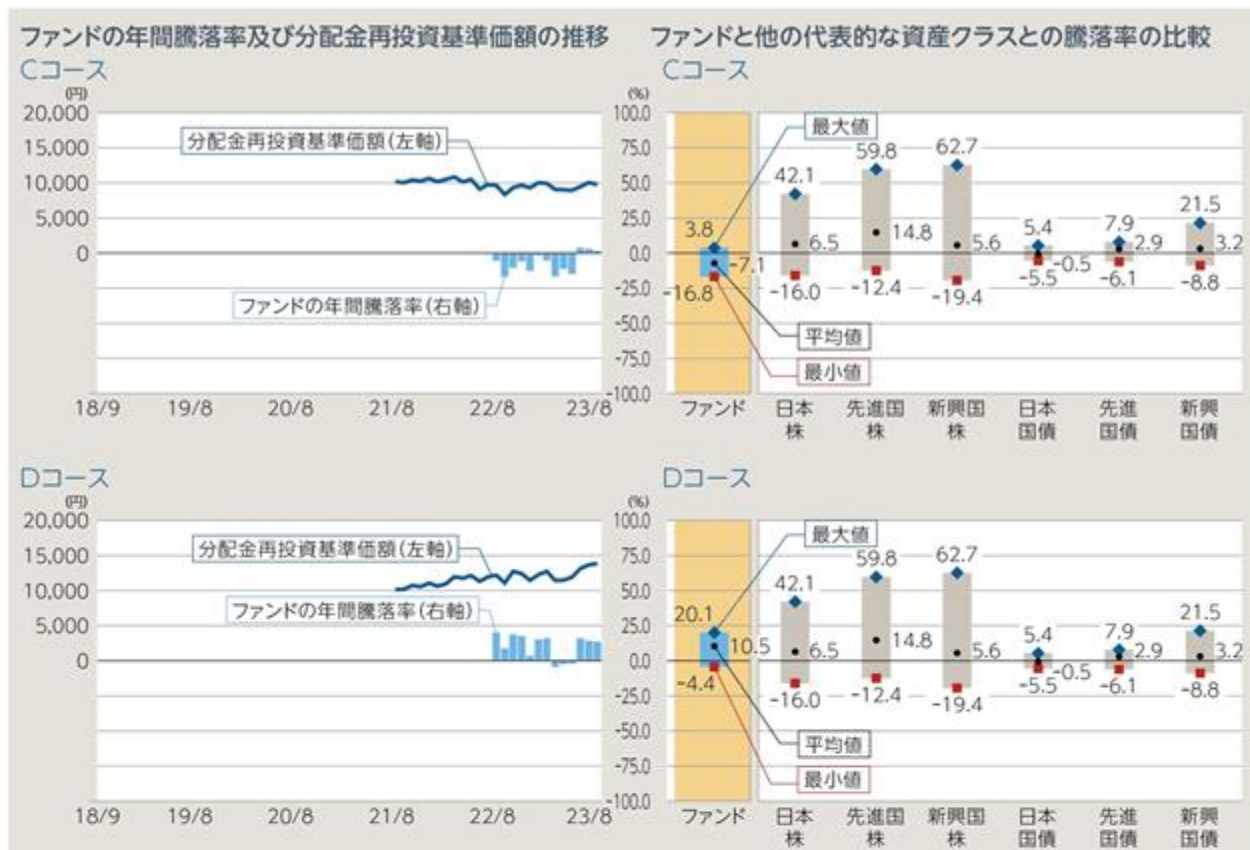
※「ファンドの年間騰落率」は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率であり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。なお、当騰落率は目盛最大値に比べ値が小さいためにグラフが見えない場合があります。

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

※ファンドは2021年8月10日に設定されたため2022年8月～2023年8月の期間、他の代表的な資産クラスについては2018年9月～2023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・平均値を表示しております。当グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドが2021年8月10日に設定されたため、2022年8月～2023年8月の期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

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

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

※ファンドは2021年8月10日に設定されたため2022年8月～2023年8月の期間、他の代表的な資産クラスについては2018年9月～2023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・平均値を表示しております。当グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

代表的な資産クラスの指数

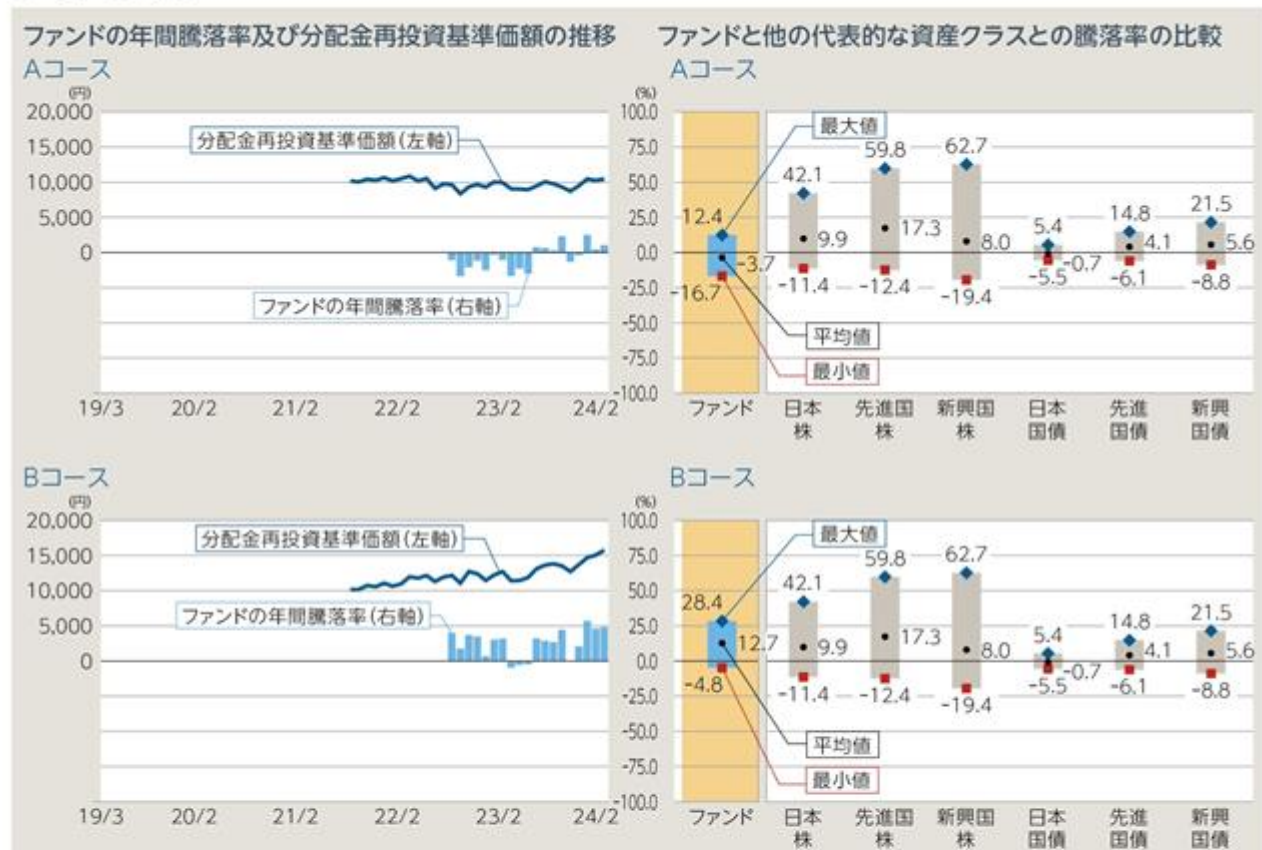
日本株 TOPIX (配当込)	東証株価指数 (TOPIX) (以下「TOPIX」という。)の指数値及びTOPIXに係る商標又は高標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社 (以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る商標又は高標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCI コクサイ・インデックス (税引前配当金込/円ベース)	MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く先進国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他の知的所有権は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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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、当ファンドの設定の可否、運用成果等並びに当ファンド及びNOMURA-BPI 国債に関連して行われる当社のサービス提供等の行為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 J.P.モルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円ベース)	この情報は信頼性があると信じるに足る情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。このインデックスは使用許諾を得て使用しています。J.P.モルガンによる書面による事前の承諾なくこのインデックスを複製、使用、頒布することは禁じられています。Copyright © 2022 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複製・転載を禁じます。

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

< 訂正後 >

(略)

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドが2021年8月10日に設定されたため、2022年8月～2024年2月の期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

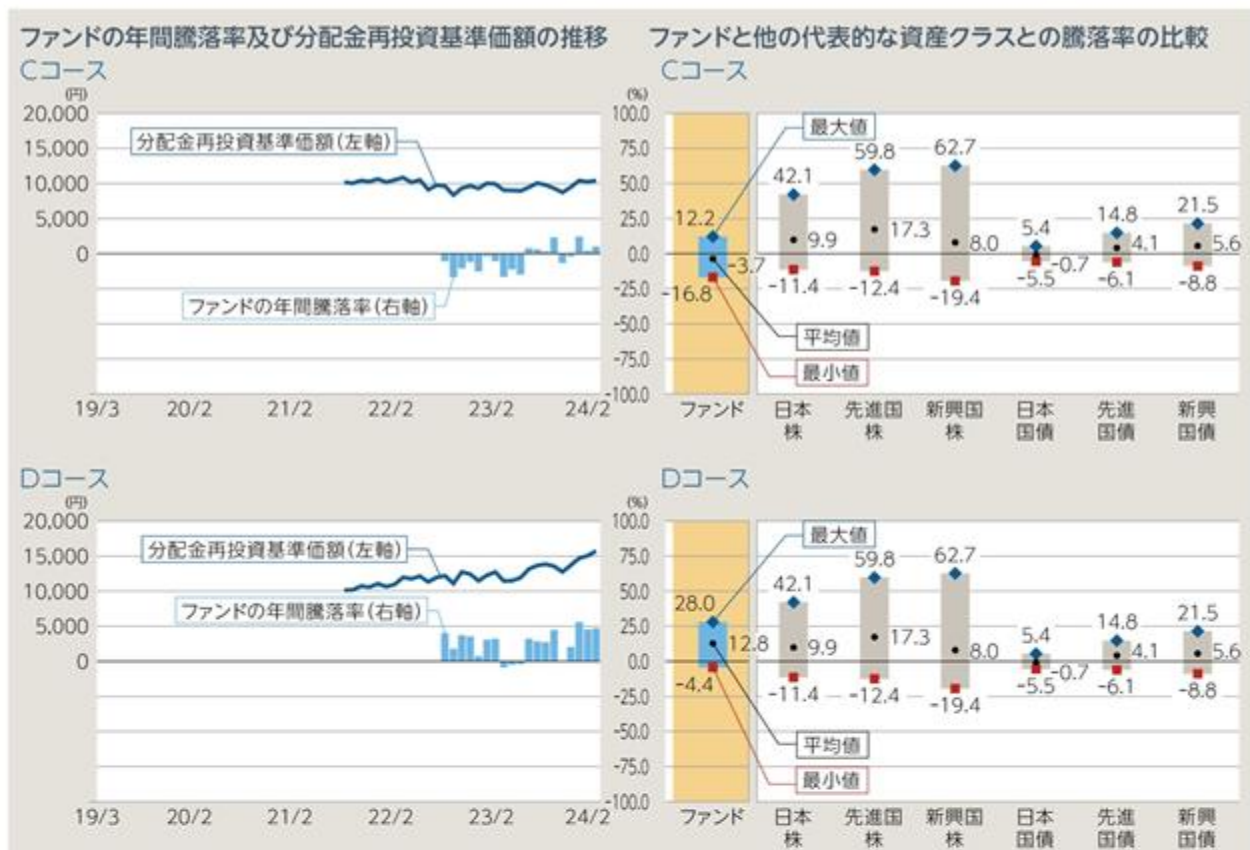
※「ファンドの年間騰落率」は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率であり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。なお、当騰落率は目盛最大値に比べ値が小さいためにグラフが見えない場合があります。

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

※ファンドは2021年8月10日に設定されたため2022年8月～2024年2月の期間、他の代表的な資産クラスについては2019年3月～2024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・平均値を表示しております。当グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドが2021年8月10日に設定されたため、2022年8月～2024年2月の期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

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

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

※ファンドは2021年8月10日に設定されたため2022年8月～2024年2月の期間、他の代表的な資産クラスについては2019年3月～2024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・平均値を表示しております。当グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

代表的な資産クラスの指数

日本株 TOPIX(配当込)	東証株価指数(TOPIX)(以下「TOPIX」という。)の指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCI コクサイ・インデックス (税引前配当金込/円ベース)	MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く先進国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他知的所有権はMSCI Inc.に帰属しております。
新興国株 MSCI エマージング・マーケット・インデックス (税引前配当金込/円ベース)	MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した、エマージング諸国の株式市場のパフォーマンス測定を目的とする浮動株調整済み時価総額加重指数です。著作権、およびその他知的所有権はMSCI Inc.に帰属しております。
日本国債 NOMURA-BPI 国債	NOMURA-BPI 国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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、当ファンドの設定の可否、運用成果等並びに当ファンド及びNOMURA-BPI 国債に関連して行われる当社のサービス提供等の行為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 J.P.モルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円ベース)	この情報は信頼性があると信じるに足る情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。このインデックスは使用許諾を得て使用しています。J.P.モルガンによる書面による事前の承諾なくこのインデックスを複製、使用、頒布することは禁じられています。Copyright © 2022 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複製・転載を禁じます。

