

【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10月18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 コルビー・ペンゾーン
【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・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き） フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）
【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、2024年4月18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。

第一部【証券情報】

（４）【発行（売出）価格】

<訂正前>

（略）

発行価格の基準となる基準価額につきましては、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞に掲載されます。（日本経済新聞においては、ファンドは、「悠々債券A付」および「悠々債券B無」として略称で掲載されています。）

<訂正後>

（略）

発行価格の基準となる基準価額につきましては、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のナビダイヤル（0570 - 051 - 104（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）固定電話、携帯電話からお問い合わせいただけます。国際電話、一部のIP電話からはご利用いただけません。）または販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞に掲載されます。（日本経済新聞においては、ファンドは、「悠々債券A付」および「悠々債券B無」として略称で掲載されています。）

（５）【申込手数料】

<訂正前>

申込手数料率は3.30%^{*}（税抜 3.00%）を超えないものとします。なお、申込手数料率の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

（略）

<訂正後>

申込手数料率は3.30%^{*}（税抜 3.00%）を超えないものとします。なお、申込手数料率の詳細については、販売会社までお問い合わせください。

（略）

（６）【申込単位】

<訂正前>

（略）

販売会社の申込単位の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

<訂正後>

（略）

販売会社の申込単位の詳細については、販売会社までお問い合わせください。

(8) 【申込取扱場所】

<訂正前>

(略)

販売会社の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））までお問い合わせください。（ただし、販売会社によってはAコース・Bコースどちらか一方のみの取扱いを行なう場合があります。）

<訂正後>

(略)

販売会社の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のナビダイヤル（0570 - 051 - 104（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））固定電話、携帯電話からお問い合わせいただけます。国際電話、一部のIP電話からはご利用いただけません。）までお問い合わせください。（ただし、販売会社によってはAコース・Bコースどちらか一方のみの取扱いを行なう場合があります。）

(10) 【払込取扱場所】

<訂正前>

(略)

販売会社の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））までお問い合わせください。

<訂正後>

(略)

販売会社の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のナビダイヤル（0570 - 051 - 104（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））固定電話、携帯電話からお問い合わせいただけます。国際電話、一部のIP電話からはご利用いただけません。）までお問い合わせください。

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（2024年2月末日現在）

（略）

<訂正後>

（略）

委託会社の概況（2024年8月末日現在）

（略）

2【投資方針】

（1）【投資方針】

<訂正前>

（略）

上記の文中で示された考え方は、2024年2月末日現在のものであり、今後、変更となる場合があります。

<訂正後>

（略）

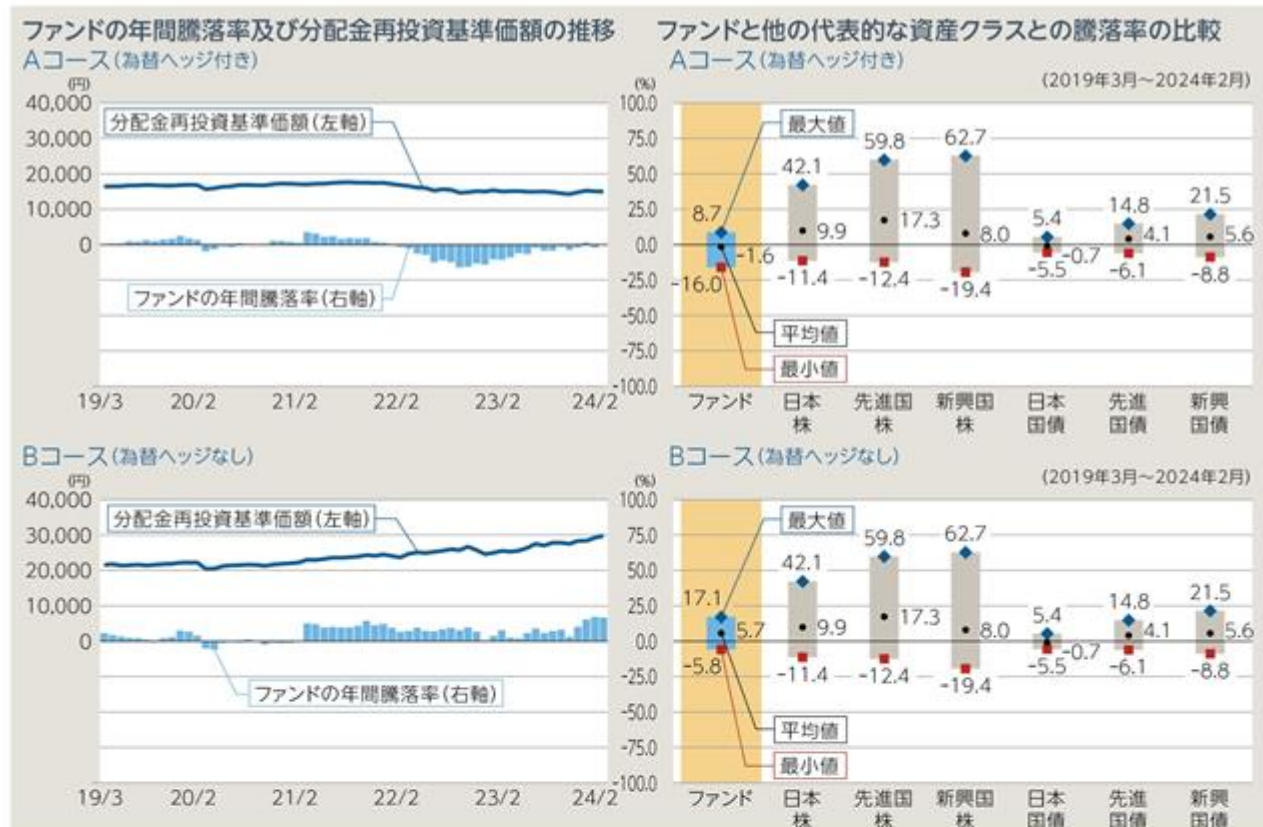
上記の文中で示された考え方は、2024年8月末日現在のものであり、今後、変更となる場合があります。

3【投資リスク】

<訂正前>

（略）

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの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。

※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、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
 ※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
 ※ファンドは税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

代表的な資産クラスの指数

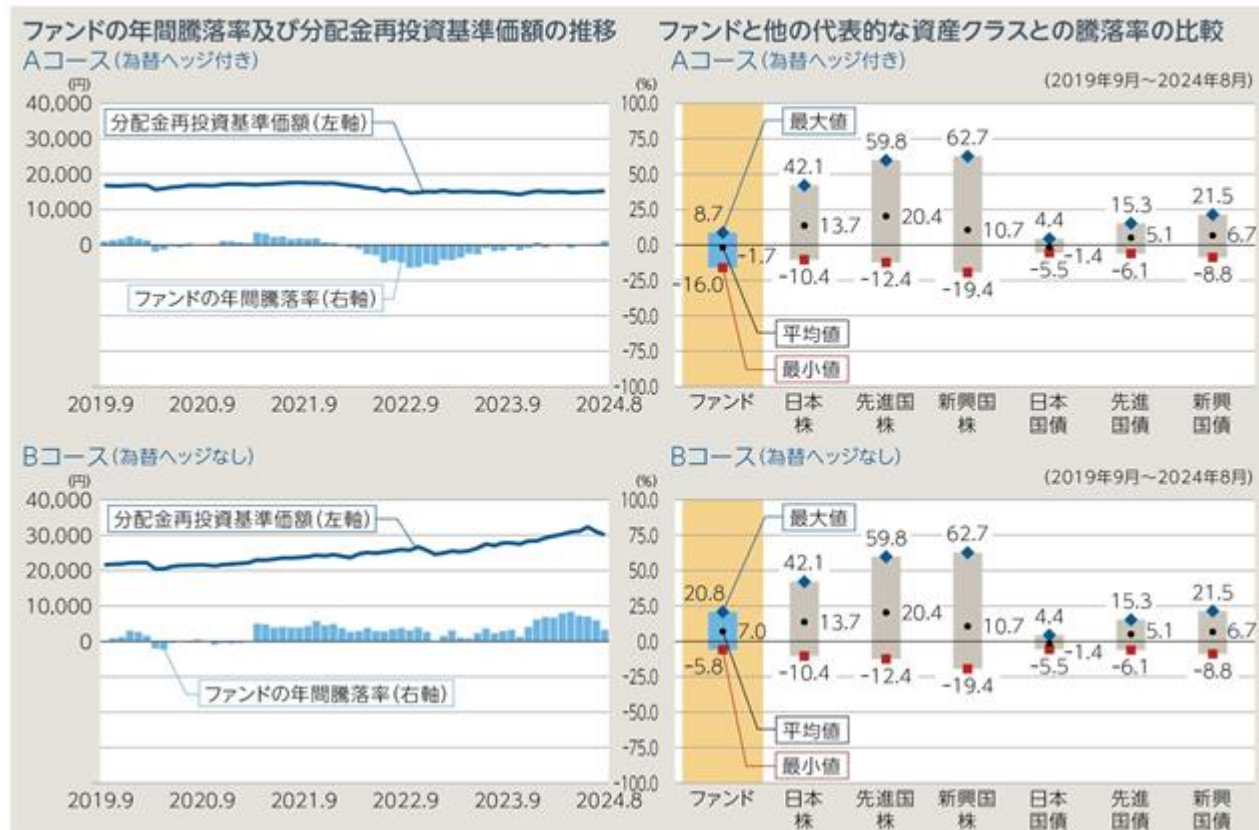
日本株 TOPIX(配当込)	東証株価指数(TOPIX)(以下「TOPIX」という。)の指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
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。

< 訂正後 >

(略)

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2019年9月～2024年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。
 ※「ファンドの年間騰落率」は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率であり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。なお、当騰落率は目盛最大値に比べ値が小さいためにグラフが見えない場合があります。
 ※「分配金再投資基準価額」は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額であり、実際の基準価額と異なる場合があります。

※2019年9月～2024年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
 ※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
 ※ファンドは税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

代表的な資産クラスの指数

日本株 TOPIX(配当込)	東証株価指数 (TOPIX) (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。
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算利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI 国債の知的財産権およびその他一切の権利は野村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・ダイバースィファイド (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】

（１）【申込手数料】

<訂正前>

申込手数料率は3.30%^{*}（税抜 3.00%）を超えないものとします。なお、申込手数料率の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120 - 00 - 8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

（略）

<訂正後>

申込手数料率は3.30%^{*}（税抜 3.00%）を超えないものとします。なお、申込手数料率の詳細については、販売会社までお問い合わせください。

（略）

（４）【その他の手数料等】

<訂正前>

（略）

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。

<訂正後>

（略）

運用・管理にかかる費用の総額について、詳しくは、後掲の「（５）課税上の取扱い」（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）

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、税法が改正された場合等には、内容が変更となる場合があります。

（略）

（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・ストラテジック・ インカム・ファンド Aコース (為替ヘッジ付き)	1.62%	1.57%	0.06%
フィデリティ・ストラテジック・ インカム・ファンド Bコース (為替ヘッジなし)	1.63%	1.57%	0.07%

(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21日～2024年1月22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。

< 訂正後 >

(略)

上記「(5) 課税上の取扱い」の記載は、2024年8月末日現在のものであるので、税法が改正された場合等には、内容が変更となる場合があります。

(略)

(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・ストラテジック・ インカム・ファンド Aコース (為替ヘッジ付き)	1.63%	1.57%	0.06%
フィデリティ・ストラテジック・ インカム・ファンド Bコース (為替ヘッジなし)	1.64%	1.57%	0.06%

(比率は年率、表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間は2024年1月23日～2024年7月22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、購入時手数料、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（為替ヘッジ付き）

（2024年8月30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	18,447,668,775	99.67
預金・その他の資産（負債控除後）	-	60,458,615	0.33
合計（純資産総額）		18,508,127,390	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8月30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	17,857,259,029	96.48

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

Bコース（為替ヘッジなし）

（2024年8月30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	5,030,745,664	100.05
預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,543,516	0.05
合計（純資産総額）		5,028,202,148	100.00

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

(参考) マザーファンドの投資状況

フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

(2024年8月30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	498,149,651	1.33
	ルクセンブルグ	24,243,307	0.06
	小計	522,392,958	1.40
新株予約権証券	イギリス	9,952,969	0.03
	アメリカ	4,092,031	0.01
	小計	14,045,000	0.04
国債証券	アメリカ	9,898,702,476	26.43
	ドイツ	2,790,203,760	7.45
	日本	941,144,652	2.51
	イギリス	941,017,120	2.51
	カナダ	934,747,065	2.50
	トルコ	215,227,962	0.57
	ドミニカ共和国	163,709,910	0.44
	エジプト	152,294,913	0.41
	カタール	151,068,095	0.40
	コロンビア	149,508,534	0.40
	パナマ	141,480,967	0.38
	オマーン	139,056,711	0.37
	ナイジェリア	126,677,911	0.34
	アルゼンチン	109,981,528	0.29
	アンゴラ	93,714,958	0.25
	ウクライナ	91,095,331	0.24
	メキシコ	89,738,511	0.24
	ハンガリー	87,884,492	0.23
	ブラジル	87,719,442	0.23
	インドネシア	87,624,612	0.23
	ルーマニア	77,657,995	0.21
	エクアドル	74,920,773	0.20
	セルビア	69,148,118	0.18
	ペルー	68,446,656	0.18
	アラブ首長国連邦	65,051,690	0.17
	チリ	62,847,501	0.17
	パキスタン	61,001,619	0.16
	南アフリカ	60,349,925	0.16
	コスタリカ	55,412,542	0.15
	スリランカ	54,512,168	0.15
エルサルバドル	54,121,997	0.14	
ヴェネズエラ	48,535,852	0.13	
ガーナ	43,833,270	0.12	
グアテマラ	42,675,022	0.11	

	フィリピン	40,663,243	0.11
	ウルグアイ	39,696,413	0.11
	ケニア	37,066,744	0.10
	コートジボアール	35,231,925	0.09
	ガボン	32,001,683	0.09
	パラグアイ	31,819,626	0.08
	モンテネグロ	29,901,200	0.08
	サウジアラビア	28,089,289	0.08
	ベナン	27,656,800	0.07
	バーレーン	18,662,085	0.05
	ウズベキスタン	17,899,090	0.05
	ヨルダン	17,041,555	0.05
	バミューダ	15,854,695	0.04
	セネガル	15,724,375	0.04
	アルメニア	14,590,975	0.04
	ザンビア	11,954,975	0.03
	レバノン	9,958,620	0.03
	ポーランド	9,595,722	0.03
	タジキスタン	9,138,393	0.02
	小計	18,673,661,486	49.87
特殊債券	アメリカ	1,014,428,511	2.71
	メキシコ	229,471,764	0.61
	ポーランド	60,906,645	0.16
	カタール	53,223,195	0.14
	アラブ首長国連邦	49,175,723	0.13
	南アフリカ	46,338,780	0.12
	ヴェネズエラ	38,624,698	0.10
	アゼルバイジャン	31,627,933	0.08
	オランダ	26,679,400	0.07
	モロッコ	25,913,987	0.07
	チリ	23,129,208	0.06
	インドネシア	15,921,629	0.04
	コロンビア	7,345,052	0.02
	小計	1,622,786,525	4.33
社債券	アメリカ	9,989,934,980	26.68
	カナダ	593,070,068	1.58
	ケイマン諸島	316,592,617	0.85
	イギリス	293,744,204	0.78
	オランダ	248,667,393	0.66
	ルクセンブルグ	246,789,223	0.66
	リベリア	170,202,749	0.45
	フランス	141,211,994	0.38
	バミューダ	137,103,417	0.37
	アイルランド	135,115,045	0.36
	ジャージー	119,040,840	0.32