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

4【手数料等及び税金】

（４）【その他の手数料等】

<訂正前>

（略）

上記（１）～（４）に係る手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので表示することができません。

<訂正後>

（略）

上記（１）～（４）に係る手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので表示することができません。

運用・管理にかかる費用の総額について、詳しくは、後掲の「（参考情報）ファンドの総経費率」をご参照ください。

（５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

個人、法人別の課税の取扱いについて

（略）

1．個人の受益者に対する課税

（略）

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、「ジュニアNISA」の適用対象であり、2024年1月1日以降は一定の要件を満たしたファンドのみがNISAの適用対象となります。これらの制度をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となりますが、2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。

なお、現行のNISA制度による購入は2023年12月末で終了します。AコースおよびBコースは、2024年1月1日以降のNISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象となる予定ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。

（略）

上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、2023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。

上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、法的助言または税務上の助言をなすものではありません。ファンドへの投資を検討される方は、ファンドの購入、保有、換金等がもたらす税務上の意味合いにつき専門家と相談されることをお勧めします。

<訂正後>

（略）

個人、法人別の課税の取扱いについて

(略)

1. 個人の受益者に対する課税

(略)

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

AコースおよびBコースは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。

CコースおよびDコースは、NISAの対象ではありません。

(略)

上記「（5）課税上の取扱い」の記載は、2024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。

上記「（5）課税上の取扱い」の記載は、法的助言または税務上の助言をなすものではありません。ファンドへの投資を検討される方は、ファンドの購入、保有、換金等がもたらす税務上の意味合いにつき専門家と相談されることをお勧めします。

(参考情報) ファンドの総経費率

	総経費率 (①+②)	運用管理費用の 比率①	その他費用の 比率②
フィデリティ世界バリュー株式ファンド Aコース(年2回決算・為替ヘッジあり)	1.74%	1.65%	0.09%
フィデリティ世界バリュー株式ファンド Bコース(年2回決算・為替ヘッジなし)	1.73%	1.65%	0.08%
フィデリティ世界バリュー株式ファンド Cコース(毎月決算・予想分配金提示 型・為替ヘッジあり)	1.77%	1.64%	0.13%
フィデリティ世界バリュー株式ファンド Dコース(毎月決算・予想分配金提示 型・為替ヘッジなし)	1.74%	1.64%	0.09%

(比率は年率、表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間は2023年7月19日～2024年1月15日です。

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除きます。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除しています。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

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

(2024年2月29日現在)

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	3,317,513,278	100.66
預金・その他の資産（負債控除後）	-	21,590,572	0.66
合計（純資産総額）		3,295,922,706	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

(2024年2月29日現在)

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引（売建）	日本	3,298,191,898	100.07

(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

(2024年2月29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	42,965,063,739	100.20
預金・その他の資産（負債控除後）	-	85,926,671	0.20
合計（純資産総額）		42,879,137,068	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。

Cコース

(2024年2月29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	468,852,148	100.48
預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,253,796	0.48
合計（純資産総額）		466,598,352	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

（2024年2月29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	468,171,541	100.34

（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。

Dコース

（2024年2月29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	13,251,100,944	100.06
預金・その他の資産（負債控除後）	-	8,547,256	0.06
合計（純資産総額）		13,242,553,688	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

フィデリティ世界バリューストックマザーファンド

（2024年2月29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	43,841,487,987	72.73
	カナダ	4,066,715,492	6.75
	バミューダ	1,147,068,510	1.90
	イギリス	1,018,998,592	1.69
	オランダ	1,008,910,698	1.67
	アイルランド	907,018,684	1.50
	シンガポール	816,152,825	1.35
	スイス	772,951,799	1.28
	フランス	695,157,756	1.15
	ジャージー	625,558,557	1.04
	ルクセンブルグ	492,952,100	0.82
	メキシコ	483,751,684	0.80
	プエルトリコ	417,998,932	0.69
	スペイン	316,070,104	0.52
	ケイマン諸島	276,837,675	0.46
	イスラエル	233,978,315	0.39
	ベルギー	180,026,403	0.30
	ドイツ	87,034,674	0.14
	日本	73,885,259	0.12
	小計		57,462,556,046
投資証券	アメリカ	2,614,769,709	4.34
	小計	2,614,769,709	4.34
預金・その他の資産（負債控除後）	-	200,729,155	0.33
合計（純資産総額）		60,278,054,910	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

（2024年2月29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	17,451,370	0.03
為替予約取引（売建）	日本	77,527,167	0.13

（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。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

Aコース

(2024年2月29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	フィデリティ世界 バリューストックマ ザーファンド	日本	2,020,533,089	1.5068	3,044,617,585	1.6419	3,317,513,278	100.66

Bコース

(2024年2月29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	フィデリティ世界 バリューストックマ ザーファンド	日本	26,167,893,136	1.5069	39,433,051,869	1.6419	42,965,063,739	100.20

Cコース

(2024年2月29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	フィデリティ世界 バリューストックマ ザーファンド	日本	285,554,631	1.6024	457,572,772	1.6419	468,852,148	100.48

Dコース

(2024年2月29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	フィデリティ世界 バリューストックマ ザーファンド	日本	8,070,589,527	1.6024	12,932,600,366	1.6419	13,251,100,944	100.06

種類別投資比率

Aコース

(2024年2月29日現在)

種 類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.66

Bコース

(2024年2月29日現在)

種 類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.20

Cコース

(2024年2月29日現在)

種 類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.48

Dコース

(2024年2月29日現在)

種 類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.06

（参考）マザーファンドの投資有価証券の主要銘柄

フィデリティ世界バリューストックマザーファンド

（2024年2月29日現在）

順位	銘柄名	通貨 地域	種類 業種	数量	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 時価金額(円)	投資 比率 (%)
1	CONSTELLATION ENERGY CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 公益事業	43,339	14,491.44 628,044,544	25,738.96 1,115,500,618	1.85
2	FLEX LTD	アメリカ・ドル シンガポール	株式 テクノロジー・ ハードウェアおよ び機器	194,221	3,144.72 610,770,870	4,202.19 816,152,825	1.35
3	GLOBAL PAYMENTS INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 金融サービス	35,753	16,995.00 607,622,348	19,596.14 700,620,800	1.16
4	EXPRO GROUP HOLDINGS NV	アメリカ・ドル オランダ	株式 エネルギー	232,511	2,889.27 671,788,065	2,731.65 635,137,998	1.05
5	PG&E CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 公益事業	253,331	2,686.44 680,560,076	2,499.62 633,230,043	1.05
6	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 金融サービス	37,558	12,195.22 458,028,440	16,843.40 632,604,390	1.05
7	ANTERO RES CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 エネルギー	160,086	3,439.79 550,663,198	3,836.06 614,099,213	1.02
8	WELLTOWER INC	アメリカ・ドル アメリカ	投資証券 -	38,144	11,945.11 455,634,565	13,840.55 527,933,794	0.88
9	FIRST AMERICAN FINANCIAL CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 保険	60,453	8,893.77 537,655,553	8,657.50 523,371,738	0.87
10	CENOVUS ENERGY INC	カナダ・ドル カナダ	株式 エネルギー	191,719	2,422.86 464,509,723	2,597.04 497,902,640	0.83
11	REGAL REXNORD CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 資本財	19,140	22,479.91 430,265,609	25,717.86 492,239,884	0.82
12	CONSTELLIUM SE CL A	アメリカ・ドル フランス	株式 素材	163,936	2,698.92 442,450,881	2,829.58 463,870,453	0.77
13	PVH CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 耐久消費財・アパ レル	22,440	13,224.50 296,757,982	20,632.75 462,998,905	0.77
14	AES CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 公益事業	202,263	2,708.71 547,872,197	2,269.09 458,952,991	0.76
15	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 保険	23,920	17,591.78 420,795,397	19,126.05 457,495,111	0.76
16	BUNGE GLOBAL SA	アメリカ・ドル スイス	株式 食品・飲料・タバ コ	32,348	14,997.20 485,129,434	14,123.81 456,876,870	0.76
17	HARTFORD FINL SVCS GROUP INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 保険	31,610	11,098.61 350,827,323	14,405.56 455,359,710	0.76
18	THRYV HOLDINGS INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 メディア・娯楽	146,181	3,674.52 537,145,857	3,085.72 451,073,869	0.75

19	FIRST CITIZENS BANCSHARES INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 銀行	1,910	208,309.64 397,871,415	235,992.91 450,746,466	0.75
20	CENTENE CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 ヘルスケア機器・ サービス	37,682	9,785.25 368,727,898	11,811.02 445,062,904	0.74
21	ALLISON TRANSMISSION HLDGS INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 資本財	38,900	8,808.46 342,649,219	11,389.15 443,037,752	0.73
22	US FOODS HOLDING CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 生活必需品流通・ 小売り	57,049	6,552.98 373,841,311	7,738.41 441,468,620	0.73
23	FIRSTENERGY CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 公益事業	79,381	5,346.79 424,433,841	5,550.68 440,618,751	0.73
24	PROLOGIS INC	アメリカ・ドル アメリカ	投資証券 -	21,258	19,005.04 404,009,213	20,188.27 429,162,313	0.71
25	LUMENTUM HOLDINGS INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 テクノロジー・ ハードウェアおよ び機器	59,843	7,677.53 459,446,548	7,107.10 425,310,418	0.71
26	XPO INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 運輸	23,942	9,373.18 224,412,692	17,739.89 424,728,345	0.70
27	POPULAR INC	アメリカ・ドル プエルトリコ	株式 銀行	33,534	9,675.72 324,465,708	12,464.93 417,998,932	0.69
28	VENTAS INC	アメリカ・ドル アメリカ	投資証券 -	65,170	7,081.60 461,507,926	6,400.46 417,118,082	0.69
29	LITHIA MOTORS INC CL	アメリカ・ドル アメリカ	株式 一般消費財・サー ビス流通・小売り	9,492	45,468.30 431,585,123	43,768.13 415,447,073	0.69
30	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 金融サービス	10,238	34,240.45 350,553,757	40,435.31 413,976,682	0.69

（参考）マザーファンドの種類別投資比率
フィデリティ世界バリュー株式マザーファンド

（2024年2月29日現在）

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)	
株式	国内	銀行業	0.12	
	小計		0.12	
	外国	エネルギー		8.62
		素材		9.57
		資本財		12.17
		商業・専門サービス		3.26
		運輸		3.39
		自動車・自動車部品		2.54
		耐久消費財・アパレル		5.09
		消費者サービス		2.17
		一般消費財・サービス流通・小売り		5.08
		生活必需品流通・小売り		0.73
		食品・飲料・タバコ		2.17
		家庭用品・パーソナル用品		0.48
		ヘルスケア機器・サービス		2.40
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		1.42
		銀行		4.33
		金融サービス		11.32
		保険		5.30
		ソフトウェア・サービス		0.44
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器		2.37
		電気通信サービス		0.39
		公益事業		8.19
		半導体・半導体製造装置		0.32
		メディア・娯楽		2.60
		不動産管理・開発		0.85
	小計			95.21
投資証券	外国	-	4.34	
	小計		4.34	
合計（対純資産総額比）			99.67	

【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

(2024年2月29日現在)

種類	名称等	買建/売建	数量	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	メキシコ・ペソ	売建	1,542,300	13,434,806	13,457,801	0.41
	香港・ドル	売建	721,400	13,790,720	13,833,205	0.42
	スイス・フラン	売建	105,800	17,988,677	18,113,943	0.55
	イギリス・ポンド	売建	178,700	33,710,298	33,945,601	1.03
	ユーロ	売建	417,100	67,440,853	67,870,220	2.06
	カナダ・ドル	売建	1,857,900	205,324,574	205,226,792	6.23
	アメリカ・ドル	売建	19,635,900	2,933,048,505	2,945,744,336	89.38

Bコース

該当事項はありません。

Cコース

(2024年2月29日現在)

種類	名称等	買建/売建	数量	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	香港・ドル	売建	106,800	2,042,502	2,047,943	0.44
	メキシコ・ペソ	売建	235,700	2,053,157	2,056,671	0.44
	スイス・フラン	売建	13,700	2,329,347	2,345,567	0.50
	イギリス・ポンド	売建	25,800	4,866,959	4,900,931	1.05
	ユーロ	売建	60,400	9,766,069	9,828,245	2.11
	カナダ・ドル	売建	262,500	29,010,012	28,996,196	6.21
	アメリカ・ドル	売建	2,786,300	416,194,620	417,995,988	89.58

Dコース

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
フィデリティ世界バリューストックマザーファンド

(2024年2月29日現在)

種類	名称等	買建/売建	数量	簿価金額 (円)	時価金額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカ・ドル	買建	115,850	17,490,900	17,451,370	0.03
	ユーロ	売建	12,640	2,062,986	2,062,625	0.00
	カナダ・ドル	売建	138,677	15,427,914	15,375,785	0.03
	アメリカ・ドル	売建	398,928	59,949,100	60,088,757	0.10

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

2024年2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

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり純資産額 (円) (分配落)	1口当たり純資産額 (円) (分配付)
1期	(2022年1月17日)	2,366	2,366	1.0815	1.0815
2期	(2022年7月15日)	4,590	4,590	0.8822	0.8822
3期	(2023年1月16日)	5,512	5,512	0.9929	0.9929
4期	(2023年7月18日)	4,968	4,968	0.9770	0.9770
5期	(2024年1月15日)	3,766	3,766	1.0038	1.0038
	2023年2月末日	5,446	-	0.9939	-
	2023年3月末日	4,943	-	0.9046	-
	2023年4月末日	4,894	-	0.9014	-
	2023年5月末日	4,802	-	0.8935	-
	2023年6月末日	4,915	-	0.9462	-
	2023年7月末日	4,941	-	1.0057	-
	2023年8月末日	4,462	-	0.9771	-
	2023年9月末日	4,162	-	0.9314	-
	2023年10月末日	3,744	-	0.8718	-
	2023年11月末日	3,915	-	0.9483	-
	2023年12月末日	4,072	-	1.0456	-
	2024年1月末日	3,567	-	1.0245	-
	2024年2月末日	3,295	-	1.0463	-

Bコース

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり純資産額 (円) (分配落)	1口当たり純資産額 (円) (分配付)
1期	(2022年1月17日)	27,916	27,916	1.1194	1.1194
2期	(2022年7月15日)	56,952	56,952	1.1121	1.1121
3期	(2023年1月16日)	56,304	56,304	1.1860	1.1860
4期	(2023年7月18日)	50,460	50,460	1.3039	1.3039
5期	(2024年1月15日)	41,571	41,571	1.4493	1.4493
	2023年2月末日	56,762	-	1.2718	-
	2023年3月末日	50,010	-	1.1409	-
	2023年4月末日	49,471	-	1.1454	-
	2023年5月末日	49,722	-	1.1877	-
	2023年6月末日	52,170	-	1.3123	-
	2023年7月末日	50,563	-	1.3640	-
	2023年8月末日	47,435	-	1.3824	-
	2023年9月末日	45,009	-	1.3538	-
	2023年10月末日	40,789	-	1.2727	-
	2023年11月末日	42,395	-	1.3705	-
	2023年12月末日	43,060	-	1.4714	-
	2024年1月末日	42,232	-	1.5068	-
	2024年2月末日	42,879	-	1.5761	-

Cコース

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)
2022年1月17日 (第1特定期間)	757	764	1.0611	1.0711
2022年7月15日 (第2特定期間)	758	758	0.8661	0.8661
2023年1月16日 (第3特定期間)	904	904	0.9739	0.9739
2023年7月18日 (第4特定期間)	910	910	0.9590	0.9590
2024年1月15日 (第5特定期間)	470	470	0.9825	0.9825
2023年2月末日	918	-	0.9752	-
2023年3月末日	854	-	0.8883	-
2023年4月末日	849	-	0.8852	-
2023年5月末日	841	-	0.8774	-
2023年6月末日	886	-	0.9289	-
2023年7月末日	924	-	0.9871	-
2023年8月末日	850	-	0.9589	-
2023年9月末日	776	-	0.9141	-
2023年10月末日	667	-	0.8560	-
2023年11月末日	488	-	0.9295	-
2023年12月末日	498	-	1.0231	-
2024年1月末日	474	-	1.0034	-
2024年2月末日	466	-	1.0244	-

Dコース

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)
2022年1月17日 (第1特定期間)	4,668	4,711	1.0890	1.0990
2022年7月15日 (第2特定期間)	12,382	12,382	1.0366	1.0366
2023年1月16日 (第3特定期間)	14,481	14,481	1.0272	1.0272
2023年7月18日 (第4特定期間)	14,646	14,915	1.0896	1.1096
2024年1月15日 (第5特定期間)	12,689	12,919	1.1039	1.1239
2023年2月末日	15,941	-	1.0915	-
2023年3月末日	14,062	-	0.9813	-
2023年4月末日	14,011	-	0.9849	-
2023年5月末日	14,465	-	1.0210	-
2023年6月末日	15,372	-	1.1170	-
2023年7月末日	15,051	-	1.1398	-
2023年8月末日	14,008	-	1.1347	-
2023年9月末日	13,561	-	1.0912	-
2023年10月末日	12,377	-	1.0163	-
2023年11月末日	12,877	-	1.0834	-
2023年12月末日	13,171	-	1.1411	-
2024年1月末日	13,008	-	1.1477	-
2024年2月末日	13,242	-	1.1789	-

【分配の推移】

Aコース

期	1口当たりの分配金(円)
第1期	0.0000
第2期	0.0000
第3期	0.0000
第4期	0.0000
第5期	0.0000

Bコース

期	1口当たりの分配金(円)
第1期	0.0000
第2期	0.0000
第3期	0.0000
第4期	0.0000
第5期	0.0000

Cコース

期	1口当たりの分配金(円)
第1 特定期間（第1期～第6期計算期間合計）	0.0200
第2 特定期間（第7期～第12期計算期間合計）	0.0000
第3 特定期間（第13期～第18期計算期間合計）	0.0000
第4 特定期間（第19期～第24期計算期間合計）	0.0000
第5 特定期間（第25期～第30期計算期間合計）	0.0000

Dコース

期	1口当たりの分配金(円)
第1 特定期間（第1期～第6期計算期間合計）	0.0300
第2 特定期間（第7期～第12期計算期間合計）	0.0500
第3 特定期間（第13期～第18期計算期間合計）	0.0800
第4 特定期間（第19期～第24期計算期間合計）	0.0400
第5 特定期間（第25期～第30期計算期間合計）	0.1000

【収益率の推移】

Aコース

期	収益率(%)
第1期	8.2
第2期	18.4
第3期	12.5
第4期	1.6
第5期	2.7

Bコース

期	収益率(%)
第1期	11.9
第2期	0.7
第3期	6.6
第4期	9.9
第5期	11.2

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

Cコース

期	収益率(%)
第1 特定期間（第1期～第6期計算期間合計）	8.1
第2 特定期間（第7期～第12期計算期間合計）	18.4
第3 特定期間（第13期～第18期計算期間合計）	12.4
第4 特定期間（第19期～第24期計算期間合計）	1.5
第5 特定期間（第25期～第30期計算期間合計）	2.5

Dコース

期	収益率(%)
第1 特定期間（第1期～第6期計算期間合計）	11.9
第2 特定期間（第7期～第12期計算期間合計）	0.2
第3 特定期間（第13期～第18期計算期間合計）	6.8
第4 特定期間（第19期～第24期計算期間合計）	10.0
第5 特定期間（第25期～第30期計算期間合計）	10.5

（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

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第1期	2,235,044,419	47,008,297	2,188,036,122
第2期	3,392,757,062	377,574,827	5,203,218,357
第3期	2,252,716,643	1,903,970,664	5,551,964,336
第4期	407,217,241	873,602,995	5,085,578,582
第5期	198,959,530	1,532,603,497	3,751,934,615

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

Bコース

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第1期	25,606,383,024	666,883,012	24,939,500,012
第2期	34,430,277,407	8,156,800,085	51,212,977,334
第3期	8,437,949,270	12,178,214,278	47,472,712,326
第4期	2,560,858,099	11,334,160,416	38,699,410,009
第5期	1,893,350,492	11,908,680,524	28,684,079,977

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

Cコース

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第1 特定期間 (2021年8月10日～2022年1月17日)	721,853,657	8,090,292	713,763,365
第2 特定期間 (2022年1月18日～2022年7月15日)	311,102,117	149,198,275	875,667,207
第3 特定期間 (2022年7月16日～2023年1月16日)	78,144,861	24,645,136	929,166,932
第4 特定期間 (2023年1月17日～2023年7月18日)	56,625,259	36,297,577	949,494,614
第5 特定期間 (2023年7月19日～2024年1月15日)	25,687	470,861,484	478,658,817

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

Dコース

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第1 特定期間 (2021年8月10日～2022年1月17日)	4,401,944,078	114,969,562	4,286,974,516
第2 特定期間 (2022年1月18日～2022年7月15日)	8,801,801,832	1,143,425,244	11,945,351,104
第3 特定期間 (2022年7月16日～2023年1月16日)	3,580,765,401	1,428,488,784	14,097,627,721
第4 特定期間 (2023年1月17日～2023年7月18日)	1,606,315,489	2,262,127,125	13,441,816,085
第5 特定期間 (2023年7月19日～2024年1月15日)	1,133,882,423	3,081,242,779	11,494,455,729

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

< 参考情報 >

(2024年2月29日現在)

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

※下記データは過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

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

基準価額・純資産の推移



※分配金再投資基準価額は、ファンド設定時に10,000円でスタートしてからの分配金を再投資した実績評価額です。ただし、購入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。

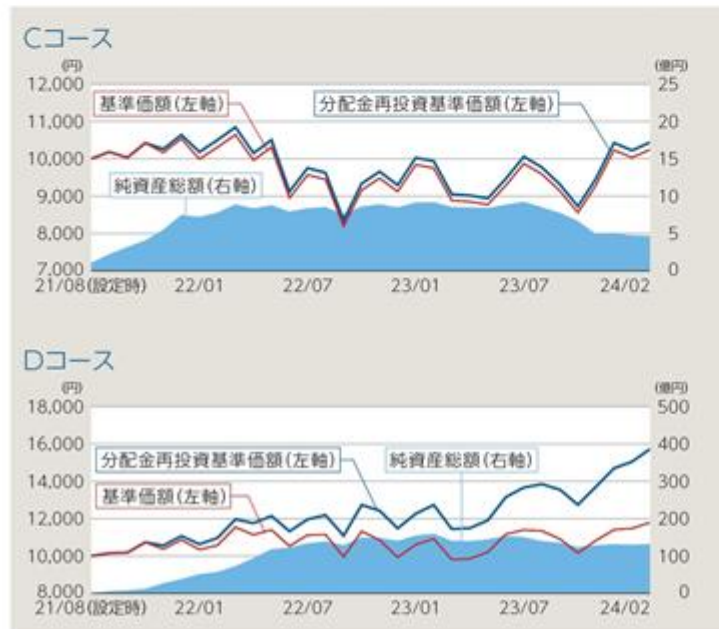
※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

	Aコース	Bコース
基準価額	10,463円	15,761円
純資産総額	33.0億円	428.8億円

分配の推移

(1万口当たり/税引前)

決算期	分配金	
	Aコース	Bコース
2022年1月	0円	0円
2022年7月	0円	0円
2023年1月	0円	0円
2023年7月	0円	0円
2024年1月	0円	0円
設定来累計	0円	0円



※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。

	Cコース	Dコース
基準価額	10,244円	11,789円
純資産総額	4.7億円	132.4億円

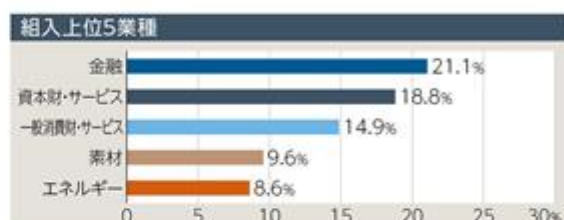
分配の推移

(1万口当たり/税引前)

決算期	分配金	
	Cコース	Dコース
2023年10月	0円	100円
2023年11月	0円	100円
2023年12月	0円	200円
2024年1月	0円	200円
2024年2月	0円	200円
直近1年間累計	0円	1,500円
設定来累計	200円	3,200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				
株式	95.3%	銘柄	国・地域	業種	比率	
投資証券	4.3%	1 コンステレーション・エナジー	アメリカ	公益事業	1.9%	
現金・その他	0.3%	2 フレックス	シンガポール	情報技術	1.4%	
		3 グローバル・ペイメント	アメリカ	金融	1.2%	
		4 エクスプロ・グループ・ホールディングス	オランダ	エネルギー	1.1%	
		5 PG&E	アメリカ	公益事業	1.1%	
		6 アポロ・グローバル・マネジメント	アメリカ	金融	1.0%	
		7 アンテロ・リソーシズ	アメリカ	エネルギー	1.0%	
		8 ウェルタワ	アメリカ	不動産	0.9%	
		9 ファースト・アメリカン・ファイナンシャル	アメリカ	金融	0.9%	
		10 セノバス・エナジー	カナダ	エネルギー	0.8%	