サウジアラビア	100,594,269	0.27	
オーストラリア	90,348,358	0.24	
マレーシア	86,990,396	0.23	
パナマ	85,198,228	0.23	
チリ	83,933,630	0.22	
メキシコ	77,558,131	0.21	
ブラジル	60,642,496	0.16	
インドネシア	58,266,941	0.16	
イスラエル	35,715,948	0.10	
マーシャル諸島	35,616,514	0.10	
マルタ	34,943,961	0.09	
ドミニカ共和国	30,020,805	0.08	
バーレーン	29,995,320	0.08	
モーリシャス	28,887,600	0.08	
シンガポール	28,757,570	0.08	
スペイン	28,516,550	0.08	
グアテマラ	25,991,600	0.07	
ウクライナ	23,168,000	0.06	
イギリス領バージン 諸島	20,855,544	0.06	
フィンランド	18,375,120	0.05	
パラグアイ	17,992,486	0.05	
南アフリカ	6,756,310	0.02	
ペルー	6,215,106	0.02	
ロシア	5,792,000	0.02	
ナイジェリア	5,479,522	0.01	
小計	13,418,084,935	35.83	
預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,195,550,092	8.53
合計（純資産総額）		37,446,520,996	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8月30日現在)

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
貸付債権	アメリカ	850,030,928	2.26

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

Aコース（為替ヘッジ付き）

(2024年8月30日現在)

順位	種類	銘柄名	国・地域	数量 (口数)	帳簿価 額単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	親投資 信託受 益証券	フィデリティ・スト ラテジック・インカ ム・マザーファンド	日本	4,072,063,390	4.5597	18,567,755,681	4.5303	18,447,668,775	99.67

Bコース（為替ヘッジなし）

(2024年8月30日現在)

順位	種類	銘柄名	国・地域	数量 (口数)	帳簿価 額単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	親投資 信託受 益証券	フィデリティ・スト ラテジック・インカ ム・マザーファンド	日本	1,110,466,341	4.5623	5,066,370,886	4.5303	5,030,745,664	100.05

種類別投資比率

Aコース（為替ヘッジ付き）

(2024年8月30日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.67

Bコース（為替ヘッジなし）

(2024年8月30日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.05

（参考）マザーファンドの投資有価証券の主要銘柄

フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

（2024年8月30日現在）

順位	銘柄名	通貨 地域	種類 業種	数量	簿価単価(円) 簿価金額(円)	評価単価(円) 時価金額(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率 (%)
1	GERMANY GOVT 2.2% 02/15/34 RGS	ユーロ ドイツ	国債証券 -	17,465,000	15,751.03 2,750,918,488	15,975.97 2,790,203,761	2.200 2034/02/15	7.45
2	USTB 2.50% 02/15/45	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	8,976,000	10,463.97 939,246,126	10,965.12 984,229,602	2.500 2045/02/15	2.63
3	UK GILT .875% 07/31/33 RGS	イギリス・ポンド イギリス	国債証券 -	6,406,000	14,515.65 929,873,166	14,689.62 941,017,121	0.875 2033/07/31	2.51
4	USTN .75% 03/31/26	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	4,597,000	13,581.08 624,322,321	13,748.62 632,023,840	0.750 2026/03/31	1.69
5	USTN 3.125% 08/31/29	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	4,384,000	13,780.18 604,123,161	14,089.62 617,688,905	3.125 2029/08/31	1.65
6	455 2年国債	日本・円 日本	国債証券 -	569,400,000	99.72 567,822,042	99.66 567,452,652	0.005 2025/12/01	1.52
7	USTB 4.125% 08/15/53	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	3,479,000	13,681.86 475,991,992	14,355.47 499,426,870	4.125 2053/08/15	1.33
8	USTB 4.75% 2/15/37	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	2,918,000	15,204.00 443,652,720	15,726.00 458,884,796	4.750 2037/02/15	1.23
9	82 30年国債	日本・円 日本	国債証券 -	400,000,000	92.70 370,816,000	93.42 373,692,000	1.800 2054/03/20	1.00
10	CANADA GOVT 1.5% 06/01/31	カナダ・ドル カナダ	国債証券 -	3,830,000	9,520.62 364,640,076	9,725.65 372,492,319	1.500 2031/06/01	0.99
11	CANADA GOVT 2% 12/01/51	カナダ・ドル カナダ	国債証券 -	4,470,000	8,060.80 360,317,967	8,317.45 371,790,219	2.000 2051/12/01	0.99
12	USTN 4.625% 10/15/26	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	2,500,000	14,536.47 363,411,800	14,694.88 367,372,080	4.625 2026/10/15	0.98
13	USTN 0.75% 08/31/26	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	2,570,000	13,408.04 344,586,771	13,603.82 349,618,050	0.750 2026/08/31	0.93
14	USTN 4% 10/31/29	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	2,304,000	14,356.05 330,763,419	14,662.59 337,826,138	4.000 2029/10/31	0.90
15	USTN 4% 01/15/27	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	2,280,000	14,349.82 327,176,005	14,530.82 331,302,805	4.000 2027/01/15	0.88
16	USTN 4.375% 11/30/30	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	2,080,000	14,632.04 304,346,432	14,972.03 311,418,232	4.375 2030/11/30	0.83
17	USTN 4.25% 06/30/31	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	1,350,000	14,588.82 196,949,135	14,900.79 201,160,648	4.250 2031/06/30	0.54
18	USTN 4% 07/31/29	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	1,370,000	14,654.05 200,760,618	14,677.36 201,079,864	4.000 2029/07/31	0.54
19	CANADA GOVT 1.5% 04/01/25	カナダ・ドル カナダ	国債証券 -	1,800,000	10,552.24 189,940,475	10,581.36 190,464,525	1.500 2025/04/01	0.51
20	USTN 3.875% 11/30/29	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	1,300,000	14,268.44 185,489,813	14,582.37 189,570,856	3.875 2029/11/30	0.51
21	USTN 4.625% 06/15/27	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	1,170,000	14,611.18 170,950,908	14,803.48 173,200,753	4.625 2027/06/15	0.46

22	USTN 4.375% 05/15/34	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	1,127,000	14,954.27 168,534,708	15,061.37 169,741,662	4.375 2034/05/15	0.45
23	USTB 4.625% 05/15/44	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	1,070,000	15,219.87 162,852,657	15,188.07 162,512,370	4.625 2044/05/15	0.43
24	UBER TECH INC 4.5% 08/15/29 144A	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	1,105,000	13,944.24 154,083,852	14,210.82 157,029,525	4.500 2029/08/15	0.42
25	USTN 2.375% 04/30/26	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	1,107,000	13,942.06 154,338,692	14,097.00 156,053,834	2.375 2026/04/30	0.42
26	ALLY FINL INC 6.7% 02/14/33	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 -	1,000,000	14,693.72 146,937,248	14,953.21 149,532,064	6.700 2033/02/14	0.40
27	USTN 1.625% 09/30/26	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	1,060,000	13,636.54 144,547,324	13,826.66 146,562,621	1.625 2026/09/30	0.39
28	USTB 3% 02/15/49	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	1,258,000	11,114.99 139,826,609	11,618.46 146,160,256	3.000 2049/02/15	0.39
29	USTN 3.875% 08/15/33	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	1,001,000	14,082.81 140,968,964	14,498.10 145,125,981	3.875 2033/08/15	0.39
30	USTN 4.5% 05/15/27	アメリカ・ドル アメリカ	国債証券 -	980,000	14,548.92 142,579,463	14,736.73 144,419,957	4.500 2027/05/15	0.39

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

（2024年8月30日現在）

種類	国内/外国	業種/種別	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	0.77
		一般消費財・サービス流通・小売り	0.01
		生活必需品流通・小売り	0.23
		金融サービス	0.04
		電気通信サービス	0.12
	公益事業	0.21	
	小計		1.40
新株予約権証券	外国	-	0.04
	小計		0.04
公社債券	国内	国債証券	2.51
	小計		2.51
	外国	国債証券	47.35
		特殊債券	4.33
		社債券	35.83
小計		87.52	
合計（対純資産総額比）			91.47

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

Aコース（為替ヘッジ付き）

（2024年8月30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	カナダ・ドル	売建	4,008,000	427,588,871	428,843,174	2.32
	イギリス・ポンド	売建	2,340,200	443,672,433	444,542,987	2.40
	ユーロ	売建	8,204,900	1,326,373,037	1,312,614,979	7.09
	アメリカ・ドル	売建	108,674,300	15,729,136,393	15,671,257,889	84.67

Bコース（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

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

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

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

(2024年8月30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 (%)
貸付債権	アメリカ・ドル	-	6,327,902.23	847,528,029	850,030,928	2.26

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

（ 3 ）【運用実績】

【純資産の推移】

2024年8月末日および同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次のとおりです。

Aコース（為替ヘッジ付き）

年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり純資産額 (円) (分配落)	1口当たり純資産額 (円) (分配付)
2015年1月20日 (第33特定期間)	179,464	180,451	0.7276	0.7316
2015年7月21日 (第34特定期間)	143,717	144,531	0.7056	0.7096
2016年1月20日 (第35特定期間)	114,103	114,807	0.6487	0.6527
2016年7月20日 (第36特定期間)	100,945	101,537	0.6826	0.6866
2017年1月20日 (第37特定期間)	79,649	80,009	0.6634	0.6664
2017年7月20日 (第38特定期間)	71,081	71,402	0.6625	0.6655
2018年1月22日 (第39特定期間)	62,879	63,072	0.6493	0.6513
2018年7月20日 (第40特定期間)	55,034	55,210	0.6277	0.6297
2019年1月21日 (第41特定期間)	48,511	48,671	0.6067	0.6087
2019年7月22日 (第42特定期間)	45,222	45,369	0.6141	0.6161
2020年1月20日 (第43特定期間)	41,747	41,884	0.6083	0.6103
2020年7月20日 (第44特定期間)	38,536	38,667	0.5885	0.5905
2021年1月20日 (第45特定期間)	36,723	36,846	0.5961	0.5981
2021年7月20日 (第46特定期間)	34,718	34,835	0.5956	0.5976
2022年1月20日 (第47特定期間)	31,681	31,792	0.5721	0.5741
2022年7月20日 (第48特定期間)	26,104	26,209	0.4968	0.4988
2023年1月20日 (第49特定期間)	24,646	24,696	0.4932	0.4942
2023年7月20日 (第50特定期間)	22,365	22,412	0.4758	0.4768

2024年1月22日 (第51特定期間)	20,380	20,423	0.4675	0.4685
2024年7月22日 (第52特定期間)	18,451	18,491	0.4623	0.4633
2023年8月末日	21,673	-	0.4673	-
2023年9月末日	20,954	-	0.4554	-
2023年10月末日	20,171	-	0.4474	-
2023年11月末日	20,648	-	0.4633	-
2023年12月末日	20,879	-	0.4761	-
2024年1月末日	20,295	-	0.4693	-
2024年2月末日	19,913	-	0.4657	-
2024年3月末日	19,787	-	0.4684	-
2024年4月末日	19,093	-	0.4587	-
2024年5月末日	18,825	-	0.4590	-
2024年6月末日	18,603	-	0.4613	-
2024年7月末日	18,460	-	0.4636	-
2024年8月末日	18,508	-	0.4679	-

Bコース（為替ヘッジなし）

年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり純資産額 (円) (分配落)	1口当たり純資産額 (円) (分配付)
2015年1月20日 (第33特定期間)	12,399	12,474	0.8332	0.8382
2015年7月21日 (第34特定期間)	13,115	13,192	0.8483	0.8533
2016年1月20日 (第35特定期間)	11,021	11,096	0.7353	0.7403
2016年7月20日 (第36特定期間)	9,137	9,202	0.7012	0.7062
2017年1月20日 (第37特定期間)	8,678	8,738	0.7345	0.7395
2017年7月20日 (第38特定期間)	8,066	8,123	0.7136	0.7186
2018年1月22日 (第39特定期間)	7,617	7,672	0.6878	0.6928
2018年7月20日 (第40特定期間)	7,146	7,200	0.6602	0.6652
2019年1月21日 (第41特定期間)	6,567	6,621	0.6115	0.6165
2019年7月22日 (第42特定期間)	5,884	5,908	0.6141	0.6166
2020年1月20日 (第43特定期間)	5,471	5,493	0.6246	0.6271
2020年7月20日 (第44特定期間)	5,052	5,073	0.5896	0.5921
2021年1月20日 (第45特定期間)	4,406	4,425	0.5806	0.5831
2021年7月20日 (第46特定期間)	4,216	4,234	0.6080	0.6105
2022年1月20日 (第47特定期間)	4,050	4,067	0.6058	0.6083
2022年7月20日 (第48特定期間)	4,093	4,110	0.6298	0.6323
2023年1月20日 (第49特定期間)	4,141	4,151	0.5979	0.5994
2023年7月20日 (第50特定期間)	4,593	4,604	0.6425	0.6440
2024年1月22日 (第51特定期間)	4,933	4,944	0.6877	0.6892
2024年7月22日 (第52特定期間)	5,419	5,430	0.7420	0.7435
2023年8月末日	4,699	-	0.6620	-
2023年9月末日	4,728	-	0.6606	-

2023年10月末日	4,676	-	0.6519	-
2023年11月末日	4,826	-	0.6700	-
2023年12月末日	4,806	-	0.6694	-
2024年1月末日	4,966	-	0.6879	-
2024年2月末日	5,041	-	0.6994	-
2024年3月末日	5,213	-	0.7095	-
2024年4月末日	5,266	-	0.7228	-
2024年5月末日	5,445	-	0.7266	-
2024年6月末日	5,542	-	0.7523	-
2024年7月末日	5,249	-	0.7210	-
2024年8月末日	5,028	-	0.6979	-

【分配の推移】

Aコース(為替ヘッジ付き)

期	1口当たりの分配金(円)
第33特定期間(188期～193期計算期間合計)	0.0240
第34特定期間(194期～199期計算期間合計)	0.0240
第35特定期間(200期～205期計算期間合計)	0.0240
第36特定期間(206期～211期計算期間合計)	0.0240
第37特定期間(212期～217期計算期間合計)	0.0210
第38特定期間(218期～223期計算期間合計)	0.0180
第39特定期間(224期～229期計算期間合計)	0.0140
第40特定期間(230期～235期計算期間合計)	0.0120
第41特定期間(236期～241期計算期間合計)	0.0120
第42特定期間(242期～247期計算期間合計)	0.0120
第43特定期間(248期～253期計算期間合計)	0.0120
第44特定期間(254期～259期計算期間合計)	0.0120
第45特定期間(260期～265期計算期間合計)	0.0120
第46特定期間(266期～271期計算期間合計)	0.0120
第47特定期間(272期～277期計算期間合計)	0.0120
第48特定期間(278期～283期計算期間合計)	0.0120
第49特定期間(284期～289期計算期間合計)	0.0080
第50特定期間(290期～295期計算期間合計)	0.0060
第51特定期間(296期～301期計算期間合計)	0.0060
第52特定期間(302期～307期計算期間合計)	0.0060

Bコース(為替ヘッジなし)

期	1口当たりの分配金(円)
第33特定期間(188期~193期計算期間合計)	0.0270
第34特定期間(194期~199期計算期間合計)	0.0300
第35特定期間(200期~205期計算期間合計)	0.0300
第36特定期間(206期~211期計算期間合計)	0.0300
第37特定期間(212期~217期計算期間合計)	0.0300
第38特定期間(218期~223期計算期間合計)	0.0300
第39特定期間(224期~229期計算期間合計)	0.0300
第40特定期間(230期~235期計算期間合計)	0.0300
第41特定期間(236期~241期計算期間合計)	0.0300
第42特定期間(242期~247期計算期間合計)	0.0150
第43特定期間(248期~253期計算期間合計)	0.0150
第44特定期間(254期~259期計算期間合計)	0.0150
第45特定期間(260期~265期計算期間合計)	0.0150
第46特定期間(266期~271期計算期間合計)	0.0150
第47特定期間(272期~277期計算期間合計)	0.0150
第48特定期間(278期~283期計算期間合計)	0.0150
第49特定期間(284期~289期計算期間合計)	0.0110
第50特定期間(290期~295期計算期間合計)	0.0090
第51特定期間(296期~301期計算期間合計)	0.0090
第52特定期間(302期~307期計算期間合計)	0.0090

【収益率の推移】

Aコース（為替ヘッジ付き）

期	収益率(%)
第33特定期間（188期～193期計算期間合計）	0.9
第34特定期間（194期～199期計算期間合計）	0.3
第35特定期間（200期～205期計算期間合計）	4.7
第36特定期間（206期～211期計算期間合計）	8.9
第37特定期間（212期～217期計算期間合計）	0.3
第38特定期間（218期～223期計算期間合計）	2.6
第39特定期間（224期～229期計算期間合計）	0.1
第40特定期間（230期～235期計算期間合計）	1.5
第41特定期間（236期～241期計算期間合計）	1.4
第42特定期間（242期～247期計算期間合計）	3.2
第43特定期間（248期～253期計算期間合計）	1.0
第44特定期間（254期～259期計算期間合計）	1.3
第45特定期間（260期～265期計算期間合計）	3.3
第46特定期間（266期～271期計算期間合計）	1.9
第47特定期間（272期～277期計算期間合計）	1.9
第48特定期間（278期～283期計算期間合計）	11.1
第49特定期間（284期～289期計算期間合計）	0.9
第50特定期間（290期～295期計算期間合計）	2.3
第51特定期間（296期～301期計算期間合計）	0.5
第52特定期間（302期～307期計算期間合計）	0.2

Bコース（為替ヘッジなし）

期	収益率(%)
第33特定期間（188期～193期計算期間合計）	13.5
第34特定期間（194期～199期計算期間合計）	5.4
第35特定期間（200期～205期計算期間合計）	9.8
第36特定期間（206期～211期計算期間合計）	0.6
第37特定期間（212期～217期計算期間合計）	9.0
第38特定期間（218期～223期計算期間合計）	1.2
第39特定期間（224期～229期計算期間合計）	0.6
第40特定期間（230期～235期計算期間合計）	0.3
第41特定期間（236期～241期計算期間合計）	2.8
第42特定期間（242期～247期計算期間合計）	2.9
第43特定期間（248期～253期計算期間合計）	4.2
第44特定期間（254期～259期計算期間合計）	3.2
第45特定期間（260期～265期計算期間合計）	1.0
第46特定期間（266期～271期計算期間合計）	7.3
第47特定期間（272期～277期計算期間合計）	2.1
第48特定期間（278期～283期計算期間合計）	6.4
第49特定期間（284期～289期計算期間合計）	3.3
第50特定期間（290期～295期計算期間合計）	9.0
第51特定期間（296期～301期計算期間合計）	8.4
第52特定期間（302期～307期計算期間合計）	9.2

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

（４）【設定及び解約の実績】

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

Aコース（為替ヘッジ付き）

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第33特定期間 (2014年7月23日～2015年1月20日)	3,499,306,575	49,916,272,734	246,642,380,777
第34特定期間 (2015年1月21日～2015年7月21日)	3,596,247,688	46,561,253,127	203,677,375,338
第35特定期間 (2015年7月22日～2016年1月20日)	2,226,982,240	29,997,608,732	175,906,748,846
第36特定期間 (2016年1月21日～2016年7月20日)	2,455,253,194	30,468,076,524	147,893,925,516
第37特定期間 (2016年7月21日～2017年1月20日)	4,724,528,557	32,556,241,247	120,062,212,826
第38特定期間 (2017年1月21日～2017年7月20日)	1,990,275,525	14,764,073,453	107,288,414,898
第39特定期間 (2017年7月21日～2018年1月22日)	1,684,150,435	12,137,892,490	96,834,672,843
第40特定期間 (2018年1月23日～2018年7月20日)	1,085,851,077	10,244,484,814	87,676,039,106
第41特定期間 (2018年7月21日～2019年1月21日)	789,852,203	8,499,456,125	79,966,435,184
第42特定期間 (2019年1月22日～2019年7月22日)	1,332,638,391	7,657,553,042	73,641,520,533
第43特定期間 (2019年7月23日～2020年1月20日)	1,097,240,529	6,110,360,440	68,628,400,622
第44特定期間 (2020年1月21日～2020年7月20日)	1,163,406,908	4,313,273,856	65,478,533,674
第45特定期間 (2020年7月21日～2021年1月20日)	833,871,090	4,704,450,792	61,607,953,972
第46特定期間 (2021年1月21日～2021年7月20日)	1,288,274,199	4,600,098,344	58,296,129,827
第47特定期間 (2021年7月21日～2022年1月20日)	1,464,514,208	4,378,834,989	55,381,809,046
第48特定期間 (2022年1月21日～2022年7月20日)	1,165,448,834	4,002,142,330	52,545,115,550
第49特定期間 (2022年7月21日～2023年1月20日)	1,146,702,402	3,715,468,815	49,976,349,137
第50特定期間 (2023年1月21日～2023年7月20日)	1,021,711,502	3,994,587,860	47,003,472,779
第51特定期間 (2023年7月21日～2024年1月22日)	963,041,345	4,377,130,108	43,589,384,016
第52特定期間 (2024年1月23日～2024年7月22日)	1,213,603,369	4,888,943,875	39,914,043,510

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

Bコース（為替ヘッジなし）

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第33特定期間 (2014年7月23日～2015年1月20日)	4,095,213,340	3,535,550,986	14,881,598,914
第34特定期間 (2015年1月21日～2015年7月21日)	3,291,320,164	2,712,129,314	15,460,789,764
第35特定期間 (2015年7月22日～2016年1月20日)	1,895,711,296	2,367,878,050	14,988,623,010
第36特定期間 (2016年1月21日～2016年7月20日)	637,630,281	2,594,815,506	13,031,437,785
第37特定期間 (2016年7月21日～2017年1月20日)	1,066,001,308	2,281,243,506	11,816,195,587
第38特定期間 (2017年1月21日～2017年7月20日)	1,058,355,864	1,571,046,562	11,303,504,889
第39特定期間 (2017年7月21日～2018年1月22日)	1,051,981,323	1,280,119,063	11,075,367,149
第40特定期間 (2018年1月23日～2018年7月20日)	997,351,639	1,247,612,287	10,825,106,501
第41特定期間 (2018年7月21日～2019年1月21日)	993,886,135	1,079,069,207	10,739,923,429
第42特定期間 (2019年1月22日～2019年7月22日)	384,781,851	1,542,623,573	9,582,081,707
第43特定期間 (2019年7月23日～2020年1月20日)	784,142,062	1,606,285,069	8,759,938,700
第44特定期間 (2020年1月21日～2020年7月20日)	648,314,837	838,162,736	8,570,090,801
第45特定期間 (2020年7月21日～2021年1月20日)	199,208,176	1,181,015,738	7,588,283,239
第46特定期間 (2021年1月21日～2021年7月20日)	595,389,382	1,248,197,041	6,935,475,580
第47特定期間 (2021年7月21日～2022年1月20日)	343,456,461	592,738,820	6,686,193,221
第48特定期間 (2022年1月21日～2022年7月20日)	376,310,380	562,243,755	6,500,259,846
第49特定期間 (2022年7月21日～2023年1月20日)	772,233,520	346,265,407	6,926,227,959
第50特定期間 (2023年1月21日～2023年7月20日)	689,701,090	466,327,852	7,149,601,197
第51特定期間 (2023年7月21日～2024年1月22日)	500,962,936	477,132,053	7,173,432,080
第52特定期間 (2024年1月23日～2024年7月22日)	982,066,743	851,725,611	7,303,773,212

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

< 参考情報 >

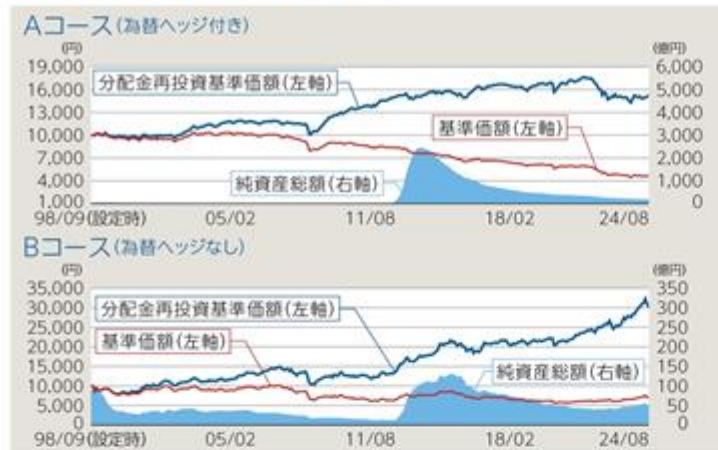
(2024年8月30日現在)

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

※下記データは過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

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

基準価額・純資産の推移



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

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

	Aコース (為替ヘッジ付き)	Bコース (為替ヘッジなし)
基準価額	4,679円	6,979円
純資産総額	185.1億円	50.3億円

分配の推移

(1万円当たり/税引前)

決算期	分配金	
	Aコース (為替ヘッジ付き)	Bコース (為替ヘッジなし)
2024年 4月	10円	15円
2024年 5月	10円	15円
2024年 6月	10円	15円
2024年 7月	10円	15円
2024年 8月	10円	15円
直近1年間累計	120円	180円
設定来累計	9,270円	11,085円

主要な資産の状況(マザーファンド)

資産別組入状況	組入上位10銘柄				
債券等 91.8%	銘柄	クーポン	償還日	格付	比率
転換社債 0.5%	1 ドイツ国債	2.2%	2034/2/15	AAA/Aaa	7.5%
株式 1.4%	2 米国国債	2.5%	2045/2/15	AA/Aa	2.6%
新株予約権証券(ワラント) 0.0%	3 英国国債	0.875%	2033/7/31	AA/Aa	2.5%
現金・その他 6.3%	4 米国国債	0.75%	2026/3/31	AA/Aa	1.7%
	5 米国国債	3.125%	2029/8/31	AA/Aa	1.6%
	6 第455回 2年国債	0.005%	2025/12/1	A	1.5%
	7 米国国債	4.125%	2053/8/15	AA/Aa	1.3%
	8 米国国債	4.75%	2037/2/15	AA/Aa	1.2%
	9 第82回 30年国債	1.8%	2054/3/20	A	1.0%
	10 カナダ国債	1.5%	2031/6/1	AAA/Aaa	1.0%

国・地域別組入状況	格付別組入状況(対投資債券比率)	通貨別組入状況(対投資資産比率)	組入債券種別内訳(対投資資産比率)
アメリカ 59.3%	AAA/Aaa 11.5%	アメリカドル 84.0%	米国国債・政府機関債 31.2%
ドイツ 7.5%	AA/Aa 33.4%	ユーロ 7.9%	ハイ・イールド債券 37.7%
カナダ 4.1%	A 4.1%	日本・円 2.7%	先進国債券(除く米国) 16.0%
イギリス 3.3%	BBB/Baa 6.2%	イギリス・ポンド 2.7%	エマージング債券 15.1%
日本 2.5%	BB/Ba 19.6%	カナダ・ドル 2.7%	
メキシコ 1.1%	B 15.7%		
ケイマン諸島(英領) 0.8%	CCC/Caa 4.9%		
オランダ 0.8%	CC/Ca以下 1.2%		
ルクセンブルグ 0.8%	格付なし 3.5%		
その他 13.6%			

※別途記載がない限り、主要な資産の状況は対純資産総額比率です。

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

※債券等には、金銭債権が含まれます。

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

※クーポンは、銘柄属性として発行時に定められたものを表示しております。

※格付は、S&P社もしくはムーディーズ社による格付を採用し、S&P社の格付を優先して採用しています。〔プラス/マイナス〕の符号は省略しています。なお、

同社による格付のない場合は、「格付なし」に分類しています。

※国・地域は発行国・地域を表示しています。

年間収益率の推移



※Aコース(為替ヘッジ付き)は、ベンチマークを設定しておりません。

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

※2024年は年初以降8月末までの実績となります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

ファンドの取得申込みは、申込期間における販売会社の営業日において行なわれます。ただし、ニューヨーク証券取引所の休業日と同日にはお申込みの受付は行ないません。取得申込みの受付は、原則として午後3時まで取得申込みが行なわれ、かつ当該取得申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分として取扱います。ただし、受付時間は販売会社によって異なることもありますので、ご注意ください。これらの受付時間を過ぎてからの取得申込みは翌営業日の取扱いとなります。

（略）

販売会社の申込手数料率および申込単位の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120-00-8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

（略）

<訂正後>

ファンドの取得申込みは、申込期間における販売会社の営業日において行なわれます。ただし、ニューヨーク証券取引所の休業日と同日にはお申込みの受付は行ないません。取得申込みの受付は、原則として午後3時まで^{（注）}取得申込みが行なわれ、かつ当該取得申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分として取扱います。なお、販売会社によっては受付時間が異なる場合がありますので、詳細は販売会社にご確認ください。これらの受付時間を過ぎてからの取得申込みは翌営業日の取扱いとなります。

（注）2024年11月5日以降は、「午後3時30分まで」となる予定です。

（略）

販売会社の申込手数料率および申込単位の詳細については、販売会社までお問い合わせください。

（略）

2【換金（解約）手続等】

<訂正前>

（略）

受益者は、自己に帰属する受益権につき、販売会社の営業日に一部解約の実行を請求することができます。ただし、ニューヨーク証券取引所の休業日と同日には解約の受付は行ないません。一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時まで一部解約の実行の請求が行なわれ、かつ当該請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分として取扱います。ただし、受付時間は販売会社によって異なることもありますので、ご注意ください。これらの受付時間を過ぎてからの一部解約の実行の請求は翌営業日の取扱いとなります。

（略）

解約価額および販売会社の解約単位の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のフリーコール（0120-00-8051（受付時間：営業日の午前9時～午後5時））または販売会社までお問い合わせください。