※別途記載がない限り、主要な資産の状況は対純資産総額比率です。

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

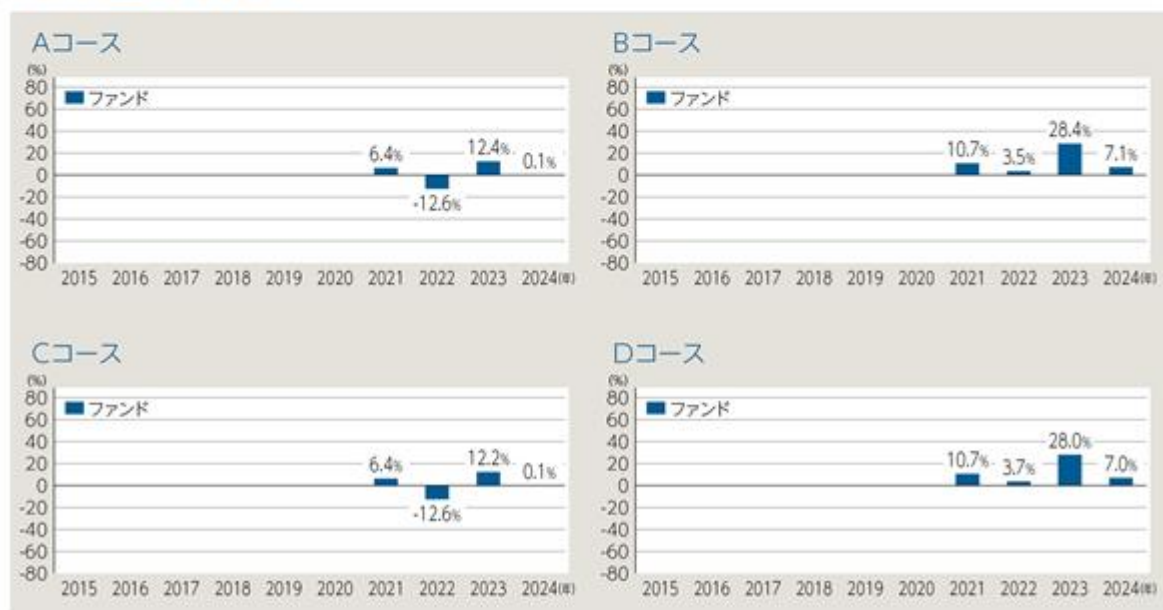
※銘柄はご参考のため、英文表記の一部をカタカナで表記しております。実際の発行体名と異なる場合があります。

※国・地域は発行国・地域を表示しています。

※業種はMSCI/S&P GICS*のセクターに準じて表示しています。

※MSCI/S&P GICSとは、スタンダード&プアーズがMSCI Inc.と共同で作成した世界産業分類基準(Global Industry Classification Standard=GICS)です。

年間収益率の推移



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

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

※2021年は当初設定日(2021年8月10日)以降2021年末までの実績、2024年は年初以降2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>

フィデリティ世界バリュー株式ファンド Aコース(年2回決算・為替ヘッジあり)

フィデリティ世界バリュー株式ファンド Bコース(年2回決算・為替ヘッジなし)

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5期計算期間(2023年7月19日から2024年1月15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。

フィデリティ世界バリュー株式ファンド Cコース(毎月決算・予想分配金提示型・為替ヘッジあり)

フィデリティ世界バリュー株式ファンド Dコース(毎月決算・予想分配金提示型・為替ヘッジなし)

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5特定期間(2023年7月19日から2024年1月15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】

【フィデリティ世界バリュー株式ファンド Aコース（年2回決算・為替ヘッジあり）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期計算期間 2023年7月18日現在	第5期計算期間 2024年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	97,150	237,600
親投資信託受益証券	4,891,028,797	3,868,756,418
派生商品評価勘定	84,661,207	-
未収入金	61,135,899	76,859,802
流動資産合計	5,036,923,053	3,945,853,820
資産合計	5,036,923,053	3,945,853,820
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,354,775	97,108,445
未払金	6,159,240	5,932,937
未払解約金	18,269,463	41,899,307
未払受託者報酬	560,908	456,859
未払委託者報酬	41,510,417	33,810,826
その他未払費用	490,080	432,015
流動負債合計	68,344,883	179,640,389
負債合計	68,344,883	179,640,389
純資産の部		
元本等		
元本	5,085,578,582	3,751,934,615
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	117,000,412	14,278,816
（分配準備積立金）	97,173,856	92,163,980
元本等合計	4,968,578,170	3,766,213,431
純資産合計	4,968,578,170	3,766,213,431
負債純資産合計	5,036,923,053	3,945,853,820

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第４期計算期間 自 2023年 1月17日 至 2023年 7月18日	第５期計算期間 自 2023年 7月19日 至 2024年 1月15日
営業収益		
受取利息	1	-
有価証券売買等損益	528,631,304	485,573,174
為替差損益	588,457,094	356,389,439
営業収益合計	59,825,789	129,183,735
営業費用		
受託者報酬	560,908	456,859
委託者報酬	41,510,417	33,810,826
その他費用	496,479	432,854
営業費用合計	42,567,804	34,700,539
営業利益又は営業損失（ ）	102,393,593	94,483,196
経常利益又は経常損失（ ）	102,393,593	94,483,196
当期純利益又は当期純損失（ ）	102,393,593	94,483,196
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（ ）	34,584,167	3,919,396
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	39,446,446	117,000,412
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,056,076	35,069,548
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,056,076	35,069,548
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,800,616	2,192,912
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,800,616	2,192,912
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	117,000,412	14,278,816

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い ファンドの計算期間は前期末日、翌日および翌々日が休日のため、2023年7月19日から2024年1月15日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第4期計算期間 2023年7月18日現在	第5期計算期間 2024年1月15日現在
1．元本の推移		
期首元本額	5,551,964,336 円	5,085,578,582 円
期中追加設定元本額	407,217,241 円	198,959,530 円
期中一部解約元本額	873,602,995 円	1,532,603,497 円
2．受益権の総数	5,085,578,582 口	3,751,934,615 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	117,000,412 円	- 円
4．1口当たり純資産額	0.9770 円	1.0038 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4期計算期間 自 2023年1月17日 至 2023年7月18日	第5期計算期間 自 2023年7月19日 至 2024年1月15日
1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.45%以内の額	1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左
2．分配金の計算過程 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（738,219円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（215,859,000円）及び分配準備積立金（96,435,637円）より分配対象収益は313,032,856円（1口当たり0.061553円）ですが、分配は行っておりません。	2．分配金の計算過程 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（23,705,067円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（162,635,272円）及び分配準備積立金（68,458,913円）より分配対象収益は254,799,252円（1口当たり0.067911円）ですが、分配は行っておりません。

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

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

．金融商品の時価等に関する事項

1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2．時価の算定方法	<p>（１）有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>（２）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 4 期計算期間 2023年 7 月18日現在	第 5 期計算期間 2024年 1 月15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)
親投資信託受益証券	461,027,721	393,502,903
合 計	461,027,721	393,502,903

（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 4 期計算期間 2023年 7 月18日 現在			第 5 期計算期間 2024年 1 月15日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
		う ち 1 年 超			う ち 1 年 超	
市場取引以外の取引						
為替予約取引						
売建	4,992,233,401	- 4,908,926,969	83,306,432	3,794,136,594	- 3,891,245,039	97,108,445
香港・ドル	-	-	-	13,097,442	- 13,339,018	241,576
アメリカ・ドル	4,629,301,484	- 4,549,830,221	79,471,263	3,421,167,754	- 3,508,743,762	87,576,008
イギリス・ポンド	10,132,238	- 10,209,639	77,401	32,048,834	- 32,780,494	731,660
カナダ・ドル	231,315,612	- 226,599,104	4,716,508	213,413,139	- 218,446,539	5,033,400
スイス・フラン	12,057,890	- 12,266,156	208,266	12,742,776	- 13,292,459	549,683
メキシコ・ペソ	18,446,417	- 18,678,363	231,946	16,993,250	- 17,825,389	832,139
ユーロ	90,979,760	- 91,343,486	363,726	84,673,399	- 86,817,378	2,143,979
合計	4,992,233,401	- 4,908,926,969	83,306,432	3,794,136,594	- 3,891,245,039	97,108,445

（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	フィデリティ世界バリュー株式マザーファンド	2,567,531,470	3,868,756,418	
親投資信託受益証券	合計	2,567,531,470	3,868,756,418	
合計		2,567,531,470	3,868,756,418	

(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。

【フィデリティ世界バリュー株式ファンド Bコース(年2回決算・為替ヘッジなし)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期計算期間 2023年7月18日現在	第5期計算期間 2024年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	65,234,444	30,509,903
親投資信託受益証券	50,455,287,609	41,567,707,164
未収入金	755,601,596	790,289,853
流動資産合計	51,276,123,649	42,388,506,920
資産合計	51,276,123,649	42,388,506,920
負債の部		
流動負債		
未払解約金	379,931,909	448,404,284
未払受託者報酬	5,755,428	4,867,379
未払委託者報酬	425,904,913	360,189,747
その他未払費用	3,693,739	3,166,763
流動負債合計	815,285,989	816,628,173
負債合計	815,285,989	816,628,173
純資産の部		
元本等		
元本	38,699,410,009	28,684,079,977
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	11,761,427,651	12,887,798,770
(分配準備積立金)	6,589,730,234	8,657,611,769
元本等合計	50,460,837,660	41,571,878,747
純資産合計	50,460,837,660	41,571,878,747
負債純資産合計	51,276,123,649	42,388,506,920

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第４期計算期間 自 2023年 1月17日 至 2023年 7月18日	第５期計算期間 自 2023年 7月19日 至 2024年 1月15日
営業収益		
受取利息	40	19
有価証券売買等損益	5,444,592,818	5,207,993,231
営業収益合計	5,444,592,858	5,207,993,250
営業費用		
受託者報酬	5,755,428	4,867,379
委託者報酬	425,904,913	360,189,747
その他費用	3,712,354	3,185,401
営業費用合計	435,372,695	368,242,527
営業利益又は営業損失（ ）	5,009,220,163	4,839,750,723
経常利益又は経常損失（ ）	5,009,220,163	4,839,750,723
当期純利益又は当期純損失（ ）	5,009,220,163	4,839,750,723
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（ ）	518,884,819	788,969,691
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	8,832,255,249	11,761,427,651
剰余金増加額又は欠損金減少額	553,314,990	708,977,551
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	553,314,990	708,977,551
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,114,477,932	3,633,387,464
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,114,477,932	3,633,387,464
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,761,427,651	12,887,798,770

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い ファンドの計算期間は前期末日、翌日および翌々日が休日のため、2023年7月19日から2024年1月15日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期計算期間 2023年7月18日現在	第5期計算期間 2024年1月15日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	47,472,712,326 円	38,699,410,009 円
期中追加設定元本額	2,560,858,099 円	1,893,350,492 円
期中一部解約元本額	11,334,160,416 円	11,908,680,524 円
2. 受益権の総数	38,699,410,009 口	28,684,079,977 口
3. 1口当たり純資産額	1.3039 円	1.4493 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期計算期間 自 2023年1月17日 至 2023年7月18日	第5期計算期間 自 2023年7月19日 至 2024年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.45%以内の額	1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左
2. 分配金の計算過程 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（382,064,709円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（4,108,270,635円）、信託約款に規定される収益調整金（5,171,697,417円）及び分配準備積立金（2,099,394,890円）より分配対象収益は11,761,427,651円（1口当たり0.303917円）であります。分配は行っておりません。	2. 分配金の計算過程 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（318,200,015円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（3,732,581,017円）、信託約款に規定される収益調整金（4,230,187,001円）及び分配準備積立金（4,606,830,737円）より分配対象収益は12,887,798,770円（1口当たり0.449301円）であります。分配は行っておりません。

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

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

．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第４期計算期間 2023年 7月18日現在	第５期計算期間 2024年 1月15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)
親投資信託受益証券	4,917,804,278	4,426,100,648
合 計	4,917,804,278	4,426,100,648

（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	フィデリティ世界バリュー株式マザーファンド	27,586,744,866	41,567,707,164	
親投資信託受益証券 合計		27,586,744,866	41,567,707,164	
合計		27,586,744,866	41,567,707,164	

（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。

【フィデリティ世界バリュー株式ファンド Cコース（毎月決算・予想分配金提示型・為替ヘッジあり）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4特定期間 2023年7月18日現在	第5特定期間 2024年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	177	-
親投資信託受益証券	895,983,872	477,968,988
派生商品評価勘定	15,668,729	2,699
未収入金	5,972,416	5,793,849
流動資産合計	917,625,194	483,765,536
資産合計		
	917,625,194	483,765,536
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	237,193	11,835,169
未払金	908,727	747,220
未払解約金	4,367,794	-
未払受託者報酬	17,602	9,154
未払委託者報酬	1,303,011	678,118
その他未払費用	204,339	194,695
流動負債合計	7,038,666	13,464,356
負債合計		
	7,038,666	13,464,356
純資産の部		
元本等		
元本	949,494,614	478,658,817
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	38,908,086	8,357,637
（分配準備積立金）	30,909,158	17,815,555
元本等合計	910,586,528	470,301,180
純資産合計		
	910,586,528	470,301,180
負債純資産合計		
	917,625,194	483,765,536