（略）

<訂正後>

（略）

受益者は、自己に帰属する受益権につき、販売会社の営業日に一部解約の実行を請求することができます。ただし、ニューヨーク証券取引所の休業日と同日には解約の受付は行ないません。一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時まで^{（注）}一部解約の実行の請求が行なわれ、かつ当該請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分として取扱います。なお、販売会社によっては受付時間が異なる場合がありますので、詳細は販売会社にご確認ください。これらの受付時間を過ぎてからの一部解約の実行の請求は翌営業日の取扱いとなります。

（注）2024年11月5日以降は、「午後3時30分まで」となる予定です。

（略）

解約価額および販売会社の解約単位の詳細については、委託会社のホームページ（アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のナビダイヤル（0570-051-104（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）固定電話、携帯電話からお問い合わせいただけます。国際電話、一部のIP電話からはご利用いただけません。）または販売会社までお問い合わせください。

（略）

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<訂正前>

(略)

基準価額は毎営業日計算され、委託会社のホームページ(アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>)をご参照いただくか、委託会社のフリーコール(0120-00-8051(受付時間：営業日の午前9時～午後5時))または販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞に掲載されます。(日本経済新聞においては、ファンドは、「悠々債券A付」および「悠々債券B無」として略称で掲載されています。)

(略)

<訂正後>

(略)

基準価額は毎営業日計算され、委託会社のホームページ(アドレス：<https://www.fidelity.co.jp/>)をご参照いただくか、委託会社のナビダイヤル(0570-051-104(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)固定電話、携帯電話からお問い合わせいただけます。国際電話、一部のIP電話からはご利用いただけません。)または販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として翌日付の日本経済新聞に掲載されます。(日本経済新聞においては、ファンドは、「悠々債券A付」および「悠々債券B無」として略称で掲載されています。)

(略)

第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第52特定期間（2024年1月23日から2024年7月22日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

1【財務諸表】

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

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第51特定期間 2024年1月22日現在	第52特定期間 2024年7月22日現在
資産の部		
流動資産		
預金	3,898,957	9,471,973
親投資信託受益証券	21,338,603,159	18,494,045,166
派生商品評価勘定	-	639,137
未収入金	110,182,006	96,108,416
流動資産合計	21,452,684,122	18,600,264,692
資産合計		
	21,452,684,122	18,600,264,692
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	951,792,242	39,038,973
未払金	14,431,555	10,008,029
未払収益分配金	43,589,384	39,914,043
未払解約金	28,589,061	29,891,006
未払受託者報酬	1,028,083	896,409
未払委託者報酬	28,375,315	24,741,072
その他未払費用	4,789,794	4,278,309
流動負債合計	1,072,595,434	148,767,841
負債合計		
	1,072,595,434	148,767,841
純資産の部		
元本等		
元本	43,589,384,016	39,914,043,510
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,209,295,328	21,462,546,659
（分配準備積立金）	294,798,642	353,150,323
元本等合計	20,380,088,688	18,451,496,851
純資産合計	20,380,088,688	18,451,496,851
負債純資産合計	21,452,684,122	18,600,264,692

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第51特定期間 自 2023年 7月21日 至 2024年 1月22日	第52特定期間 自 2024年 1月23日 至 2024年 7月22日
営業収益		
受取利息	4	4
有価証券売買等損益	1,909,110,538	1,883,710,013
為替差損益	1,874,935,790	1,700,798,930
営業収益合計	34,174,752	182,911,087
営業費用		
受託者報酬	5,874,013	5,304,007
委託者報酬	162,124,074	146,391,763
その他費用	4,795,734	4,278,309
営業費用合計	172,793,821	155,974,079
営業利益又は営業損失（ ）	138,619,069	26,937,008
経常利益又は経常損失（ ）	138,619,069	26,937,008
当期純利益又は当期純損失（ ）	138,619,069	26,937,008
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	2,109,011	1,854,241
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	24,638,095,278	23,209,295,328
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,353,242,229	2,621,788,703
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,353,242,229	2,621,788,703
剰余金減少額又は欠損金増加額	517,758,622	651,659,311
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	517,758,622	651,659,311
分配金	270,173,599	248,463,490
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,209,295,328	21,462,546,659

(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、当期末日および翌日が休日のため、2024年1月23日から2024年7月22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51特定期間 2024年1月22日現在	第52特定期間 2024年7月22日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	47,003,472,779 円	43,589,384,016 円
期中追加設定元本額	963,041,345 円	1,213,603,369 円
期中一部解約元本額	4,377,130,108 円	4,888,943,875 円
2. 受益権の総数	43,589,384,016 口	39,914,043,510 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	23,209,295,328 円	21,462,546,659 円
4. 1口当たり純資産額	0.4675 円	0.4623 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第51特定期間 自 2023年 7月21日 至 2024年 1月22日</p>	<p style="text-align: center;">第52特定期間 自 2024年 1月23日 至 2024年 7月22日</p>
<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.33%以内の額</p>	<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左</p>
<p>2．分配金の計算過程 （自2023年 7月21日 至2023年 8月21日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（61,507,672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（169,457,887円）及び分配準備積立金（189,345,364円）より分配対象収益は420,310,923円（1口当たり0.009038円）であり、うち46,503,469円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2023年 8月22日 至2023年 9月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（63,682,344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（169,131,510円）及び分配準備積立金（201,865,455円）より分配対象収益は434,679,309円（1口当たり0.009423円）であり、うち46,130,153円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2023年 9月21日 至2023年10月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（54,981,830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（166,545,636円）及び分配準備積立金（214,492,917円）より分配対象収益は436,020,383円（1口当たり0.009641円）であり、うち45,224,604円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p>	<p>2．分配金の計算過程 （自2024年 1月23日 至2024年 2月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（49,536,227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（161,981,983円）及び分配準備積立金（289,128,978円）より分配対象収益は500,647,188円（1口当たり0.011674円）であり、うち42,886,914円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2024年 2月21日 至2024年 3月21日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（61,910,527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（160,889,024円）及び分配準備積立金（290,694,363円）より分配対象収益は513,493,914円（1口当たり0.012140円）であり、うち42,296,094円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p> <p>（自2024年 3月22日 至2024年 4月22日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（56,809,182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（159,984,976円）及び分配準備積立金（303,866,760円）より分配対象収益は520,660,918円（1口当たり0.012511円）であり、うち41,616,737円（1口当たり0.001000円）を分配金額としております。</p>

(自2023年10月21日 至2023年11月20日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(79,556,446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(165,452,917円)及び分配準備積立金(220,288,581円)より分配対象収益は465,297,944円(1口当たり0.010428円)であり、うち44,619,090円(1口当たり0.001000円)を分配金額としております。

(自2023年11月21日 至2023年12月20日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(75,366,539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(164,621,794円)及び分配準備積立金(251,365,547円)より分配対象収益は491,353,880円(1口当たり0.011140円)であり、うち44,106,899円(1口当たり0.001000円)を分配金額としております。

(自2023年12月21日 至2024年1月22日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(59,858,639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(163,587,533円)及び分配準備積立金(278,529,387円)より分配対象収益は501,975,559円(1口当たり0.011516円)であり、うち43,589,384円(1口当たり0.001000円)を分配金額としております。

(自2024年4月23日 至2024年5月20日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(64,194,962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(159,977,802円)及び分配準備積立金(314,455,392円)より分配対象収益は538,628,156円(1口当たり0.013072円)であり、うち41,204,028円(1口当たり0.001000円)を分配金額としております。

(自2024年5月21日 至2024年6月20日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(58,127,329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(159,168,907円)及び分配準備積立金(330,505,264円)より分配対象収益は547,801,500円(1口当たり0.013511円)であり、うち40,545,674円(1口当たり0.001000円)を分配金額としております。

(自2024年6月21日 至2024年7月22日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(53,328,385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(160,074,441円)及び分配準備積立金(339,735,981円)より分配対象収益は553,138,807円(1口当たり0.013858円)であり、うち39,914,043円(1口当たり0.001000円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドおよび主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権および金銭債務であり、その内容を当ファンドおよび親投資信託受益証券の貸借対照表、有価証券に関する注記、デリバティブ取引に関する注記および附属明細表に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、為替変動リスク、価格変動リスクの回避および信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的としております。</p> <p>当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク等があります。</p>
3．金融商品に係るリスク管理体制	投資リスクの管理および投資行動のチェックについては、運用部門が自ら行う方法と運用部門から独立したコンプライアンス部門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51特定期間 2024年1月22日現在	第52特定期間 2024年7月22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	501,287,196	80,107,902
合 計	501,287,196	80,107,902

（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51特定期間 2024年1月22日 現在			第52特定期間 2024年7月22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	20,011,066,925	-	20,962,859,167	951,792,242	17,923,025,411	-	17,961,425,247	38,399,836
アメリ カ・ド ル	17,509,656,201	-	18,347,277,362	837,621,161	15,731,935,382	-	15,745,616,507	13,681,125
イギリ ス・ポ ンド	502,857,314	-	527,406,299	24,548,985	438,455,593	-	446,150,281	7,694,688
カナ ダ・ド ル	494,060,972	-	515,719,481	21,658,509	437,524,428	-	436,908,340	616,088
ユーロ	1,504,492,438	-	1,572,456,025	67,963,587	1,315,110,008	-	1,332,750,119	17,640,111
合計	20,011,066,925	-	20,962,859,167	951,792,242	17,923,025,411	-	17,961,425,247	38,399,836

（注1）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(注2) デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておられません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(ア) 株式

該当事項はありません。

(イ) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド	3,855,255,293	18,494,045,166	
親投資信託受益証券 合計		3,855,255,293	18,494,045,166	
合計		3,855,255,293	18,494,045,166	

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

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第51特定期間 2024年1月22日現在	第52特定期間 2024年7月22日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,219,956	561,889
親投資信託受益証券	4,931,927,589	5,417,377,607
未収入金	20,389,328	64,163,564
流動資産合計	4,953,536,873	5,482,103,060
資産合計	4,953,536,873	5,482,103,060
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	10,760,148	10,955,659
未払解約金	1,219,956	43,189,378
未払受託者報酬	240,639	264,745
未払委託者報酬	6,641,916	7,307,151
その他未払費用	1,275,889	1,307,842
流動負債合計	20,138,548	63,024,775
負債合計	20,138,548	63,024,775
純資産の部		
元本等		
元本	7,173,432,080	7,303,773,212
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,240,033,755	1,884,694,927
(分配準備積立金)	396,946,699	719,018,528
元本等合計	4,933,398,325	5,419,078,285
純資産合計	4,933,398,325	5,419,078,285
負債純資産合計	4,953,536,873	5,482,103,060

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第51特定期間 自 2023年7月21日 至 2024年1月22日	第52特定期間 自 2024年1月23日 至 2024年7月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	427,073,497	502,053,841
営業収益合計	427,073,497	502,053,841
営業費用		
受託者報酬	1,325,905	1,433,982
委託者報酬	36,596,509	39,578,969
その他費用	1,275,889	1,307,842
営業費用合計	39,198,303	42,320,793
営業利益又は営業損失（ ）	387,875,194	459,733,048
経常利益又は経常損失（ ）	387,875,194	459,733,048
当期純利益又は当期純損失（ ）	387,875,194	459,733,048
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	2,712,462	3,710,180
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,555,956,659	2,240,033,755
剰余金増加額又は欠損金減少額	162,799,032	238,849,380
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	162,799,032	238,849,380
剰余金減少額又は欠損金増加額	167,590,787	273,829,279
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	167,590,787	273,829,279
分配金	64,448,073	65,704,141
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,240,033,755	1,884,694,927

（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、当期末日および翌日が休日のため、2024年1月23日から2024年7月22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51特定期間 2024年1月22日現在	第52特定期間 2024年7月22日現在
1．元本の推移 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	7,149,601,197 円 500,962,936 円 477,132,053 円	7,173,432,080 円 982,066,743 円 851,725,611 円
2．受益権の総数	7,173,432,080 口	7,303,773,212 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	2,240,033,755 円	1,884,694,927 円
4．1口当たり純資産額	0.6877 円	0.7420 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

<p style="text-align: center;">第51特定期間 自 2023年 7月21日 至 2024年 1月22日</p>	<p style="text-align: center;">第52特定期間 自 2024年 1月23日 至 2024年 7月22日</p>
<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.33%以内の額</p>	<p>1．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左</p>
<p>2．分配金の計算過程 （自2023年 7月21日 至2023年 8月21日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（17,488,077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（18,085,465円）、信託約款に規定される収益調整金（205,669,859円）及び分配準備積立金（123,523,386円）より分配対象収益は364,766,787円（1口当たり0.051549円）であり、うち10,614,095円（1口当たり0.001500円）を分配金額としております。</p> <p>（自2023年 8月22日 至2023年 9月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（18,932,418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（75,335,000円）、信託約款に規定される収益調整金（211,180,402円）及び分配準備積立金（147,700,093円）より分配対象収益は453,147,913円（1口当たり0.063235円）であり、うち10,749,193円（1口当たり0.001500円）を分配金額としております。</p> <p>（自2023年 9月21日 至2023年10月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（12,527,110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（213,757,044円）及び分配準備積立金（228,923,055円）より分配対象収益は455,207,209円（1口当たり0.063499円）であり、うち10,753,079円（1口当たり0.001500円）を分配金額としております。</p>	<p>2．分配金の計算過程 （自2024年 1月23日 至2024年 2月20日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（16,950,756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（44,110,744円）、信託約款に規定される収益調整金（231,399,494円）及び分配準備積立金（394,129,542円）より分配対象収益は686,590,536円（1口当たり0.095080円）であり、うち10,831,824円（1口当たり0.001500円）を分配金額としております。</p> <p>（自2024年 2月21日 至2024年 3月21日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（17,854,803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（58,255,427円）、信託約款に規定される収益調整金（248,385,825円）及び分配準備積立金（439,690,364円）より分配対象収益は764,186,419円（1口当たり0.103988円）であり、うち11,023,155円（1口当たり0.001500円）を分配金額としております。</p> <p>（自2024年 3月22日 至2024年 4月22日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（19,683,895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（35,137,355円）、信託約款に規定される収益調整金（255,037,319円）及び分配準備積立金（496,564,587円）より分配対象収益は806,423,156円（1口当たり0.109997円）であり、うち10,997,027円（1口当たり0.001500円）を分配金額としております。</p>

(自2023年10月21日 至2023年11月20日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(18,817,124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(59,033,461円)、信託約款に規定される収益調整金(216,557,153円)及び分配準備積立金(227,913,133円)より分配対象収益は522,320,871円(1口当たり0.072882円)であり、うち10,750,059円(1口当たり0.001500円)を分配金額としております。

(自2023年11月21日 至2023年12月20日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(14,403,040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(7,911,460円)、信託約款に規定される収益調整金(223,596,948円)及び分配準備積立金(291,554,389円)より分配対象収益は537,465,837円(1口当たり0.074500円)であり、うち10,821,499円(1口当たり0.001500円)を分配金額としております。

(自2023年12月21日 至2024年1月22日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(19,437,463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(88,871,536円)、信託約款に規定される収益調整金(224,326,844円)及び分配準備積立金(299,397,848円)より分配対象収益は632,033,691円(1口当たり0.088108円)であり、うち10,760,148円(1口当たり0.001500円)を分配金額としております。

(自2024年4月23日 至2024年5月20日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(18,559,803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(120,895,012円)、信託約款に規定される収益調整金(266,030,511円)及び分配準備積立金(532,580,305円)より分配対象収益は938,065,631円(1口当たり0.127479円)であり、うち11,037,854円(1口当たり0.001500円)を分配金額としております。

(自2024年5月21日 至2024年6月20日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(21,617,826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(88,315,311円)、信託約款に規定される収益調整金(278,734,728円)及び分配準備積立金(633,498,823円)より分配対象収益は1,022,166,688円(1口当たり0.141201円)であり、うち10,858,622円(1口当たり0.001500円)を分配金額としております。

(自2024年6月21日 至2024年7月22日)

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(15,652,706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(306,398,628円)及び分配準備積立金(714,321,481円)より分配対象収益は1,036,372,815円(1口当たり0.141896円)であり、うち10,955,659円(1口当たり0.001500円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドおよび主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権および金銭債務であり、その内容を当ファンドおよび親投資信託受益証券の貸借対照表、有価証券に関する注記、デリバティブ取引に関する注記および附属明細表に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、為替変動リスク、価格変動リスクの回避および信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的としております。</p> <p>当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク等があります。</p>
3．金融商品に係るリスク管理体制	投資リスクの管理および投資行動のチェックについては、運用部門が自ら行う方法と運用部門から独立したコンプライアンス部門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51特定期間 2024年1月22日現在	第52特定期間 2024年7月22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	115,303,571	21,780,345
合 計	115,303,571	21,780,345

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(ア) 株式

該当事項はありません。

(イ) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	フィデリティ・ストラテジック・イン カム・マザーファンド	1,129,302,622	5,417,377,607	
親投資信託受益証券 合計		1,129,302,622	5,417,377,607	
合計		1,129,302,622	5,417,377,607	

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

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考情報）

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

なお、同親投資信託の状況は以下のとおりです。

「フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

（１）貸借対照表

区 分	2024年 1月22日現在	2024年 7月22日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,364,561,504	282,173,078
貸付債権	1,087,256,349	923,605,845
株式	795,248,868	620,383,165
新株予約権証券	17,288,521	21,202,973
国債証券	17,154,474,362	18,402,777,452
特殊債券	2,288,037,306	1,867,049,155
社債券	12,963,143,276	14,414,235,564
派生商品評価勘定	86,806	4,274,398
未収入金	501,355,206	23,887,229
未収利息	450,142,083	491,594,943
前払費用	5,873,803	34,712,752
流動資産合計	36,627,468,084	37,085,896,554
資産合計	36,627,468,084	37,085,896,554
負債の部		
流動負債		
売付債券	12,839,456	-
派生商品評価勘定	3,833,287	37,020
未払金	846,649,081	9,044,765
未払解約金	197,602,831	249,712,503
流動負債合計	1,060,924,655	258,794,288
負債合計	1,060,924,655	258,794,288
純資産の部		
元本等		
元本	8,165,835,462	7,676,894,393
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	27,400,707,967	29,150,207,873
元本等合計	35,566,543,429	36,827,102,266
純資産合計	35,566,543,429	36,827,102,266
負債純資産合計	36,627,468,084	37,085,896,554

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年1月22日現在	2024年7月22日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	8,614,433,297 円	8,165,835,462 円
期中追加設定元本額	603,353,701 円	846,448,318 円
期中一部解約元本額	1,051,951,536 円	1,335,389,387 円
2. 期末元本額及びその内訳		
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）	4,899,231,583 円	3,855,255,293 円
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）	1,132,344,757 円	1,129,302,622 円
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド（資産成長型）Cコース（為替ヘッジ付き）	444,643,923 円	418,462,928 円
フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド（資産成長型）Dコース（為替ヘッジなし）	1,689,615,199 円	2,273,873,550 円
計	8,165,835,462 円	7,676,894,393 円
3. 受益権の総数	8,165,835,462 口	7,676,894,393 口
4. 1口当たり純資産額	4.3555 円	4.7971 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	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2) 貸付債権 重要な会計方針に係る事項に関する注記「貸付債権の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(3) デリバティブ取引 「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(4) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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	2024年1月22日現在	2024年7月22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	77,058,723	49,738,746
新株予約権証券	5,939,843	3,489,311
国債証券	63,888,134	180,173,451
特殊債券	45,536,158	70,504,070
社債券	299,623,501	533,844,205
合 計	326,049,227	731,293,669

(注) 2024年7月22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(2023年7月21日から2024年7月22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	2024年1月22日 現在			2024年7月22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	211,922,308	-	215,746,770	3,824,462	249,712,503	-	245,459,451	4,253,052
アメリカ・ドル	184,482,086	-	188,298,767	3,816,681	249,712,503	-	245,459,451	4,253,052
イギリス・ポンド	10,784,841	-	10,783,232	1,609	-	-	-	-
ユーロ	16,655,381	-	16,664,771	9,390	-	-	-	-
買建	74,230,365	-	74,308,346	77,981	43,936,254	-	43,920,580	15,674
アメリカ・ドル	62,466,584	-	62,544,456	77,872	43,936,254	-	43,920,580	15,674
カナダ・ドル	11,763,781	-	11,763,890	109	-	-	-	-
合計	286,152,673	-	290,055,116	3,746,481	293,648,757	-	289,380,031	4,237,378

（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。

(3) 附属明細表
 有価証券明細表
 (ア) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	EXXON MOBIL CORP	1,631	116.07	189,310.17	
	VISTRA CORP	6,518	76.47	498,431.46	
	MESQUITE ENERGY INC	11,182	83.40	932,578.80	
	EP ENERGY CORP	19,360	1.36	26,329.60	
	CALIFORNIA RES CORP	5,882	51.89	305,216.98	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	4,040	81.01	327,280.40	
	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC A	2,894	68.33	197,747.02	
	FRONTIER COMMS PARENT INC	5,215	26.73	139,396.95	
	NORTHEAST GROCERY INC PP	102,426	5.24	536,712.24	
	INTELSAT SA/LUXEMBOURG	4,049	40.91	165,644.59	
	LEGACY RESERVES INC NEW	9,287	6.54	60,736.98	
	LEGACY RESERVES INC 144A	59,461	6.54	388,874.94	
	NEW COTAI LLC / CAP P/P	170,219	0.71	120,855.49	
	PURE WEST ENERGY	277	0.22	62.04	
	SOUTHEASTERN GROCERS CVR RT	45,701	1.06	48,762.96	
アメリカ・ドル	小計	448,142		3,937,940.62 (620,383,165)	
合計		448,142		620,383,165 (620,383,165)	

(イ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	アメリカ・ドル	CALIFORNIA RES CRP WT 10/27/24	1,626.00	26,016.00	
		NOBLE CORP PLC TR 1 WT 2/04/28	2,011.00	58,095.77	
		NOBLE CORP PLC TR2 WT 2/04/28	2,011.00	50,476.10	
	アメリカ・ドル	小計	5,648.00	134,587.87 (21,202,973)	
新株予約権証券	合計		21,202,973 (21,202,973)		
国債証券	日本円	455 2年国債	909,700,000	907,289,294	
	日本円	小計	909,700,000	907,289,294	
	アメリカ・ドル	ABU DHABI 3.125% 9/30/49 144A	400,000.00	281,124.00	
		ANGOLA GOVT 8.25% 5/9/28 144A	260,000.00	246,430.60	
		ANGOLA GOVT 9.375% 5/8/48 144A	70,000.00	59,675.00	
		ANGOLA REP 8.75% 04/14/32 144A	100,000.00	90,500.00	
		ANGOLA REP 9.125% 11/49 144A	155,000.00	129,908.60	
		ANGOLA REP 9.5% 11/12/25 144A	115,000.00	117,048.15	
		ARGENTINA GOVT 1% 07/09/29	79,312.00	44,176.78	
		ARGENTINA GOVT STEP 01/09/38	371,540.00	163,849.14	
		ARGENTINA GOVT STEP 07/09/30	489,962.88	258,210.43	
		ARGENTINA GOVT STEP 07/09/35	579,621.00	231,268.77	
		BAHRAIN GOVT 4.25% 1/28 144A	135,000.00	127,700.55	
		BENIN GOVT 7.96% 02/13/38 144A	200,000.00	187,312.00	
		BERMUDA GOVT 2.375% 8/30 144A	125,000.00	106,093.75	
		BRAZIL GLBL 8.25% 1/20/34	150,000.00	171,675.00	
		BRAZIL GOVT 5% 01/27/45	250,000.00	195,625.00	
		BRAZIL GOVT 6% 10/20/33	225,000.00	219,037.50	
		CHILE GOVT 3.1% 01/22/61	135,000.00	84,331.80	

CHILE GOVT 4% 01/31/52	200,000.00	155,750.00	
CHILE REP 2.45% 01/31/2031	205,000.00	176,683.35	
COLOMBIA GOVT 3.125% 04/15/31	200,000.00	158,700.00	
COLOMBIA GOVT 5% 06/15/45	440,000.00	308,440.00	
COLOMBIA GOVT 5.2% 05/15/49	30,000.00	21,120.00	
COLOMBIA GOVT 7.5% 02/02/34	65,000.00	65,195.00	
COLOMBIA GOVT 8% 04/20/33	115,000.00	119,485.00	
COLOMBIA GOVT 8.75% 11/14/53	200,000.00	209,800.00	
COLOMBIA REP 7.375% 9/18/37	120,000.00	116,820.00	
COSTA RICA 5.625% 4/30/43 144A	255,000.00	229,755.00	
COSTA RICA GOVT 6.55% 04/03/34 144A	100,000.00	103,117.00	
COSTA RICA GV 6.125% 2/31 144A	40,000.00	40,340.00	
DOMIN REP 4.875% 09/23/32 144A	150,000.00	136,575.00	
DOMIN REP 5.875% 01/30/60 144A	420,000.00	356,370.00	
DOMINICAN REP 6.4% 6/5/49 144A	220,000.00	207,020.00	
DOMINICAN REP 7.05% 02/03/31 144A	150,000.00	156,225.00	
DOMINICAN REP 7.45% 04/44 144A	200,000.00	211,200.00	
DUBAI GOVT INT 3.9% 9/9/50 RGS	200,000.00	148,186.00	
ECUADOR GOVT STEP 7/31/40 144A	205,000.00	98,527.10	
ECUADOR REP STEP 07/31/30 144A	250,770.00	166,604.06	
ECUADOR REP STEP 07/31/35 144A	434,689.00	227,529.26	
EGYPT GOVT 5.875% 2/16/31 144A	200,000.00	160,124.00	
EGYPT GOVT 7.5% 02/16/61 144A	120,000.00	82,837.20	
EGYPT GOVT 7.625% 5/29/32 144A	65,000.00	54,965.30	
EGYPT GOVT 7.903% 2/21/48 144A	440,000.00	321,059.20	

EGYPT REP OF 7.5% 1/31/27 144A	235,000.00	229,270.70	
EGYPT REP OF 8.5% 1/31/47 144A	260,000.00	199,466.80	
EL SALVADOR REP 0.25% 04/17/30 14	150,000.00	4,350.00	
EL SALVADOR REP 7.65 6/35 144A	110,000.00	84,114.80	
EL SALVADOR REP 9.25% 04/30 144A	150,000.00	138,750.00	
EL SALVADOR REPUBLIC OF 7.1246	205,000.00	138,682.50	
GABONESE GOVT 6.625% 2/31 144A	45,000.00	34,143.75	
GABONESE REP 6.95 6/16/25 144A	200,000.00	182,312.00	
GHANA GOVT 10.725% 10/30 144A	130,000.00	87,425.00	
GHANA GOVT 8.125% 01/26 144A	125,000.00	64,452.50	
GHANA GOVT 8.125% 3/26/32 144A	115,000.00	58,865.05	
GHANA REP 8.625% 06/16/49	175,000.00	87,881.50	
GUATEMALA GOV 6.125% 6/50 144A	200,000.00	184,124.00	
GUATEMALA GOVT 6.6% 06/36 144A	100,000.00	101,468.00	
HUNGARY GOVT 2.125% 09/22/31 144A	200,000.00	160,186.00	
HUNGARY GOVT 3.125% 9/51 144A	100,000.00	63,718.00	
HUNGARY GOVT 5.5% 6/16/34 144A	40,000.00	39,262.40	
HUNGARY GOVT 6.75% 09/52 144A	245,000.00	264,369.70	
HUNGARY GOVT 7.625% 03/29/41	50,000.00	57,375.00	
INDONESIA 7.75% 1/17/38 144A	155,000.00	190,746.10	
INDONESIA 8.5% 10/12/35 144A	145,000.00	184,194.95	
INDONESIA GOVT 3.5% 02/14/50	280,000.00	208,423.60	
IVORY COAST 6.375% 3/3/28 144A	245,000.00	239,639.40	
JORDAN GOVT 7.375% 10/47 144A	130,000.00	114,520.90	
KENYA GOVT 6.3% 01/23/34 144A	35,000.00	26,162.50	

KENYA GOVT 7.25% 2/28/28 144A	20,000.00	18,175.00	
KENYA GOVT 8% 05/22/32 144A	20,000.00	17,356.20	
KENYA GOVT 9.75% 2/16/31 144A	200,000.00	191,500.00	
LEBANE 144A 5.8% 4/14/20 REGS	885,000.00	61,392.45	
LEBANESE REP 6.15% 6/20	180,000.00	12,150.00	
MEXICO GOVT 6.35% 02/09/35	200,000.00	203,124.00	
MONTENEGRO 7.25% 03/31 144A	200,000.00	202,436.00	
NIGERIA GOVT 7.625% 11/47 144A	175,000.00	129,171.00	
NIGERIA GOVT 7.696% 2/38 144A	200,000.00	157,686.00	
NIGERIA GOVT 7.875% 2/32 144A	45,000.00	39,388.95	
NIGERIA GOVT 8.375% 3/29 144A	115,000.00	108,387.50	
NIGERIA REP 7.625% 11/25 144A	150,000.00	149,109.00	
NIGERIA REPUBL 6.5% 11/27 144A	285,000.00	262,732.95	
OMAN GOVT 6.25% 01/25/31 144A	230,000.00	239,200.00	
OMAN SULTAN 6.5% 3/8/47 144A	355,000.00	359,213.85	
OMAN SULTANA 6% 08/29 144A	120,000.00	123,074.40	
OMAN SULTANATE 6.75% 1/48 144A	200,000.00	207,250.00	
PAKISTAN GOV 6.875% 12/27 144A	245,000.00	214,068.75	
PAKISTAN GOVT 7.875% 3/36 144A	125,000.00	94,076.25	
PAKISTAN ISLAM 0% 4/6/26 144A	130,000.00	118,300.00	
PANAMA GOVT 2.252% 09/29/32	200,000.00	144,936.00	
PANAMA GOVT 3.16% 01/23/30	200,000.00	169,624.00	
PANAMA GOVT 4.5% 05/15/2047	50,000.00	34,687.50	
PANAMA GOVT 6.4% 02/14/35	200,000.00	190,624.00	
PANAMA GOVT 6.853% 03/28/54	200,000.00	185,250.00	