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4特定期間 自 2023年1月17日 至 2023年7月18日	第5特定期間 自 2023年7月19日 至 2024年1月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	90,781,664	69,076,724
為替差損益	97,884,967	71,418,989
営業収益合計	7,103,303	2,342,265
営業費用		
受託者報酬	96,576	75,100
委託者報酬	7,150,035	5,561,464
その他費用	210,279	194,695
営業費用合計	7,456,890	5,831,259
営業利益又は営業損失（ ）	14,560,193	8,173,524
経常利益又は経常損失（ ）	14,560,193	8,173,524
当期純利益又は当期純損失（ ）	14,560,193	8,173,524
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（ ）	1,211,746	240,197
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	24,287,871	38,908,086
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,818,486	38,485,588
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,818,486	38,485,588
剰余金減少額又は欠損金増加額	666,762	1,812
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	666,762	1,812
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	38,908,086	8,357,637

（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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間の取扱い ファンドの特定期間は前期末日、翌日および翌々日が休日のため、2023年7月19日から2024年1月15日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第4特定期間 2023年7月18日現在	第5特定期間 2024年1月15日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	929,166,932 円	949,494,614 円
期中追加設定元本額	56,625,259 円	25,687 円
期中一部解約元本額	36,297,577 円	470,861,484 円
2. 受益権の総数	949,494,614 口	478,658,817 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	38,908,086 円	8,357,637 円
4. 1口当たり純資産額	0.9590 円	0.9825 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4特定期間 自 2023年1月17日 至 2023年7月18日	第5特定期間 自 2023年7月19日 至 2024年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.45%以内の額	1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左
2. 分配金の計算過程 （自2023年1月17日 至2023年2月15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（718,036円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（40,124,305円）及び分配準備積立金（25,969,103円）より分配対象収益は66,811,444円（1口当たり0.073755円）ですが、分配は行っておりません。	2. 分配金の計算過程 （自2023年7月19日 至2023年8月15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（946,230円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、信託約款に規定される収益調整金（40,896,081円）及び分配準備積立金（28,890,166円）より分配対象収益は70,732,477円（1口当たり0.079701円）ですが、分配は行っておりません。

(自2023年2月16日 至2023年3月15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(670,879円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(44,345,266円)及び分配準備積立金(26,687,139円)より分配対象収益は71,703,284円(1口当たり0.074506円)ですが、分配は行っておりません。

(自2023年3月16日 至2023年4月17日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(1,053,927円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(44,349,731円)及び分配準備積立金(27,358,018円)より分配対象収益は72,761,676円(1口当たり0.075601円)ですが、分配は行っておりません。

(自2023年4月18日 至2023年5月15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(14,405円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(44,217,733円)及び分配準備積立金(28,326,748円)より分配対象収益は72,558,886円(1口当たり0.075616円)ですが、分配は行っておりません。

(自2023年5月16日 至2023年6月15日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(1,759,818円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(44,134,084円)及び分配準備積立金(28,286,961円)より分配対象収益は74,180,863円(1口当たり0.077453円)ですが、分配は行っておりません。

(自2023年8月16日 至2023年9月15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(323,486円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(40,288,699円)及び分配準備積立金(29,393,104円)より分配対象収益は70,005,289円(1口当たり0.080071円)ですが、分配は行っておりません。

(自2023年9月16日 至2023年10月16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(0円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(37,691,547円)及び分配準備積立金(27,800,699円)より分配対象収益は65,492,246円(1口当たり0.080071円)ですが、分配は行っておりません。

(自2023年10月17日 至2023年11月15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(755,060円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(26,143,968円)及び分配準備積立金(19,283,303円)より分配対象収益は46,182,331円(1口当たり0.081401円)ですが、分配は行っておりません。

(自2023年11月16日 至2023年12月15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(981,137円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(23,783,903円)及び分配準備積立金(18,228,627円)より分配対象収益は42,993,667円(1口当たり0.083302円)ですが、分配は行っておりません。

<p>(自2023年6月16日 至2023年7月18日)</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(1,121,584円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(43,754,031円)及び分配準備積立金(29,787,574円)より分配対象収益は74,663,189円(1口当たり0.078635円)であります。分配は行っていません。</p>	<p>(自2023年12月16日 至2024年1月15日)</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(0円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(22,057,847円)及び分配準備積立金(17,815,555円)より分配対象収益は39,873,402円(1口当たり0.083302円)であります。分配は行っていません。</p>
--	---

(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ならびに運用リスク管理部門が行う方法を併用し検証しています。

・金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はあり ません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2) 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4 特定期間 2023年7月18日現在	第5 特定期間 2024年1月15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	38,026,169	242,241
合 計	38,026,169	242,241

（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4 特定期間 2023年7月18日 現在			第5 特定期間 2024年1月15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	913,983,853	-	898,552,317	15,431,536	466,018,667	-	477,851,137	11,832,470
香港・ドル	-	-	-	-	1,767,186	-	1,798,163	30,977
アメリカ・ドル	848,240,404	-	833,448,759	14,791,645	419,527,336	-	430,212,165	10,684,829
イギリス・ポンド	1,961,659	-	1,976,644	14,985	3,876,782	-	3,966,123	89,341
カナダ・ドル	42,973,749	-	42,168,233	805,516	27,023,763	-	27,623,279	599,516
スイス・フラン	2,173,853	-	2,211,135	37,282	1,564,331	-	1,631,810	67,479
メキシコ・ペソ	3,159,003	-	3,198,723	39,720	1,919,338	-	2,017,403	98,065
ユーロ	15,475,185	-	15,548,823	73,638	10,339,931	-	10,602,194	262,263
合計	913,983,853	-	898,552,317	15,431,536	466,018,667	-	477,851,137	11,832,470

（注1）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

（注2）デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(ア) 株式

該当事項はありません。

(イ) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	フィデリティ世界バリュー株式マザー ファンド	317,207,983	477,968,988	
親投資信託受益証券 合計		317,207,983	477,968,988	
合計		317,207,983	477,968,988	

(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。

【フィデリティ世界バリュー株式ファンド Dコース(毎月決算・予想分配金提示型・為替ヘッジなし)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4特定期間 2023年7月18日現在	第5特定期間 2024年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	11,066	3,430,087
親投資信託受益証券	14,505,083,491	12,571,901,963
未収入金	510,670,188	416,208,234
流動資産合計	15,015,764,745	12,991,540,284
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	268,836,321	229,889,114
未払解約金	76,209,154	52,675,011
未払受託者報酬	299,051	243,688
未払委託者報酬	22,130,521	18,033,434
その他未払費用	1,602,536	1,455,414
流動負債合計	369,077,583	302,296,661
負債合計	369,077,583	302,296,661
純資産の部		
元本等		
元本	13,441,816,085	11,494,455,729
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,204,871,077	1,194,787,894
(分配準備積立金)	181,047,680	295,180,106
元本等合計	14,646,687,162	12,689,243,623
純資産合計	14,646,687,162	12,689,243,623
負債純資産合計	15,015,764,745	12,991,540,284

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4特定期間 自 2023年1月17日 至 2023年7月18日	第5特定期間 自 2023年7月19日 至 2024年1月15日
営業収益		
受取利息	5	2
有価証券売買等損益	1,564,636,119	1,533,067,599
営業収益合計	1,564,636,124	1,533,067,601
営業費用		
受託者報酬	1,630,290	1,463,120
委託者報酬	120,643,881	108,274,049
その他費用	1,604,996	1,461,406
営業費用合計	123,879,167	111,198,575
営業利益又は営業損失（ ）	1,440,756,957	1,421,869,026
経常利益又は経常損失（ ）	1,440,756,957	1,421,869,026
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,440,756,957	1,421,869,026
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（ ）	42,709,422	38,911,202
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	383,593,971	1,204,871,077
剰余金増加額又は欠損金減少額	55,050,043	115,866,699
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	55,050,043	115,866,699
剰余金減少額又は欠損金増加額	76,555,667	306,982,411
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	76,555,667	306,982,411
分配金	555,264,805	1,201,925,295
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,204,871,077	1,194,787,894

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間の取扱い ファンドの特定期間は前期末日、翌日および翌々日が休日のため、2023年7月19日から2024年1月15日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第4特定期間 2023年7月18日現在	第5特定期間 2024年1月15日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	14,097,627,721 円	13,441,816,085 円
期中追加設定元本額	1,606,315,489 円	1,133,882,423 円
期中一部解約元本額	2,262,127,125 円	3,081,242,779 円
2. 受益権の総数	13,441,816,085 口	11,494,455,729 口
3. 1口当たり純資産額	1.0896 円	1.1039 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4特定期間 自 2023年1月17日 至 2023年7月18日	第5特定期間 自 2023年7月19日 至 2024年1月15日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.45%以内の額	1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左
2. 分配金の計算過程 (自2023年1月17日 至2023年2月15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(12,711,252円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(346,458,014円)、信託約款に規定される収益調整金(1,434,372,275円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は1,793,541,541円(1口当たり0.121952円)であり、うち147,070,030円(1口当たり0.010000円)を分配金額としております。	2. 分配金の計算過程 (自2023年7月19日 至2023年8月15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(16,033,552円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(893,008,067円)、信託約款に規定される収益調整金(1,227,247,745円)及び分配準備積立金(166,404,952円)より分配対象収益は2,302,694,316円(1口当たり0.184734円)であり、うち249,298,940円(1口当たり0.020000円)を分配金額としております。

(自2023年2月16日 至2023年3月15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(10,599,702円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,404,732,154円)及び分配準備積立金(205,499,689円)より分配対象収益は1,620,831,545円(1口当たり0.112698円)ですが、分配は行っておりません。

(自2023年3月16日 至2023年4月17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(16,882,044円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,396,555,488円)及び分配準備積立金(212,048,512円)より分配対象収益は1,625,486,044円(1口当たり0.113889円)ですが、分配は行っておりません。

(自2023年4月18日 至2023年5月15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(342,621円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,382,600,617円)及び分配準備積立金(226,169,558円)より分配対象収益は1,609,112,796円(1口当たり0.113914円)ですが、分配は行っておりません。

(自2023年5月16日 至2023年6月15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(29,609,470円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,369,883,038円)及び分配準備積立金(217,928,881円)より分配対象収益は1,617,421,389円(1口当たり0.116062円)であり、うち139,358,454円(1口当たり0.010000円)を分配金額としております。

(自2023年8月16日 至2023年9月15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(5,591,686円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,231,821,785円)及び分配準備積立金(802,161,191円)より分配対象収益は2,039,574,662円(1口当たり0.165209円)であり、うち246,908,474円(1口当たり0.020000円)を分配金額としております。

(自2023年9月16日 至2023年10月16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(0円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,238,702,349円)及び分配準備積立金(544,969,353円)より分配対象収益は1,783,671,702円(1口当たり0.145224円)であり、うち122,822,264円(1口当たり0.010000円)を分配金額としております。

(自2023年10月17日 至2023年11月15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(21,161,093円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,213,374,082円)及び分配準備積立金(410,208,057円)より分配対象収益は1,644,743,232円(1口当たり0.136992円)であり、うち120,060,900円(1口当たり0.010000円)を分配金額としております。

(自2023年11月16日 至2023年12月15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(25,309,381円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(451,107,639円)、信託約款に規定される収益調整金(1,183,991,170円)及び分配準備積立金(295,388,993円)より分配対象収益は1,955,797,183円(1口当たり0.167919円)であり、うち232,945,603円(1口当たり0.020000円)を分配金額としております。

<p>(自2023年6月16日 至2023年7月18日)</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(18,410,705円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(327,500,306円)、信託約款に規定される収益調整金(1,321,726,026円)及び分配準備積立金(103,972,990円)より分配対象収益は1,771,610,027円(1口当たり0.131798円)であり、うち268,836,321円(1口当たり0.020000円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2023年12月16日 至2024年1月15日)</p> <p>計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(0円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,175,247,188円)及び分配準備積立金(525,069,220円)より分配対象収益は1,700,316,408円(1口当たり0.147925円)であり、うち229,889,114円(1口当たり0.020000円)を分配金額としております。</p>
--	--

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

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

. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第 4 特定期間 2023年 7 月18日現在	第 5 特定期間 2024年 1 月15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	615,445,178	15,028,952
合 計	615,445,178	15,028,952

（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	フィデリティ世界バリュー株式マザーファンド	8,343,444,361	12,571,901,963	
親投資信託受益証券	合計	8,343,444,361	12,571,901,963	
合計		8,343,444,361	12,571,901,963	

（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、「フィデリティ世界バリュー株式マザーファンド」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。