PANAMA GOVT 7.875% 03/01/57	200,000.00	209,000.00	
PARAGUAY REP 5.4% 3/30/50 144A	240,000.00	210,823.20	
PERU GOVT 3% 01/15/34	100,000.00	81,906.00	
PERU GOVT 3.3% 03/11/41	145,000.00	108,976.20	
PERU REPUBLIC 2.783% 1/23/31	310,000.00	266,696.10	
PHILIPPINE GOVT 2.65% 12/10/45	60,000.00	39,525.00	
PHILIPPINE GOVT 2.95% 05/05/45	25,000.00	17,398.25	
PHILIPPINE GOVT 5.95% 10/13/47	200,000.00	213,436.00	
POLAND GOVT 5.5% 04/04/53	65,000.00	63,583.00	
QATAR GOVT 4.4% 04/16/50 144A	475,000.00	419,781.25	
QATAR ST 4.817% 03/14/49 144A	285,000.00	268,789.20	
QATAR ST 5.103% 4/23/48 144A	320,000.00	314,000.00	
REP OF ARMENIA 3.6% 2/31 144A	120,000.00	98,587.20	
ROMANIA GOVT 3.625% 3/32 144A	102,000.00	87,369.12	
ROMANIA GOVT 4% 02/14/51 144A	70,000.00	48,675.90	
ROMANIA GOVT 5.125% 06/48 144A	210,000.00	175,709.10	
ROMANIA GOVT 7.125% 1/33 144A	40,000.00	42,545.60	
ROMANIA GOVT 7.625% 01/53 144A	38,000.00	41,537.80	
ROMANIA REPUBLIC 3% 02/31 144A	152,000.00	128,294.08	
SAUDI ARABIA 3.45% 2/2/61 144A	280,000.00	184,100.00	
SENEGAL REP 6.25% 5/23/33 144A	125,000.00	106,687.50	
SERBIA GOVT 2.125% 12/01/30 144A	200,000.00	161,000.00	
SERBIA GOVT 6% 06/12/34 144A	200,000.00	197,750.00	
SERBIA GOVT 6.5% 09/26/33 144A	105,000.00	107,328.90	
SOUTH AFRICA 5% 10/12/46	255,000.00	182,962.50	

SOUTH AFRICA 5.65% 09/27/47	65,000.00	50,050.00	
SOUTH AFRICA RE 5.75% 09/30/49	215,000.00	165,012.50	
SRI LANKA GOV 6.85% 11/25 144A	240,000.00	140,548.80	
SRI LANKA GOVT 6.2% 05/27 144A	200,000.00	114,624.00	
SRI LANKA GOVT 6.75% 4/28 144A	230,000.00	134,046.30	
SRI LANKA GOVT 7.55% 3/30 144A	25,000.00	14,359.25	
SRI LANKA GOVT 7.85% 3/29 144A	15,000.00	8,701.65	
TAJIKI REP 7.125% 9/14/27 144A	65,000.00	61,770.15	
TURKEY GOVT 4.875% 4/16/2043	475,000.00	339,473.00	
TURKEY GOVT 5.125% 2/17/28	120,000.00	115,237.20	
TURKEY GOVT BD 4.25% 04/14/26	70,000.00	67,965.10	
TURKEY REP 5.75% 05/11/47	70,000.00	54,162.50	
TURKEY REP 7.625% 05/15/34	200,000.00	204,250.00	
TURKEY REP 9.125% 07/13/30	45,000.00	49,668.75	
TURKEY REP 9.375% 01/19/33	145,000.00	163,758.65	
TURKEY REP 9.375% 03/14/29	200,000.00	220,062.00	
TURKEY REP GOVT 4.75% 01/26/26	105,000.00	102,997.65	
TURKEY REPUBLI 4.875% 10/09/26	145,000.00	141,283.65	
UKRAINE CA VAR 0% 5/31/41 144A	245,000.00	119,131.25	
UKRAINE GOVT 6.876% 5/31 144A	200,000.00	55,000.00	
UKRAINE GOVT 7.253% 3/35 144A	200,000.00	54,750.00	
UKRAINE GOVT 7.75% 9/1/25 144A	250,000.00	77,500.00	
UKRAINE GOVT 7.75% 9/1/26 144A	540,000.00	164,025.00	
UKRAINE GOVT 7.75% 9/1/28 144A	200,000.00	58,250.00	
UNITED MEXICAN 4.35% 1/15/47	530,000.00	399,816.10	

URUGUAY REP 5.75% 10/28/34	50,000.00	52,578.00	
URUGUAY REPUBLICA ORIENTAL DL	220,000.00	209,754.60	
USTB 2% 08/15/51	229,000.00	139,394.59	
USTB 2.375% 02/15/42	50,000.00	36,899.00	
USTB 2.50% 02/15/45	8,976,000.00	6,486,506.40	
USTB 2.875% 05/15/52	546,000.00	405,787.20	
USTB 3% 02/15/49	1,258,000.00	965,653.38	
USTB 3.5% 2/15/39	200,000.00	182,170.00	
USTB 3.625% 02/15/53	157,000.00	135,552.23	
USTB 3.875% 05/15/43	88,000.00	80,371.28	
USTB 4.125% 08/15/53	3,479,000.00	3,287,237.52	
USTB 4.25% 02/15/54	70,000.00	67,626.30	
USTB 4.25% 05/15/39	482,000.00	476,177.44	
USTB 4.625% 05/15/54	260,000.00	267,391.80	
USTB 4.75% 2/15/37	2,918,000.00	3,063,900.00	
USTN .75% 03/31/26	4,597,000.00	4,311,618.24	
USTN 0.75% 08/31/26	2,570,000.00	2,379,742.90	
USTN 1% 08/31/28	844,000.00	746,509.56	
USTN 1.125% 10/31/26	570,000.00	529,672.50	
USTN 1.25% 12/31/26	923,000.00	857,300.86	
USTN 1.5% 01/31/27	40,000.00	37,287.20	
USTN 1.5% 11/30/28	124,000.00	110,795.24	
USTN 1.625% 09/30/26	1,060,000.00	998,255.00	
USTN 2.375% 03/31/29	796,000.00	735,145.80	
USTN 2.375% 04/30/26	1,107,000.00	1,065,874.95	
USTN 2.5% 02/28/26	90,000.00	87,036.30	
USTN 2.5% 03/31/27	410,000.00	391,340.90	
USTN 2.625% 05/31/27	470,000.00	448,958.10	
USTN 2.75% 05/31/29	720,000.00	674,971.20	
USTN 2.875% 04/30/29	590,000.00	556,765.30	
USTN 3% 07/31/29	776,000.00	721,648.96	
USTN 3.125% 08/31/29	4,384,000.00	4,172,121.28	
USTN 3.375% 05/15/33	210,000.00	196,807.80	

USTN 3.5% 04/30/30	510,000.00	492,348.90	
USTN 3.625% 05/15/26	720,000.00	708,350.40	
USTN 3.75% 05/31/30	740,000.00	723,320.40	
USTN 3.75% 12/31/30	240,000.00	234,139.20	
USTN 3.875% 08/15/33	1,001,000.00	973,542.57	
USTN 3.875% 11/30/29	1,300,000.00	1,281,007.00	
USTN 3.875% 12/31/29	565,000.00	556,541.95	
USTN 4% 01/15/27	2,280,000.00	2,259,502.80	
USTN 4% 02/15/34	557,000.00	546,467.13	
USTN 4% 02/28/30	100,000.00	99,082.00	
USTN 4% 07/31/30	180,000.00	178,227.00	
USTN 4% 10/31/29	2,304,000.00	2,284,277.76	
USTN 4.125% 08/31/30	460,000.00	458,436.00	
USTN 4.125% 11/15/32	48,000.00	47,700.00	
USTN 4.25% 02/28/31	309,000.00	310,158.75	
USTN 4.25% 03/15/27	740,000.00	738,490.40	
USTN 4.25% 03/31/31	820,000.00	817,048.00	
USTN 4.25% 06/30/29	360,000.00	361,346.40	
USTN 4.25% 06/30/31	1,030,000.00	1,034,181.80	
USTN 4.375% 05/15/34	327,000.00	330,525.06	
USTN 4.375% 08/15/26	600,000.00	598,710.00	
USTN 4.375% 11/30/30	2,080,000.00	2,101,840.00	
USTN 4.375% 12/15/26	600,000.00	599,832.00	
USTN 4.5% 03/31/26	480,800.00	479,953.79	
USTN 4.5% 05/15/27	980,000.00	984,664.80	
USTN 4.5% 07/15/26	541,000.00	540,978.36	
USTN 4.5% 11/15/33	200,000.00	203,936.00	
USTN 4.625% 03/15/26	800,000.00	799,968.00	
USTN 4.625% 04/30/29	300,000.00	305,811.00	
USTN 4.625% 05/31/31	330,000.00	338,454.60	
USTN 4.625% 06/15/27	1,170,000.00	1,180,600.20	
USTN 4.625% 10/15/26	2,500,000.00	2,509,750.00	
USTN 4.625% 11/15/26	70,000.00	70,322.00	

		USTN 4.875% 05/31/26	900,000.00	905,130.00	
		USTN 4.875% 10/31/30	650,000.00	674,472.50	
		UZBEKISTAN 3.7% 11/25/30 144A	145,000.00	119,987.50	
		VENEZUELA REP 9.25% 9/15/27	1,805,000.00	356,487.50	
		VENEZUELA REPUB 12.75% 8/23/22	345,000.00	69,000.00	
		ZAMBIA GOVT 0.5% 12/31/53 144A	57,642.00	29,109.21	
		ZAMBIA GOVT STEP 06/30/33 144A	61,399.89	53,705.25	
	アメリカ・ドル	小計	95,208,736.77	82,612,376.95 (13,014,753,865)	
	イギリス・ポンド	UK GILT .875% 07/31/33 RGS	5,776,000.00	4,388,604.80	
	イギリス・ポンド	小計	5,776,000.00	4,388,604.80 (893,827,140)	
	カナダ・ドル	CANADA GOVT 1.5% 04/01/25	1,110,000.00	1,088,932.20	
		CANADA GOVT 1.5% 06/01/31	3,830,000.00	3,397,056.80	
		CANADA GOVT 2% 12/01/51	4,470,000.00	3,356,791.20	
	カナダ・ドル	小計	9,410,000.00	7,842,780.20 (900,978,589)	
	ユーロ	GERMANY GOVT 2.2% 02/15/34 RGS	15,970,000.00	15,650,440.30	
	ユーロ	小計	15,970,000.00	15,650,440.30 (2,685,928,564)	
国債証券 合計				18,402,777,452 (17,495,488,158)	
特殊債券	アメリカ・ドル	ABU DHABI NA 4% 10/03/49 144A	150,000.00	121,911.00	
		ABU DHABI NT 4.875% 4/30 144A	15,000.00	15,064.80	
		BANK GOSP 5.375% 05/22/33 144A	200,000.00	200,250.00	
		BANK GOSPOD 6.25% 7/09/54 144A	200,000.00	207,562.00	
		CODELCO INC 4.25% 7/17/42 144A	95,000.00	75,227.65	
		CORPO NAC 4.375% 02/05/49 144A	100,000.00	77,875.00	
		ECOPETROL SA 8.375% 01/19/36	50,000.00	49,450.00	
		ESKOM HLDGS 7.125% 2/25 144A	320,000.00	319,600.00	

FHLG 15YR 2.5% 03/01/2033#G186	21,736.28	20,328.63	
FHLG 15YR 2.5% 03/01/2033#G186	8,687.18	8,113.73	
FHLG 15YR 2.5% 05/33#G18687	4,500.37	4,203.30	
FHLG 15YR 2.5% 08/32#G18654	4,341.69	4,078.27	
FHLG 15YR 2.5% 11/32#G18665	4,602.04	4,316.75	
FHLG 15YR 2.5% 12/01/2032#G186	23,610.72	22,136.93	
FHLG 20YR 1.5% 02/41#RB5099	59,302.68	48,666.74	
FHLG 20YR 1.5% 03/41#RB5104	60,073.69	49,299.47	
FHLG 20YR 1.5% 04/41#RB5107	60,129.37	49,345.16	
FHLG 20YR 1.5% 12/40#RB5089	35,412.35	29,061.14	
FHLG 20YR 2% 07/41#SC0162	264,984.98	224,466.12	
FHLG 20YR 2.5% 01/41#SC0119	47,806.66	41,760.55	
FHLG 20YR 2.5% 01/42#RB5142	25,262.53	21,909.68	
FHLG 20YR 2.5% 04/41#SC0158	94,809.01	82,433.58	
FHLG 20YR 2.5% 07/41#SC0157	73,121.30	63,576.77	
FHLG 30YR 3% 03/52#RA6988	43,425.91	37,658.94	
FHMS 18-K072 A2 3.444% 12/27	102,000.00	98,055.66	
FHMS 2015-K043 A2 3.062% 12/24	3,385.88	3,349.48	
FHMS 2015-K049 A2 3.01% 07/25	76,669.49	75,057.89	
FHMS 2016-K052 A2 3.151% 11/25	313,118.00	305,781.64	
FHMS 2016-K053 A2 2.995% 12/25	200,000.00	194,524.00	
FHMS 2016-K055 A2 2.673% 03/26	300,000.00	289,347.00	
FHMS 2016-K058 A2 2.653% 08/26	200,000.00	191,226.00	
FHMS 2017-K063 A2 3.43% 01/27	100,000.00	96,868.00	
FHMS 2019-K734 A2 3.208% 02/26	100,000.00	97,510.00	

FHMS 2022-K747 A2 2.05% 11/28	150,000.00	135,096.00	
FHMS K044 A2 2.811% 01/25/25	160,276.89	158,151.61	
FHMS K727 A2 2.946% 07/24	23,788.11	23,731.25	
FHR 2021-5083 VA 1% 08/38	257,524.85	240,950.55	
FHR 2022-5198 BA 2.5% 11/47	85,597.29	76,614.71	
FHR 2022-5213 JM 3.5% 09/51	113,024.40	107,294.06	
FHR 2022-5224 DQ 3.75% 08/44	63,970.26	60,700.74	
FNMA 15YR 2% 02/28#FS3865	30,131.15	28,846.65	
FNMA 15YR 3.5% 09/35#FM7457	42,132.68	40,417.45	
FNMA 20YR 1.5% 01/41#MA4231	57,600.79	47,270.08	
FNMA 20YR 1.5% 02/41#MA4266	58,918.07	48,351.11	
FNMA 20YR 1.5% 03/41#MA4286	60,117.86	49,335.72	
FNMA 20YR 1.5% 11/40#MA4175	55,000.45	45,136.11	
FNMA 20YR 1.5% 12/40#MA4202	55,330.00	45,406.56	
FNMA 20YR 2% 07/41#CB1069	71,867.32	60,878.08	
FNMA 20YR 2% 07/41#CB1071	105,219.02	88,834.31	
FNMA 20YR 2% 08/41#CB1337	64,264.79	54,216.99	
FNMA 20YR 2% 10/41#CB1837	47,284.38	39,891.46	
FNMA 20YR 2% 11/41#CB2110	89,318.25	75,353.34	
FNMA 20YR 2% 11/41#FS0106	111,271.55	93,874.24	
FNMA 20YR 2% 12/40#FM5042	22,306.67	18,888.84	
FNMA 20YR 2% 12/41#FM9851	37,047.64	31,255.24	
FNMA 20YR 2.5% 07/40#CA6462	27,803.73	24,383.03	
FNMA 20YR 2.5% 08/41#CB1343	28,258.53	24,569.94	
FNMA 20YR 2.5% 09/41#FM8850	22,145.93	19,255.22	

FNMA 20YR 2.5% 11/41#FM9558	22,878.34	19,841.92	
FNMA 20YR 2.5% 11/41#MA4475	20,040.33	17,380.57	
FNMA 30YR 2% 02/51#FM6332	342,130.61	271,531.95	
FNMA 30YR 2% 02/51#FS7385	24,617.05	19,537.32	
FNMA 30YR 2% 03/52#BT2296	149,290.18	118,578.20	
FNMA 30YR 2.5% 11/51#FM9517	44,698.36	37,355.31	
FNMA 30YR 3% 12/51#BT9503	43,228.61	37,534.96	
FNMA 30YR 3.5% 02/52#MA4550	76,657.62	68,794.08	
FNMA 30YR 3.5% 03/52#CB3174	7,725.64	6,950.14	
FNMA 30YR 6% 06/53#CB6538	91,185.40	93,062.90	
FNMA 30YR 6% 06/53#CB6539	94,311.38	96,105.18	
FNMA 30YR 6.5% 05/53#CB6337	521,525.78	535,742.57	
FNR 2022-3 N 2% 10/47	350,134.51	302,974.89	
FNR 2022-49 TE 4.5% 12/48	292,310.35	282,731.33	
FNR 2022-65 GA 5% 04/46	329,817.63	320,619.01	
GNII II 2% 10/50#MA6930	344,655.71	282,858.94	
GNII II 2% 11/50#MA6994	334,534.56	274,448.80	
MDC GMTN BV 2.875% 5/21/30 RGS	200,000.00	179,686.00	
MDGH GMTN RSC 5.084% 5/53 144A	200,000.00	190,500.00	
OCP SA 3.75% 06/23/31 144A	200,000.00	174,186.00	
PDVSA 12.75% 2/17/22 144A	400,000.00	64,000.00	
PDVSA PETR VENZ 5.375% 4/12/27	325,000.00	41,112.50	
PEMEX 6.7% 02/16/32	140,000.00	117,980.80	
PEMEX 6.95% 01/28/60	360,000.00	238,968.00	
PEMEX 7.69% 01/23/50	288,000.00	208,080.00	

		PEMEX PRO FDG 6.625% 6/15/35	415,000.00	316,416.75	
		PETROL VENEZUELA 6% 11/26 144A	1,090,000.00	139,520.00	
		PETROLEOS MEX 6.5% 6/02/41	400,000.00	274,372.00	
		PETROLEOS MEXCNS 6.75% 9/21/47	495,000.00	328,630.50	
		PETROLEOS MEXICA 6.5% 03/13/27	60,000.00	57,660.60	
		PETROLEOS VENZ 9.75 5/35 144A	670,000.00	98,825.00	
		PRIVATE EXPORT 1.75% 11/15/24	920,000.00	908,969.20	
		PT PERTA PR 4.15% 2/25/60 144A	140,000.00	104,125.00	
		QATAR PETE 2.25% 07/12/31 144A	250,000.00	211,795.00	
		QATAR PETE 3.3% 07/12/51 144A	200,000.00	141,374.00	
		SOUTHERN GAS 6.875% 03/26 144A	215,000.00	217,014.55	
		TVA 5.25% 9/15/39	267,000.00	278,961.60	
		TVA 5.5% 6/15/38	4,000.00	4,325.76	
	アメリカ・ドル	小計	15,525,922.80	11,851,270.50 (1,867,049,155)	
特殊債券 合計				1,867,049,155 (1,867,049,155)	
社債券	アメリカ・ドル	1011778 BC ULC 4% 10/15/30 144A	525,000.00	469,024.50	
		1011778 ULC 3.875% 01/28 144A	160,000.00	151,168.00	
		1375209 BC LTD 9% 1/30/28 144A	30,000.00	29,064.00	
		ACADEMY LTD 6% 11/15/27 144A	235,000.00	232,231.70	
		ACCESS BANK NIG 6.125% 09/21/26	100,000.00	95,000.00	
		ACRISURE LLC 7.5% 11/6/30 144A	145,000.00	147,221.40	
		ACRISURE LLC 8.5% 06/29 144A	175,000.00	179,025.00	
		ADIENT GLOBAL 7% 04/15/28 144A	215,000.00	220,506.15	
		ADIENT GLOBAL 8.25% 04/15/31 144A	215,000.00	227,366.80	
		ADVANCED DRAIN 5% 9/30/27 144A	40,000.00	39,299.60	

ADVANCED DRAIN 6.375% 06/15/30 144A	150,000.00	151,932.00	
AEGEA FINANC S 9% 1/20/31 144A	55,000.00	57,509.10	
AEROPUERTOS DOM 7% 06/30/34 144A	200,000.00	204,312.00	
AHP HEALTH PAR 5.75% 7/29 144A	190,000.00	182,219.50	
AIR CANADA 3.875% 08/15/26 144A	130,000.00	124,998.90	
ALBERTSONS 3.5% 03/15/29 144A	115,000.00	104,678.75	
ALBERTSONS 4.625% 1/15/27 144A	325,000.00	316,602.00	
ALBERTSONS 4.875% 2/15/30 144A	540,000.00	515,430.00	
ALCOA NEDERLAND 4.125% 03/31/29 144A	205,000.00	191,303.95	
ALCOA NETH 7.125% 03/31 144A	35,000.00	36,139.95	
ALLEGHENY TECH 4.875% 10/01/29	80,000.00	75,526.40	
ALLEGHENY TECH 5.125% 10/01/31	55,000.00	51,207.75	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 5.8	190,000.00	187,077.80	
ALLEGIAN T 7.25% 8/15/27 144A	90,000.00	83,345.40	
ALLEN MEDIA 10.5% 02/28 144A	480,000.00	197,073.60	
ALLIANT HLDG 5.875% 11/01/29 144A	205,000.00	195,766.80	
ALLIANT HLDG 6.75% 10/27 144A	730,000.00	723,196.40	
ALLIANT HLDG/CO 6.75% 04/15/28	340,000.00	343,366.00	
ALLIED UNV 6% 06/01/29 144A	75,000.00	66,376.50	
ALLY FINL INC 5.8% 05/01/2025	2,000.00	2,000.56	
ALLY FINL INC 6.7% 02/14/33	1,000,000.00	1,014,760.00	
ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18 Escrow	610,000.00	-	
ALTICE FR HLDS 6% 2/15/28 144A	190,000.00	57,913.90	

ALTICE FRAN 10.5% 5/15/27 RGS	430,000.00	163,387.10	
ALTICE FRANCE 5.125% 01/15/29 144A	155,000.00	102,603.80	
ALTICE FRANCE 5.125% 7/29 144A	320,000.00	212,992.00	
ALTICE FRANCE SA 5.5% 01/15/20	385,000.00	269,030.30	
AMER AIR 7.25% 02/15/28 144A	85,000.00	85,189.55	
AMWINS GROUP 4.875% 06/30/29 144A	100,000.00	94,605.00	
ANTOFAGASTA PLC 2.375% 10/14/30 144A	200,000.00	167,124.00	
ARCHROCK PR 6.25% 4/1/28 144A	185,000.00	184,367.30	
ARD FIN SA 6.5% 06/30/27 144A	185,000.00	45,954.00	
ARETEC ESCROW 10% 8/15/30 144A	295,000.00	319,895.05	
ARSENAL AIC PAR 8% 10/30 144A	60,000.00	63,751.80	
ARTERA SERV 8.5% 02/15/31 144A	190,000.00	195,637.30	
ASBURY AUTOMO 4.625% 11/15/29 144A	100,000.00	93,877.00	
ASBURY AUTOMO 5% 02/15/32 144A	100,000.00	93,181.00	
ASBURY AUTOMOTI 4.5% 03/01/28	54,000.00	51,672.60	
ASBURY AUTOMOTI 4.75% 03/01/30	52,000.00	48,810.84	
ASGN INC 4.625% 05/15/28 144A	445,000.00	425,500.10	
ASHTON WO 6.625% 01/15/28 144A	5,000.00	5,004.00	
ASHTON WOODS US 4.625% 08/01/2	100,000.00	91,253.00	
ASSUREDPARTNE 5.625% 01/15/29 144A	100,000.00	95,097.00	
ASTON MARTIN 10% 03/31/29 144A	200,000.00	199,000.00	
ATLAS LUX 4.625% 06/01/28 144A	98,000.00	90,296.22	
AVIS BUDGET 5.375% 03/01/29 144A	115,000.00	105,412.45	

AVOLON HLD 4.375% 5/01/26 144A	2,000.00	1,956.84	
AVOLON HLDGS 2.528% 11/27 144A	314,000.00	286,151.34	
AXIAN TELECOM 7.375% 02/16/27 144A	200,000.00	198,750.00	
AZUL SC FIN LLP 11.5% 05/28/29	183,462.00	147,760.29	
BANCO CREDIT T5Y+ PERP 144A	200,000.00	209,300.00	
BANCO MER KY 7.625/VR PRP 144A	90,000.00	89,155.80	
BELLRING BRANDS 7% 3/30 144A	60,000.00	61,793.40	
BERRY GBL ES 5.625% 7/27 144A	100,000.00	98,954.00	
BLOCK INC 2.75% 06/01/26	190,000.00	181,117.50	
BLOCK INC 3.5% 06/01/31	190,000.00	165,925.10	
BLOCK INC 6.5% 05/15/32 144A	240,000.00	245,680.80	
BOMBARDIER 7% 06/01/32 144A	95,000.00	97,646.70	
BOMBARDIER 7.25% 07/01/31 144A	135,000.00	140,255.55	
BOMBARDIER 7.875% 04/27 144A	178,000.00	178,615.88	
BOMBARDIER INC 6% 02/28 144A	95,000.00	94,676.05	
BOOST NEWCO BOR 7.5% 1/31 144A	445,000.00	466,791.65	
BOYD GAMING 4.75% 12/01/27	340,000.00	328,735.80	
BRAND INDUSTRIA 10.375% 08/01/30 144A	265,000.00	290,281.00	
BRASKEM IDESA 6.99% 2/32 144A	65,000.00	49,725.00	
BRASKEM IDESA 7.45% 11/29 144A	55,000.00	45,117.05	
BUILDERS F 4.25% 02/01/32 144A	395,000.00	354,437.45	
C AND S GRP 5% 12/15/28 144A	130,000.00	96,879.90	
C&W SR FIN 6.875% 9/15/27 144A	455,000.00	442,510.25	
CABLE ONDA 4.5% 01/30/30 144A	200,000.00	177,300.00	

CAESARS E 8.125% 07/01/27	460,000.00	469,006.80	
CAESARS ENT 6.5% 02/15/32 144A	275,000.00	277,040.50	
CAESARS ENT 7% 02/15/30 144A	700,000.00	719,943.00	
CAESARS ENTERTA 4.625% 10/15/29 144A	195,000.00	179,910.90	
CALIFORNIA 7.125% 02/01/26 144A	295,000.00	295,312.70	
CALIFORNIA RES 8.25% 5/31/29 144A	135,000.00	139,047.30	
CAMELOT FIN SA 4.5% 11/26 144A	175,000.00	171,001.25	
CANACOL E 5.75% 11/24/28 144A	225,000.00	115,312.50	
CARLYLE AVIAT 7% 10/15/24 RGS	160,000.00	159,649.60	
CARNIVAL 10.375% 05/28 144A	285,000.00	308,389.95	
CARNIVAL COR 5.75% 3/1/27 144A	405,000.00	402,788.70	
CARVANA CO PIK VAR 06/01/30 14	29,658.00	32,178.63	
CARVANA CO PIK VAR 06/01/31 14	35,104.00	39,775.28	
CARVANA CO PIK VAR 12/01/28 14	20,038.00	21,509.79	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 04/33 144A	320,000.00	255,843.20	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 05/01/32	145,000.00	118,802.85	
CCO HLDGS/CAP 4.5% 08/30 144A	390,000.00	333,976.50	
CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144	420,000.00	406,102.20	
CCO HLDGS/CAP 7.375% 03/03/31 144A	420,000.00	417,362.40	
CDI ESCROW ISSU 5.75% 04/01/30 144A	290,000.00	283,654.80	
CEC ENT CO LLC 6.75% 5/26 144A	160,000.00	159,078.40	
CEMEX SAB 5.125/VAR PERP 144A	200,000.00	192,200.00	
CENTENE CORP 3.375% 2/15/30 WI	155,000.00	139,128.00	
CENTENE CORP 4.625% 12/15/29	290,000.00	277,588.00	

CENTRAL GARDEN 4.125% 10/15/30	115,000.00	103,670.20	
CHARLES RIV 4.25% 5/1/28 144A	55,000.00	52,323.15	
CHARLES RIVER L 3.75% 03/15/29 144A	55,000.00	50,594.50	
CHARLES RIVER L 4% 03/15/31 144A	160,000.00	144,272.00	
CHEMOURS CO 5.75% 11/15/28 144A	245,000.00	228,962.30	
CHESAPEAKE 5.875% 2/01/29 144A	170,000.00	169,056.50	
CHOBANI LLC 7.625% 07/29 144A	190,000.00	196,186.40	
CHS/CMNTY 10.875% 1/15/32 144A	195,000.00	204,993.75	
CHS/CMNTY HEA 6.875% 04/15/29 144A	220,000.00	173,362.20	
CHS/CMNTY HEALT 4.75% 02/15/31 144A	225,000.00	181,773.00	
CHS/CMNTY HEALT 5.25% 05/15/30 144A	355,000.00	303,507.25	
CHS/CMNTY HEALT 6% 01/15/29 144A	355,000.00	324,448.70	
CHS/CMNTY HEALT 6.125% 04/01/30 144A	415,000.00	302,954.15	
CHS/CMNTY HLT 5.625% 03/15/27 144A	170,000.00	160,296.40	
CITGO PETE COR 7% 6/15/25 144A	410,000.00	410,061.50	
CITGO PETROL 6.375% 06/26 144A	205,000.00	204,971.30	
CLEAN HARBORS 6.375% 2/31 144A	45,000.00	45,416.70	
CLEAR CHAN 7.75% 04/15/28 144A	110,000.00	97,297.20	
CLEAR CHANN 7.875% 4/1/30 144A	290,000.00	294,961.90	
CLEARWY ENR 4.75% 3/15/28 144A	110,000.00	105,417.40	
CLOUD SOFT 8.25% 6/30/32 144A	385,000.00	398,132.35	
CLOUD SOFTWARE 9% 09/30/29 144A	415,000.00	404,305.45	
CLYDESDALE ACQU 6.625% 3/29 144A	70,000.00	69,843.90	