「フィデリティ世界バリュー株式マザーファンド」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	2023年 7月18日現在	2024年 1月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,528,022,002	1,361,716,668
株式	66,261,423,327	54,672,208,360
投資証券	4,040,488,610	3,043,068,068
派生商品評価勘定	23,333,334	327,252
未収入金	457,379,504	1,214,316,566
未収配当金	48,924,964	43,680,774
流動資産合計	72,359,571,741	60,335,317,688
資産合計	72,359,571,741	60,335,317,688
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,498,169	9,867,603
未払金	-	283,129,826
未払解約金	1,334,631,697	1,290,629,781
その他未払費用	943	8,328
流動負債合計	1,337,130,809	1,583,635,538
負債合計	1,337,130,809	1,583,635,538
純資産の部		
元本等		
元本	52,787,613,775	38,990,567,215
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	18,234,827,157	19,761,114,935
元本等合計	71,022,440,932	58,751,682,150
純資産合計	71,022,440,932	58,751,682,150
負債純資産合計	72,359,571,741	60,335,317,688

(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	株式、投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	2023年7月18日現在	2024年1月15日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	63,275,178,669 円	52,787,613,775 円
期中追加設定元本額	3,223,735,300 円	1,326,675,785 円
期中一部解約元本額	13,711,300,194 円	15,123,722,345 円
2. 期末元本額及びその内訳		
フィデリティ世界バリュー株式ファンド A コース（年2回決算・為替ヘッジあり）	3,635,371,486 円	2,567,531,470 円
フィデリティ世界バリュー株式ファンド B コース（年2回決算・為替ヘッジなし）	37,502,071,956 円	27,586,744,866 円
フィデリティ世界バリュー株式ファンド C コース（毎月決算・予想分配金提示型・為替 ヘッジあり）	665,960,958 円	317,207,983 円
フィデリティ世界バリュー株式ファンド D コース（毎月決算・予想分配金提示型・為替 ヘッジなし）	10,781,242,375 円	8,343,444,361 円
フィデリティ世界バリュー株式ファンド（適格 機関投資家専用）	202,967,000 円	175,638,535 円
計	52,787,613,775 円	38,990,567,215 円
3. 受益権の総数	52,787,613,775 口	38,990,567,215 口
4. 1口当たり純資産額	1.3454 円	1.5068 円

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

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

・金融商品の時価等に関する事項

1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はあり ません。
2．時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評 価方法」に記載しております。 （２）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。 （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。
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているた め、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもありま す。 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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2023年 7月18日現在	2024年 1月15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	8,417,179,808	2,623,786,886
投資証券	235,463,247	181,535,645
合 計	8,652,643,055	2,805,322,531

（注）2023年7月18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（2022年7月16日から2023年7月18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	2023年7月18日 現在			2024年1月15日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
	うち 1 年 超			うち 1 年 超		
市場取引以外の取引						
為替予約取引						
売建	1,341,775,276	- 1,320,986,684	20,788,592	1,371,597,938	- 1,381,117,537	9,519,599
アメリカ・ドル	1,334,638,926	- 1,313,792,120	20,846,806	1,305,573,739	- 1,315,129,524	9,555,785
イギリス・ポンド	-	-	-	12,178,650	- 12,240,344	61,694
カナダ・ドル	-	-	-	36,004,400	- 35,903,126	101,274
ユーロ	7,136,350	- 7,194,564	58,214	17,841,149	- 17,844,543	3,394
買建	7,136,350	- 7,182,923	46,573	93,145,025	- 93,124,273	20,752
香港・ドル	-	-	-	14,139,477	- 14,117,964	21,513
アメリカ・ドル	7,136,350	- 7,182,923	46,573	66,024,199	- 66,086,660	62,461
イギリス・ポンド	-	-	-	12,981,349	- 12,919,649	61,700
合計	1,348,911,626	- 1,328,169,607	20,835,165	1,464,742,963	- 1,474,241,810	9,540,351

（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	
日本円	京都フィナンシャルグループ	72,800	2,377.00	173,045,600	
日本円	小計	72,800		173,045,600	
香港・ドル	SAMSONITE INTERNATIONAL S.A.	503,617	23.70	11,935,722.90	
香港・ドル	小計	503,617		11,935,722.90 (221,527,018)	
アメリカ・ドル	AES CORP	210,621	18.44	3,883,851.24	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,835	102.48	905,410.80	
	BAXTER INTL INC	26,279	40.00	1,051,160.00	
	BLOCK H & R INC	25,156	45.44	1,143,088.64	
	BRINKER INTERNATIONAL INC	51,140	38.20	1,953,548.00	
	BRUNSWICK CORP	15,957	86.64	1,382,514.48	
	CVS HEALTH CORP	29,199	76.56	2,235,475.44	
	CABOT CORP	22,097	76.24	1,684,675.28	
	TOPGOLF CALLAWAY BRANDS CORP	143,083	13.81	1,975,976.23	
	CARLISLE COS INC	4,458	302.10	1,346,761.80	
	ENTERGY CORP	18,759	103.13	1,934,615.67	
	GRUPO TELEVISA (CPO) SPON ADR	479,192	2.78	1,332,153.76	
	HARLEY-DAVIDSON INC	79,997	34.10	2,727,897.70	
	HNI CORP	23,603	40.91	965,598.73	
	HARTFORD FINL SVCS GROUP INC	36,110	82.16	2,966,797.60	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	67,152	31.97	2,146,849.44	
	KENNAMETAL INC	50,976	24.35	1,241,265.60	
	KEYCORP	172,148	14.20	2,444,501.60	
	KOHL'S CORP	74,049	26.12	1,934,159.88	
	LOUISIANA PACIFIC CORP	28,216	69.01	1,947,186.16	
	MDU RESOURCES GROUP INC	128,949	19.49	2,513,216.01	
	MANPOWERGROUP INC	19,818	76.91	1,524,202.38	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	14,332	101.85	1,459,714.20	
	NCR VOYIX CORP	116,127	15.08	1,751,195.16	
	NOV INC	66,185	19.98	1,322,376.30	
	OLIN CORP	47,470	51.76	2,457,047.20	
	OSHKOSH CORP	11,871	105.50	1,252,390.50	
	PG&E CORP	280,031	17.51	4,903,342.81	

BRINKS CO	32,206	81.22	2,615,771.32	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC.	22,819	109.13	2,490,237.47	
REGAL REXNORD CORP	18,707	138.59	2,592,603.13	
RYDER SYSTEM INC	21,237	110.64	2,349,661.68	
TRAVELERS COMPANIES INC	14,600	195.56	2,855,176.00	
SCHNITZER STEEL INDS INC CL A	32,735	27.11	887,445.85	
TEREX CORP	18,024	57.18	1,030,612.32	
TIMKEN CO	35,461	78.42	2,780,851.62	
GLOBE LIFE INC	10,850	120.20	1,304,170.00	
TYSON FOODS INC CL A	41,056	54.87	2,252,742.72	
UGI CORP NEW	61,723	23.70	1,462,835.10	
WILLIAMS-SONOMA INC	8,388	203.96	1,710,816.48	
METHANEX CORP (FIL USD ONLY)	52,752	45.48	2,399,160.96	
COHERENT CORP	32,780	41.75	1,368,565.00	
EDISON INTL	45,127	71.36	3,220,262.72	
MCGRATH RENTCORP	8,688	109.90	954,811.20	
FIRSTENERGY CORP	78,804	38.37	3,023,709.48	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	27,120	118.83	3,222,669.60	
FEDEX CORP	9,056	248.57	2,251,049.92	
SEMPRA	30,761	75.41	2,319,687.01	
NEWELL BRANDS INC	188,996	8.49	1,604,576.04	
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS INC	120,006	20.89	2,506,925.34	
WESCO INTERNATIONAL INC	16,878	169.67	2,863,690.26	
FLEX LTD	199,421	23.33	4,652,491.93	
SOUTHWEST GAS HOLDINGS INC	16,900	61.93	1,046,617.00	
LITHIA MOTORS INC CL	9,849	285.76	2,814,450.24	
FLUOR CORP	51,464	37.66	1,938,134.24	
GRANITE CONSTRUCTION INC	25,461	46.99	1,196,412.39	
ATI INC	30,445	42.91	1,306,394.95	
US BANCORP DEL	60,207	42.15	2,537,725.05	
CENTENE CORP	42,982	78.81	3,387,411.42	
LIGHT & WONDER INC CL A	15,574	79.98	1,245,608.52	
SLM CORP	122,775	18.54	2,276,248.50	
UFP INDUSTRIES INC	12,863	116.67	1,500,726.21	
AUTOLIV INC	18,501	104.21	1,927,989.21	
ACUITY BRANDS INC	9,523	224.57	2,138,580.11	
EAGLE MATERIALS INC	6,956	202.91	1,411,441.96	

ASSURANT INC	19,364	164.64	3,188,088.96	
EAST WEST BANCORP INC	32,599	71.79	2,340,282.21	
COMPASS MINERALS INTL INC	53,371	20.45	1,091,436.95	
TEMPUR SEALY INTERNATIONAL INC	51,024	49.99	2,550,689.76	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,168	376.40	1,945,235.20	
JONES LANG LASALLE INC	1,033	173.68	179,411.44	
GLOBAL PAYMENTS INC	39,353	130.27	5,126,515.31	
WNS HLDGS LTD SP ADR	19,216	65.97	1,267,679.52	
CIENA CORP	9,780	49.72	486,261.60	
JOHNSON CONTROLS INTERNATL PLC	33,720	56.34	1,899,784.80	
GENPACT LTD	1,229	34.80	42,769.20	
UPBOUND GROUP INC	83,166	32.54	2,706,221.64	
HERC HOLDINGS INC	15,920	140.43	2,235,645.60	
SIGNET JEWELERS LTD (US)	25,569	96.06	2,456,158.14	
SALLY BEAUTY HLDGS INC	153,675	11.82	1,816,438.50	
PRIMERICA INC	4,771	218.77	1,043,751.67	
FIRST AMERICAN FINANCIAL CORP	60,436	61.95	3,744,010.20	
NEXTERA ENERGY	41,277	61.04	2,519,548.08	
GRAPHIC PACKAGING HOLDING CO	76,113	25.70	1,956,104.10	
JAZZ PHARMA PLC	12,344	118.94	1,468,195.36	
AZZ INC	800	57.92	46,336.00	
KOSMOS ENERGY LTD	193,907	6.50	1,260,395.50	
POPULAR INC	33,534	81.08	2,718,936.72	
BEACON ROOFING SUPPLY INC	12,216	83.89	1,024,800.24	
NEWS CORP NEW CL A	26,244	24.24	636,154.56	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,313	110.19	916,009.47	
CNH INDUSTRIAL NV	64,234	11.49	738,048.66	
CONSTELLIUM SE CL A	163,936	18.24	2,990,192.64	
XPO INC	34,196	86.46	2,956,586.16	
ALLY FINANCIAL INC	76,359	33.03	2,522,137.77	
VOYA FINANCIAL INC	34,149	70.61	2,411,260.89	
ALLISON TRANSMISSION HLDGS INC	43,300	56.96	2,466,368.00	
TARGA RESOURCES CORP	24,789	83.82	2,077,813.98	
ANTERO RES CORP	193,486	23.45	4,537,246.70	

TECNOGLASS INC	41,305	42.71	1,764,136.55	
ESSENT GROUP LTD	43,470	53.56	2,328,253.20	
FIRST CITIZENS BANCSHARES INC	1,762	1,393.38	2,455,135.56	
CHEMOURS CO/ THE	93,369	30.19	2,818,810.11	
ENERGIZER HLDGS INC	47,501	32.11	1,525,257.11	
WESTROCK CO	56,388	41.69	2,350,815.72	
EXPRO GROUP HOLDINGS NV	208,254	16.55	3,446,603.70	
TRANSUNION	13,496	68.50	924,476.00	
ADIANT PLC	63,964	32.64	2,087,784.96	
LUMENTUM HOLDINGS INC	59,843	50.70	3,034,040.10	
HILTON GRAND VACATIONS INC	39,972	40.41	1,615,268.52	
DELEK US HOLDINGS INC	47,301	25.36	1,199,553.36	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	39,133	32.94	1,289,041.02	
CHAMPIONX CORP	56,740	26.62	1,510,418.80	
THE CIGNA GROUP	9,073	305.01	2,767,355.73	
TIDEWATER INC	25,476	65.70	1,673,773.20	
CHART INDUSTRIES INC	10,501	132.99	1,396,527.99	
TRONOX HOLDINGS PLC	175,489	12.62	2,214,671.18	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,338	230.93	2,618,284.34	
NEWMARK GROUP INC CL A	84,907	9.70	823,597.90	
GRAFTECH INTERNATIONAL LTD	280,446	1.70	476,758.20	
ADAPTHEALTH CORP	128,077	6.93	887,573.61	
O-I GLASS INC	81,087	15.39	1,247,928.93	
CARLYLE GROUP INC (THE)	59,224	39.36	2,331,056.64	
MARRIOTT VACATIONS WORLD	9,972	83.99	837,548.28	
ACADEMY SPORTS & OUTDOORS INC	22,764	62.09	1,413,416.76	
MARCUS & MILLICHAP CO INC	8,811	37.48	330,236.28	
CONCENTRIX CORP	29,598	94.91	2,809,146.18	
PROG HOLDINGS INC	55,697	29.66	1,651,973.02	
DRIVEN BRANDS HOLDINGS INC	34,164	13.25	452,673.00	
AXOS FINANCIAL INC	24,242	52.97	1,284,098.74	
VALARIS LTD	30,128	66.80	2,012,550.40	
FIRST ADVANTAGE CORP	46,207	15.91	735,153.37	

CORE & MAIN INC	24,279	41.00	995,439.00	
VICTORIA'S SECRET & CO	77,948	23.75	1,851,265.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	41,558	95.41	3,965,048.78	
CONSTELLATION ENERGY CORP	48,436	112.91	5,468,908.76	
WEBSTER FINANCIAL	54,291	49.75	2,700,977.25	
BARNES GROUP INC	43,612	31.75	1,384,681.00	
RXO INC	39,796	22.57	898,195.72	
U-HAUL HOLDING CO	40,373	63.92	2,580,642.16	
ARCBEST CORP	13,951	117.95	1,645,520.45	
KENVUE INC	43,500	21.51	935,685.00	
FORTREA HOLDINGS INC	16,709	30.73	513,467.57	
TALEN ENERGY CORP	21,734	64.50	1,401,843.00	
BUNGE GLOBAL SA	31,384	94.89	2,978,027.76	
ARMSTRONG WORLD INDUSTRIES INC	9,001	98.59	887,408.59	
BUILDERS FIRSTSOURCE	15,955	167.39	2,670,707.45	
CELANESE CORP	15,916	147.37	2,345,540.92	
DARLING INGREDIENTS INC	68,765	45.27	3,112,991.55	
ECHOSTAR CORP CL A	10,004	16.06	160,664.24	
FIRST CTZNS BNCSHRS INC CL B	231	1,220.00	281,820.00	
GEO GROUP INC	95,233	10.72	1,020,897.76	
MUELLER WATER PRODUCTS INC A	67,787	13.86	939,527.82	
NEXSTAR MEDIA GROUP INC	11,057	171.82	1,899,813.74	
ONEMAIN HOLDINGS INC	64,609	48.19	3,113,507.71	
PVH CORP	22,750	119.96	2,729,090.00	
PHILLIPS 66	9,684	132.87	1,286,713.08	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	15,163	168.59	2,556,330.17	
WILLSCOT MOBILE MINI HOLDINGS	45,309	42.80	1,939,225.20	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HO	26,970	54.37	1,466,358.90	
WALKER & DUNLOP INC	20,970	98.12	2,057,576.40	
WESTLAKE CORP	19,987	134.61	2,690,450.07	
WINTRUST FINANCIAL CORP	6,731	93.99	632,646.69	
US FOODS HOLDING CORP	65,349	46.05	3,009,321.45	
GMS INC	17,534	80.14	1,405,174.76	

	CAMPING WORLD HOLDINGS INC CLS	59,719	25.29	1,510,293.51	
	RED ROCK RESORTS INC	19,622	49.79	976,979.38	
	COMPASS INC	320,023	3.40	1,088,078.20	
	GATES INDUSTRIAL CORP PLC	103,945	13.53	1,406,375.85	
	THRYV HOLDINGS INC	128,803	18.62	2,398,311.86	
	COREBRIDGE FINANCIAL INC	67,815	24.17	1,639,088.55	
	CRANE NXT CO	17,740	55.42	983,150.80	
	ATMUS FILTRATION TECHN INC	56,095	22.66	1,271,112.70	
	BGC GROUP INC A	291,371	6.73	1,960,926.83	
	NCR ATLEOS CORP	66,347	22.15	1,469,586.05	
アメリカ・ドル	小計	9,629,851		335,745,041.23 (48,740,107,635)	
イギリス・ポンド	JOHN WOOD GROUP PLC	128,208	1.56	201,158.35	
	WPP PLC NEW (UK)	172,045	7.28	1,253,863.96	
	DR. MARTENS LTD	547,285	0.79	435,091.57	
	PETERSHILL PARTNERS PLC	404,363	1.60	649,406.97	
イギリス・ポンド	小計	1,251,901		2,539,520.85 (469,608,196)	
カナダ・ドル	CANADIAN NATURAL RESOURCES	31,108	87.43	2,719,772.44	
	ONEX CORP SUB-VTG	14,534	92.85	1,349,481.90	
	IMPERIAL OIL LTD	36,055	77.96	2,810,847.80	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	75,742	42.13	3,191,010.46	
	TFI INTERNATIONAL INC	13,782	183.18	2,524,586.76	
	CENOVUS ENERGY INC	132,723	20.92	2,776,565.16	
	SECURE ENERGY SERVICES INC	51,304	9.99	512,526.96	
	TOURMALINE OIL CORP	43,274	62.32	2,696,835.68	
	BRP INC	28,247	88.52	2,500,424.44	
	ALGONQUIN PWR & UTIL CORP	191,454	8.56	1,638,846.24	
	PARKLAND CORP	43,369	44.85	1,945,099.65	
	ECN CAPITAL CORP	424,285	2.78	1,179,512.30	
	INTERFOR CORP	118,272	23.14	2,736,814.08	
COLLIERS INTERNATIONAL GRP INC	16,476	149.29	2,459,702.04		
カナダ・ドル	小計	1,220,625		31,042,025.91 (3,362,472,247)	
スイス・フラン	UBS GROUP AG	44,350	25.31	1,122,498.50	

スイス・フラン	小計	44,350		1,122,498.50 (190,970,669)	
メキシコ・ペソ	GCC SAB DE CV	155,114	191.20	29,657,796.80	
メキシコ・ペソ	小計	155,114		29,657,796.80 (255,424,809)	
ユーロ	VALLOUREC SA	106,915	13.13	1,404,328.52	
	TENARIS SA (ITALY)	88,479	14.72	1,302,853.27	
	CIE AUTOMOTIVE SA	28,817	24.40	703,134.80	
	OCI NV	43,769	24.98	1,093,349.62	
	CELLNEX TELECOM SAU	43,426	35.82	1,555,519.32	
	GALAPAGOS GENOMICS AV	34,923	36.08	1,260,021.84	
	DHL GROUP	13,244	45.18	598,363.92	
ユーロ	小計	359,573		7,917,571.29 (1,259,052,186)	
合計		13,237,831		54,672,208,360 (54,499,162,760)	

(イ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	CAMDEN PROPERTY TRUST - REIT	25,303.00	2,510,563.66	
		CUBESMART	29,424.00	1,331,436.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,884.00	2,212,826.72	
		LAMAR ADVERTISING CO CL A	13,153.00	1,399,742.26	
		OUTFRONT MEDIA INC	156,402.00	2,220,908.40	
		PROLOGIS INC	20,331.00	2,674,543.05	
		SUN COMMUNITIES INC	7,973.00	1,073,883.37	
		VENTAS INC	73,670.00	3,617,933.70	
	WELLTOWER INC	42,644.00	3,920,262.92		
	アメリカ・ドル	小計	377,784.00	20,962,100.08 (3,043,068,068)	
投資証券	合計			3,043,068,068 (3,043,068,068)	
合計				3,043,068,068 (3,043,068,068)	

(注) 投資証券における券面総額の数値は証券数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
香港・ドル	株式 1銘柄	100%	-%	0.38%

アメリカ・ドル	株式 投資証券	175銘柄 9銘柄	94.12% -%	-% 5.88%	89.99%
イギリス・ポンド	株式	4銘柄	100%	-%	0.82%
カナダ・ドル	株式	14銘柄	100%	-%	5.84%
スイス・フラン	株式	1銘柄	100%	-%	0.33%
メキシコ・ペソ	株式	1銘柄	100%	-%	0.44%
ユーロ	株式	7銘柄	100%	-%	2.19%

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

Aコース

(2024年2月29日現在)

種 類	金 額	単 位
資産総額	3,342,568,575	円
負債総額	46,645,869	円
純資産総額（ - ）	3,295,922,706	円
発行済数量	3,149,980,072	口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0463	円

Bコース

(2024年2月29日現在)

種 類	金 額	単 位
資産総額	43,038,487,843	円
負債総額	159,350,775	円
純資産総額（ - ）	42,879,137,068	円
発行済数量	27,205,037,354	口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.5761	円

Cコース

(2024年2月29日現在)

種 類	金 額	単 位
資産総額	471,367,529	円
負債総額	4,769,177	円
純資産総額（ - ）	466,598,352	円
発行済数量	455,499,535	口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0244	円

Dコース

(2024年2月29日現在)

種 類	金 額	単 位
資産総額	13,263,208,855	円
負債総額	20,655,167	円
純資産総額（ - ）	13,242,553,688	円
発行済数量	11,232,524,501	口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.1789	円

(参考) マザーファンドの純資産額計算書
フィデリティ世界バリューストックマザーファンド

(2024年2月29日現在)

種 類	金 額	単 位
資産総額	60,402,303,881	円
負債総額	124,248,971	円
純資産総額（ - ）	60,278,054,910	円
発行済数量	36,712,401,100	口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.6419	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（2023年8月末日現在）

（略）

< 訂正後 >

(1) 資本金等（2024年2月末日現在）

（略）

2【事業の内容及び営業の概況】

< 訂正前 >

（略）

2023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182本、単位型株式投資信託4本、親投資信託46本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額4,911,570,583,504円です。

< 訂正後 >

（略）

2024年2月29日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、追加型株式投資信託192本、単位型株式投資信託2本、親投資信託52本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額5,566,301,091,631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38期事業年度(2023年1月1日から2023年12月31日まで)の財務諸表について、PwC Japan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心じて、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37期 (2022年12月31日)	第38期 (2023年12月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	3,022,979	2,269,485
立替金	62,774	59,949
前払費用	355,433	460,082
未収委託者報酬	7,302,518	9,026,865
未収運用受託報酬	1,270,509	5,354,461
未収収益	6,568	5,845
未収入金	* 1 279,442	152,986
流動資産計	12,300,226	17,329,675
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 5,754,864	5,953,460
長期差入保証金	11,755	11,755
繰延税金資産	371,268	288,014
その他	230	230
投資その他の資産合計	6,138,118	6,253,460
固定資産計	6,145,605	6,260,947
資産合計	18,445,832	23,590,622
負債の部		
流動負債		
預り金	158	7
未払金		
未払手数料	3,386,058	4,192,323
その他未払金	* 1 3,949,135	2,192,059
未払費用	1,205,608	3,445,819
未払法人税等	256,966	1,616,600
未払消費税等	678,471	1,176,325
賞与引当金	755,779	376,001
流動負債合計	10,232,176	12,999,137
固定負債		
長期賞与引当金	8,295	-
退職給付引当金	1,907,940	2,028,331
固定負債合計	1,916,235	2,028,331
負債合計	12,148,412	15,027,469
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	5,047,420	7,313,153
利益剰余金合計	5,297,420	7,563,153
株主資本合計	6,297,420	8,563,153
純資産合計	6,297,420	8,563,153
負債・純資産合計	18,445,832	23,590,622

（２）【損益計算書】

	(単位：千円)	
	第37期 (自 2022年1月1日 至 2022年12月31日)	第38期 (自 2023年1月1日 至 2023年12月31日)
営業収益		
委託者報酬	48,219,377	55,200,925
運用受託報酬	7,978,913	10,031,924
その他営業収益	196,056	153,966
営業収益計	56,394,346	65,386,816
営業費用	* 1	
支払手数料	21,912,619	25,160,937
広告宣伝費	270,363	282,742
調査費		
調査費	563,944	551,589
委託調査費	13,400,947	15,194,030
営業雑経費		
通信費	78,488	139,609
印刷費	55,842	47,328
協会費	22,224	27,212
その他	1,512	2,007
営業費用計	36,305,942	41,405,457
一般管理費		
給料		
給料・手当	2,641,460	2,762,834
賞与	1,673,842	1,333,847
福利厚生費	525,602	575,347
交際費	13,087	17,945
旅費交通費	70,519	108,866
租税公課	162,863	205,434
弁護士報酬	2,415	2,569
不動産賃貸料・共益費	412,937	427,958
退職給付費用	208,922	272,377
消耗器具備品費	3,219	17,110
事務委託費	6,759,389	7,249,585
諸経費	303,872	288,510
一般管理費計	12,778,130	13,262,388
営業利益	7,310,273	10,718,971
営業外収益		
受取利息	* 1	16,559
保険配当金	9,662	10,648
雑益	3,309	108
営業外収益計	29,116	27,315
営業外費用		
寄付金	2,930	1,500
為替差損	233,624	112,525
雑損	109	306
営業外費用計	236,664	114,331
経常利益	7,102,725	10,631,955
特別利益		
特別退職金戻入額	17,315	-
特別利益計	17,315	-
特別損失		
特別退職金	4,125	52,541
事務過誤損失	105	-
特別損失計	4,230	52,541
税引前当期純利益	7,115,810	10,579,414
法人税、住民税及び事業税	2,220,713	3,230,427
法人税等調整額	(152,321)	83,253
法人税等合計	2,068,392	3,313,680
当期純利益	5,047,418	7,265,733

（３）【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

(単位：千円)

	株主資本				株主資本合計	純資産合計
	資本金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
		利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金			
当期首残高	1,000,000	250,000	3,231,341	3,481,341	4,481,341	4,481,341
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	(3,231,340)	(3,231,340)	(3,231,340)	(3,231,340)
当期純利益	-	-	5,047,418	5,047,418	5,047,418	5,047,418
当期変動額合計	-	-	1,816,078	1,816,078	1,816,078	1,816,078
当期末残高	1,000,000	250,000	5,047,420	5,297,420	6,297,420	6,297,420

第38期（自 2023年1月1日 至 2023年12月31日）

(単位：千円)

	株主資本				株主資本合計	純資産合計
	資本金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
		利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金			
当期首残高	1,000,000	250,000	5,047,420	5,297,420	6,297,420	6,297,420
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	(5,000,000)	(5,000,000)	(5,000,000)	(5,000,000)
当期純利益	-	-	7,265,733	7,265,733	7,265,733	7,265,733
当期変動額合計	-	-	2,265,733	2,265,733	2,265,733	2,265,733
当期末残高	1,000,000	250,000	7,313,153	7,563,153	8,563,153	8,563,153

注記事項

(重要な会計方針)

1. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

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

2. 収益及び費用の計上基準

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

これらには実績報酬が含まれる場合があります。

(1) 運用報酬

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

(2) 実績報酬

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

3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 重要な外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算の基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理していません。

(2) グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(重要な会計上の見積り)

第37期(自 2022年1月1日 至 2022年12月31日)

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

第38期(自 2023年1月1日 至 2023年12月31日)

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

(会計方針の変更)

該当事項はありません。

(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37期 (2022年12月31日)	第38期 (2023年12月31日)
未収入金	2,693 千円	4,375 千円
その他未払金	3,683,257 千円	1,487,550 千円
長期貸付金	5,553,660 千円	5,943,660 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37期 (自 2022年1月1日 至 2022年12月31日)	第38期 (自 2023年1月1日 至 2023年12月31日)
営業費用	17,246,408 千円	19,338,423 千円
受取利息	8,825 千円	12,877 千円

(株主資本等変動計算書関係)

第37期 (自 2022年1月1日 至 2022年12月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

金銭による配当

該当事項はありません。

金銭以外による配当

2022年12月13日の取締役会において、次のとおり決議しております。

- (1) 配当財産の種類 長期貸付金
(2) 配当財産の帳簿価格 3,231,340 千円
(3) 1株当たりの配当額 161 千円
(4) 基準日 2022年12月13日
(5) 効力発生日 2022年12月13日

第38期 (自 2023年1月1日 至 2023年12月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

金銭による配当

該当事項はありません。

金銭以外による配当

2023年12月12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 5,000,000 千円
(3) 1株当たりの配当額 250 千円
(4) 基準日 2023年12月12日
(5) 効力発生日 2023年12月12日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年12月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第37期（2022年12月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 長期貸付金	5,754,864	5,754,864	-
資産計	5,754,864	5,754,864	-

(注1) 資産

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収収益、未収入金

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

負債

未払手数料、その他未払金、未払費用、未払法人税等、未払消費税等

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

(注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

金銭債権のうち長期貸付金(5,754,864千円)については、契約上返済期限の定めがないため、記載を省略しております。

2023年12月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第38期（2023年12月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 長期貸付金	5,953,460	5,953,460	-
資産計	5,953,460	5,953,460	-

(注1) 資産

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収収益、未収入金

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

負債

未払手数料、その他未払金、未払費用、未払法人税等、未払消費税等

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

(注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

金銭債権のうち長期貸付金(5,953,460千円)については、契約上返済期限の定めがないため、記載を省略しております。

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

第37期（2022年12月31日）

(1)時価で貸借対照表に計上している金融商品

該当事項はありません。

(2)時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

区分	時価			
	レベル1 (千円)	レベル2 (千円)	レベル3 (千円)	合計 (千円)
(1) 長期貸付金	-	5,754,864	-	5,754,864
資産計	-	5,754,864	-	5,754,864

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1) 長期貸付金

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

第38期（2023年12月31日）

(1)時価で貸借対照表に計上している金融商品

該当事項はありません。

(2)時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

区分	時価			
	レベル1 (千円)	レベル2 (千円)	レベル3 (千円)	合計 (千円)
(1) 長期貸付金	-	5,953,460	-	5,953,460
資産計	-	5,953,460	-	5,953,460

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1) 長期貸付金

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

(退職給付関係)

第37期（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は確定給付型年金制度及び確定拠出型年金制度を採用しております。

2. 確定給付型年金制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(千円)
退職給付債務の期首残高	1,995,588
勤務費用	174,611
利息費用	10,753
数理計算上の差異の発生額	45,265
退職給付の支払額	228,588
退職給付債務の期末残高	1,907,099

(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	1,907,099
未認識過去勤務費用	841
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,907,940

退職給付引当金	1,907,940
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,907,940

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	150,582
利息費用	9,273
数理計算上の差異の費用処理額	45,265
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	112,715

(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 1.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は96,206千円であります。

第38期（自 2023年1月1日 至 2023年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は確定給付型年金制度及び確定拠出型年金制度を採用しております。

2. 確定給付型年金制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	（千円）
退職給付債務の期首残高	1,907,099
勤務費用	178,071
利息費用	24,955
数理計算上の差異の発生額	5,376
退職給付の支払額	76,418
退職給付債務の期末残高	2,028,331

(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	2,028,331
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,028,331
退職給付引当金	2,028,331
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,028,331

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	（千円）
勤務費用	157,671
利息費用	22,096
数理計算上の差異の費用処理額	5,376
過去勤務債務の費用処理額	841
確定給付型年金制度に係る退職給付費用	173,550

(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 1.7%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は98,827千円であります。

(税効果会計関係)

1. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

2. 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37期 (2022年12月31日)	第38期 (2023年12月31日)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払費用	91,806	89,646
賞与引当金	231,419	115,131
退職給付引当金	584,211	621,075
資産除去債務	1,644	1,644
その他	87,153	125,470
繰延税金資産小計	996,233	952,966
評価性引当額	624,965	664,952
繰延税金資産合計	371,268	288,014
繰延税金資産又は繰延税金負債()の純額	371,268	288,014

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37期 (2022年12月31日)	第38期 (2023年12月31日)
法定実効税率	30.62%	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.38%	0.33%
評価性引当額	2.19%	2.62%
過年度法人税等	0.23%	2.25%
その他	0.02%	0.01%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.07%	31.32%

(資産除去債務関係)

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

(収益認識関係)

第37期（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

(単位:千円)

	運用報酬	実績報酬	合計
委託者報酬	48,219,377	-	48,219,377
運用受託報酬	3,116,449	4,862,463	7,978,913
その他営業収益	196,056	-	196,056
合計	51,531,882	4,862,463	56,394,346

第38期（自 2023年1月1日 至 2023年12月31日）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

(単位:千円)

	運用報酬	実績報酬	合計
委託者報酬	55,200,925	-	55,200,925
運用受託報酬	3,047,735	6,984,189	10,031,924
その他営業収益	153,966	-	153,966
合計	58,402,627	6,984,189	65,386,816

2. 収益を理解するための基礎となる情報

第37期（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）及び 第38期（自 2023年1月1日 至 2023年12月31日）

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

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

第37期（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

顧客との契約から生じた債権等

(単位:千円)

	期首残高	期末残高
顧客との契約から生じた債権	7,035,957	8,573,027

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

第38期（自 2023年1月1日 至 2023年12月31日）

顧客との契約から生じた債権等

(単位:千円)

	期首残高	期末残高
顧客との契約から生じた債権	8,573,027	14,381,326

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第37期（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）及び 第38期（自 2023年1月1日 至 2023年12月31日）

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第37期（自 2022年1月1日 至 2022年12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	48,219,377	7,978,913	196,056	56,394,346

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

3. 主要な顧客ごとの情報

(1) 委託者報酬

(単位:千円)

投資信託の名称	委託者報酬	関連するセグメント名
フィデリティ・US リート・ファンドB（為替ヘッジなし）	9,173,768	資産運用業
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	7,286,922	資産運用業
フィデリティ・日本成長株・ファンド	6,452,328	資産運用業

(2) 運用受託報酬

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

第38期（自 2023年1月1日 至 2023年12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	55,200,925	10,031,924	153,966	65,386,816

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

3. 主要な顧客ごとの情報

(1) 委託者報酬

(単位:千円)

投資信託の名称	委託者報酬	関連するセグメント名
フィデリティ・US リート・ファンドB（為替ヘッジなし）	8,824,933	資産運用業
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	8,558,231	資産運用業
フィデリティ・世界割安成長株投信 Bコース（為替ヘッジなし）	7,353,735	資産運用業
フィデリティ・日本成長株・ファンド	6,925,937	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37期（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

1. 関連当事者との取引

(1)財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称	会社等の所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
親会社	FIL Limited	英領バミューダ、ペンブローック市	千米ドル 6,825	投資顧問業	被所有間接100%	投資顧問契約の再委任等役員の兼任	委託調査等報酬（注3） 共通発生経費負担額（注4）	千円 - 12,450,274	未収入金 未払金	千円 2,693 767,387
親会社	フィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社	東京都港区	千円 4,510,000	グループ会社経営管理	被所有直接100%	当社事業活動の管理等役員の兼任	金銭の貸付（注1） 利息の受取（注1） 共通発生経費負担額（注4） 連結法人税の個別帰属額 剰余金の配当	千円 2,208,660 8,825 256,643 - 3,231,340	長期貸付金 未収入金 未払金 未払金 未払金	千円 5,553,660 - 46,250 1,788,272 -
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 4,539,490	未払金	千円 1,081,346

(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 11,757,500	証券業	なし	当社設定投資信託の募集・販売	共通発生経費負担額（注4） 投資信託販売に係る代行手数料（注5）	千円 391,995 800,707	未収入金 未払金	千円 52,615 67,683

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38期 (自 2023年1月1日 至 2023年12月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称	会社等の所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
親会社	FIL Limited	英領バミューダ、ペンブローック市	千米ドル 6,825	投資顧問業	被所有間接100%	投資顧問契約の再委任等役員の兼任	委託調査等報酬(注3) 共通発生経費負担額(注4)	千円 - 14,263,790	未収入金 未払金	千円 4,375 900,697
親会社	フィデリティ・ジャパン・ホールディングス株式会社	東京都港区	千円 4,510,000	グループ会社経営管理	被所有直接100%	当社事業活動の管理等役員の兼任	金銭の貸付(注1) 利息の受取(注1) 共通発生経費負担額(注4) グループ通算制度の通算税効果額 剰余金の配当	千円 390,000 12,877 258,088 - 5,000,000	長期貸付金 未収入金 未払金 未払金 未払金	千円 5,943,660 - 47,052 46,398 -
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 4,816,544	未払金	千円 493,401

(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）
			千円					千円		千円
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	12,657,500	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）	357,778	未収入金	115,231
							投資信託販売に係る代行手数料（注5）	813,267	未払金	72,123
							グループ通算制度の通算税効果額	-	未払金	478,598

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

	第37期 (自 2022年1月1日 至 2022年12月31日)	第38期 (自 2023年1月1日 至 2023年12月31日)
1株当たり純資産額	314,871円00銭	428,157円66銭
1株当たり当期純利益	252,370円92銭	363,286円66銭

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

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

項目	第37期 (自 2022年1月1日 至 2022年12月31日)	第38期 (自 2023年1月1日 至 2023年12月31日)
当期純利益(千円)	5,047,418	7,265,733
普通株式に係る当期純利益(千円)	5,047,418	7,265,733
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 (2023年9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स्टディ銀行	51,000百万円	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
	フィデリティ証券株式会社	12,657百万円	
運用の委託先	FIAM LLC	125,250,883米ドル (約17,764百万円 [*]) [*] 1米ドル141.83円で換算 (2023年12月末日現在)	主として米国においてファンドに対する投資顧問業務を営んでいます。

独立監査人の監査報告書

2024年4月9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
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世界バリューストックファンド Aコース（年2回決算・為替ヘッジあり）の2023年7月19日から2024年1月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、フィデリティ世界バリューストックファンド Aコース（年2回決算・為替ヘッジあり）の2024年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2024年4月9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
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世界バリューストックファンド Bコース（年2回決算・為替ヘッジなし）の2023年7月19日から2024年1月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、フィデリティ世界バリューストックファンド Bコース（年2回決算・為替ヘッジなし）の2024年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2024年4月9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
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世界バリューストックファンド Cコース（毎月決算・予想分配金提示型・為替ヘッジあり）の2023年7月19日から2024年1月15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、フィデリティ世界バリューストックファンド Cコース（毎月決算・予想分配金提示型・為替ヘッジあり）の2024年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2024年4月9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
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世界バリューストックファンド Dコース（毎月決算・予想分配金提示型・為替ヘッジなし）の2023年7月19日から2024年1月15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、フィデリティ世界バリューストックファンド Dコース（毎月決算・予想分配金提示型・為替ヘッジなし）の2024年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2024年3月8日

フィデリティ投信株式会社
取締役会御中

PwC Japan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 平山 晃一郎
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2023年1月1日から2023年12月31日までの第38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2023年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。