CLYDESDALE ACQUI 8.75% 03/30 144A	425,000.00	419,929.75	
CNX RESOURCE 7.25% 3/1/32 144A	130,000.00	133,530.80	
CNX RESOURCES 7.375% 01/15/31 144A	100,000.00	103,138.00	
CNX RESOURCES C 6% 01/15/29 144A	85,000.00	84,466.20	
COINBASE GLOBAL 3.625% 10/01/31	410,000.00	340,209.80	
COLGATE ENERGY 5.875% 07/01/29	185,000.00	183,150.00	
COMMERCIAL META 3.875% 02/15/31	90,000.00	79,599.60	
COMSTOCK 5.875% 01/15/30 144A	115,000.00	108,221.90	
COMSTOCK RESO 6.75% 03/29 144A	265,000.00	258,973.90	
COMSTOCK RESOUR 6.75% 03/01/29 144A	150,000.00	145,902.00	
CONSLIDATED COM 5% 10/28 144A	100,000.00	83,924.00	
CONSLIDATED ENR 12% 02/31 144A	145,000.00	145,785.90	
CORECIVIC INC 8.25% 04/15/29	145,000.00	152,434.15	
CORELOGIC INC 4.5% 5/1/28 144A	275,000.00	254,251.25	
CORPORACION 6.3% 09/08/53 144A	200,000.00	200,124.00	
COVERT M 4.875% 12/01/29 144A	95,000.00	86,808.15	
CQP HOLDCO 5.5% 06/15/31 144A	530,000.00	510,787.50	
CROCS INC 4.125% 08/15/31 144A	260,000.00	227,663.80	
CROCS INC 4.25% 03/15/29 144A	110,000.00	101,347.40	
CROWDSTRIKE HOL 3% 02/15/29	205,000.00	185,443.00	
CROWNROCK LP / 5% 05/1/29 144A	60,000.00	59,544.60	
CSC HLDGS LLC 11.25% 5/28 144A	220,000.00	196,268.60	
CSC HLDGS LLC 3.375% 02/15/31 144A	230,000.00	152,478.50	

CSC HLDGS LLC 4.125% 12/01/30 144A	170,000.00	117,364.60	
CSC HLDGS LLC 4.5% 11/15/31 144A	160,000.00	110,054.40	
CSC HOLDINGS 7.5% 4/1/28 144A	690,000.00	383,122.50	
CSN RES SA 5.875% 4/8/32 144A	95,000.00	79,230.00	
CT TRUST 5.125% 02/03/32 144A	200,000.00	176,500.00	
CVR ENERGY 5.75% 02/15/28 144A	250,000.00	232,235.00	
CVR PART LP/FIN 6.125% 06/15/28 144A	220,000.00	211,954.60	
DAVITA INC 0% 05/31/30 144A	175,000.00	160,594.00	
DAVITA INC 3.75% 02/15/31 144A	175,000.00	150,433.50	
DELEK LOGISTIC 7.125% 06/01/28 144A	110,000.00	109,786.60	
DISH DBS 5.75% 12/01/28 144A	100,000.00	71,554.00	
DISH NETWK CV 3.375% 8/26 144A	1,460,000.00	889,592.60	
DISH NETWORK CO 11.75% 11/27 144A	150,000.00	149,709.00	
DP WORLD SALA 6%/VAR PERP RGS	200,000.00	198,624.00	
DPL INC 4.35% 04/15/29	529,000.00	491,959.42	
DT MIDSTREAM 4.125% 06/15/29 144A	185,000.00	172,667.90	
DT MIDSTREAM 4.375% 06/15/31 144A	185,000.00	169,911.40	
EG GBL FIN 12% 11/30/28 144A	200,000.00	214,448.00	
EIG PEARL HOLDI 3.545% 08/31/36 144A	225,000.00	193,146.75	
ELASTIC 4.125% 07/15/29 144A	90,000.00	82,766.70	
EMBRAER NETHER 6.95% 1/28 144A	50,000.00	51,562.50	
EMBRAER NETHERL 5.4% 02/01/27	20,000.00	19,843.60	
EMBRAER NETHERL 7% 7/30 144A	70,000.00	72,835.00	

EMERALD DEBT 6.625% 12/30 144A	345,000.00	351,644.70	
EMERGENT B10 3.875% 08/15/30 144A	100,000.00	72,407.00	
EMRLD BORROW 6.75% 07/31 144A	110,000.00	112,475.00	
ENDEAVOR ENERGY 5.75 1/28 144A	375,000.00	378,348.75	
ENDEAVOUR MI 5% 10/14/26 144A	130,000.00	123,865.30	
ENDO FINANCE 8.5% 04/30/31 144A	145,000.00	151,975.95	
ENER 4.875% 3/30/26 144A RGS	125,000.00	119,323.75	
ENFRAGEN ENERG 5.375% 12/30/30 144	230,000.00	193,200.00	
ENLINK MID 5.625% 01/15/28 144A	75,000.00	74,923.50	
EQT MIDSTR 6.5% 07/01/27 144A	215,000.00	219,603.15	
ERO COPPER 6.5% 2/15/30 144A	560,000.00	548,800.00	
ESKOM HLDGS 8.45% 8/28 144A	45,000.00	46,068.75	
FERTITTA ENTERT 4.625% 01/15/29 144A	210,000.00	193,662.00	
FERTITTA ENTERT 6.75% 07/15/30 144A	90,000.00	79,401.60	
FIESTA PU 7.875% 03/01/31 144A	85,000.00	88,427.20	
FIRST QUAN 9.375% 3/1/29 144A	200,000.00	210,812.00	
FIRST QUANT 6.875% 10/27 144A	155,000.00	151,996.10	
FMG RES AG 5.875% 4/15/30 144A	285,000.00	281,440.35	
FMG RES AUG LTD 4.375% 04/01/31 144A	120,000.00	108,693.60	
FORD MTR CR 5.125% 6/16/25	515,000.00	512,038.75	
FORD MTR CR LLC 2.9% 02/16/28	155,000.00	141,769.20	
FORD MTR CR LLC 3.375% 11/13/25	115,000.00	111,709.85	
FORD MTR CR LLC 4% 11/13/30	115,000.00	104,277.40	
FORD MTR CR LLC 4.95% 05/28/27	355,000.00	349,625.30	

FORD MTR CR LLC 6.95% 03/06/26	540,000.00	550,891.80	
FORTRESS TR&INF 7% 05/31 144A	200,000.00	205,932.00	
FORTRESS TR&INF 7% 06/32 144A	140,000.00	143,700.20	
FORWARD AIR COR 9.5% 9/31 144A	195,000.00	184,938.00	
FREEMPORT INDONE 5.315% 04/14/32 144A	200,000.00	195,496.00	
FREMF 15-KPLB B 2.5% 05/25	700,000.00	679,721.00	
FRONT RANGE BID 4% 3/1/27 144A	300,000.00	243,897.00	
FRONT RANGE BIDCO INC 6.125% 0	165,000.00	105,208.95	
FRONTIER 5.875% 11/01/29 144A	52,213.00	46,441.37	
FRONTIER COM 5.875% 10/15/27 144A	170,000.00	167,354.80	
FRONTIER COMM 5% 05/01/28 144A	175,000.00	167,272.00	
FRONTIER COMM 6% 01/31/30 144A	205,000.00	182,261.40	
FRONTIER COMM 8.75% 05/15/30 144A	140,000.00	146,563.20	
GALAXY PIPE 2.625% 03/31/36 144A	200,000.00	164,436.00	
GANNETT HOLDING 6% 11/01/26 144A	95,000.00	91,482.15	
GEMS MENAS 7.125% 7/31/26 144A	880,000.00	878,345.60	
GENESEE & W 6.25% 4/15/32 144A	295,000.00	298,315.80	
GEO GRP INC/THE 10.25% 04/15/31 144A	130,000.00	140,181.60	
GEO GRP INC/THE 8.625% 04/15/29 144A	90,000.00	93,808.80	
GEPARK LTD 5.5% 01/17/27 144A	100,000.00	92,900.00	
GGAM FINANCE LT 6.875% 04/15/29 144A	120,000.00	122,706.00	
GLOBAL PART 8.25% 1/15/32 144A	60,000.00	61,749.60	
GLOBAL PARTNER 6.875% 01/15/29	175,000.00	174,062.00	

GO DADDY OP 5.25% 12/1/27 144A	170,000.00	167,630.20	
GPC MERGER SU 7.125% 8/15/28 144A	100,000.00	94,118.00	
GRAFTECH GLOBAL 9.875% 12/28 144A	110,000.00	88,049.50	
GRAN CO 6.875% 08/09/26 144A	200,000.00	191,000.00	
GRAPHIC PACK 3.75% 02/30 144A	80,000.00	72,424.00	
GREENSAIF PIP 6.129% 2/38 144A	200,000.00	203,562.00	
GREENSAIF PIPE 6.51% 2/42 144A	200,000.00	207,186.00	
HARVEST MIDSTRE 7.5% 9/28 144A	400,000.00	408,608.00	
HEALTHQUITY INC 4.5% 10/01/29 144A	70,000.00	65,620.80	
HERTZ 4.625% 12/01/26 144A	115,000.00	88,890.40	
HERTZ 5% 12/01/29 144A	150,000.00	99,015.00	
HERTZ 5.5% 10/15/24 144A	210,000.00	6,825.00	
HERTZ CORP 6% 01/15/2028 144A	265,000.00	23,850.00	
HERTZ CORP 6.25% 10/15/22	190,000.00	6,175.00	
HERTZ CORP 7.125% 08/01/2026 1	265,000.00	23,850.00	
HESS MIDST 5.125% 6/15/28 144A	220,000.00	215,311.80	
HESS MIDSTREAM 5.5% 10/30 144A	60,000.00	58,455.00	
HIGHTOWER 6.75% 04/15/29 144A	70,000.00	64,176.00	
HILTON DOM 6.125% 4/1/32 144A	85,000.00	85,708.05	
HILTON DOMEST 3.625% 02/15/32 144A	115,000.00	100,465.15	
HILTON DOMESTIC 3.75% 05/01/29	115,000.00	106,426.75	
HILTON DOMESTIC 4% 05/01/31 144A	115,000.00	103,991.05	
HOWARD 7.375% 07/15/32 144A	210,000.00	215,487.30	
HUB INTE 5.625% 12/01/29 144A	135,000.00	129,412.35	

HUB INTER 7.375% 1/31/32 144A	85,000.00	87,468.40	
HUBBAY MINERAL 6.125% 4/01/29 144A	330,000.00	329,891.10	
HUDSON AUTOMOTI 8% 05/32 144A	55,000.00	57,624.60	
ICAHN LP/FN 9% 06/15/30 144A	385,000.00	388,118.50	
IHS HOLDING LTD 5.625% 11/29/2	200,000.00	190,874.00	
IHS NETHERLAND 8% 9/18/27 144A	200,000.00	195,436.00	
II-VI INC 5% 12/15/29 144A	100,000.00	95,851.00	
ILIAD HLDG 8.5% 04/15/31 144A	150,000.00	154,290.00	
INDONESIA ASA 5.45% 05/30 144A	200,000.00	198,186.00	
INTELSAT JACKSN 6.5% 1/30 144A	300,000.00	282,942.00	
INVESTMENT EGY 6.25% 4/29 144A	100,000.00	95,812.00	
JACOBS ENT 6.75% 02/15/29 144A	90,000.00	84,748.50	
JANE ST GRP/JSG 7.125% 04/30/31 144A	195,000.00	201,832.80	
JONAH ENERGY LLC 12% 11/25 P/P	239,713.07	259,201.74	
KENNEDY-WILSON 4.75% 03/01/29	170,000.00	147,407.00	
KENNEDY-WILSON 5% 03/01/31	170,000.00	142,393.70	
KFC CO/PIZZA 4.75% 6/1/27 144A	255,000.00	249,272.70	
KLX ENERGY 11.5% 11/1/25 144A	245,000.00	239,573.25	
KOBE US MID PIK VAR 11/26 144A	435,487.00	356,010.61	
KONDOR FIN 7.625% 11/26 144A	200,000.00	153,000.00	
KOSMOS ENERGY 7.125% 4/26 144A	220,000.00	217,250.00	
KOSMOS ENERGY 7.5% 3/1/28 144A	15,000.00	14,353.05	
KRAFT HEINZ FD 5.5% 06/01/50	70,000.00	67,954.60	
L BRANDS INC 6.625% 10/01/30 144A	350,000.00	354,403.00	

LAMAR FDG LTD 3.958% 5/25 144A	40,000.00	39,578.00	
LAMAR MEDIA CRP 4.875% 01/15/2	140,000.00	135,192.40	
LAMB WESTON 4.125% 01/30 144A	155,000.00	142,482.20	
LBM ACQU LLC 6.25% 1/29 144A	160,000.00	143,526.40	
LCM INVESTMENTS 4.875% 05/01/29 144A	260,000.00	245,135.80	
LCPR SENIOR 5.125% 7/29 144A	400,000.00	333,532.00	
LCPR SR 6.75% 10/15/27 144A	180,000.00	168,820.20	
LEVEL 3 FINL 4% 04/15/31 144A	295,000.00	165,698.55	
LEVEL 3 FINL 4.5% 4/1/30 144A	230,000.00	136,293.40	
LEVIATHAN 6.125% 6/30/25 144A	130,000.00	127,491.00	
LIBERTY COST 10.875% 1/31 144A	100,000.00	105,437.00	
LIGHT & WNDR 7.5% 9/01/31 144A	70,000.00	73,109.40	
LINDBLAD E 6.75% 02/15/27 144A	155,000.00	155,206.15	
LINDBLAD EXPEDI 9% 05/15/28 144A	420,000.00	434,464.80	
LIQUID TELECOMM 5.5% 09/26 144A	200,000.00	122,000.00	
LIVE NATIN 4.75% 10/15/27 144A	230,000.00	222,426.10	
LSB INDUS 6.25% 10/15/28 144A	30,000.00	29,138.40	
MACQUARIE 8.375% 05/01/28 144A	130,000.00	137,234.50	
MACQUARIE AIRF 6.4% 3/29 144A	30,000.00	30,789.00	
MACQUARIE AIRF 6.5% 03/31 144A	45,000.00	46,759.95	
MACQUARIE AIRF 8.125% 3/31/29 144A	90,000.00	95,315.40	
MACYS RTL HLDG 6.125% 03/15/32	75,000.00	71,124.75	
MADISON IAQ 4.125% 06/28 144A	130,000.00	121,274.40	
MADISON IAQ 5.875% 6/29 144A	200,000.00	188,626.00	

MAGIC MERG 5.25% 05/1/28 144A	85,000.00	65,467.85	
MAGIC MERG 7.875% 05/1/29 144A	80,000.00	47,405.60	
MARB BONDC 3.95% 01/29/31 144A	35,000.00	28,617.75	
MASTERBRAND 7% 07/15/32 144A	75,000.00	76,802.25	
MATTEL INC 3.375% 04/01/26 144A	55,000.00	53,105.80	
MC BRAZIL DWNST 7.25% 06/31 144A	561,476.77	516,558.61	
MCLAREN FIN PLC 7.5% 8/26 144A	215,000.00	188,026.10	
MEDCO BELL PTE 6.375% 01/30/27	200,000.00	197,500.00	
MEDLINE BOR 6.25% 4/1/29 144A	150,000.00	152,148.00	
MEG ENERGY CRP 5.875% 02/01/29 144A	255,000.00	251,968.05	
MEITUAN 3.05% 10/28/30 144A	100,000.00	87,326.00	
MELCO RES 7.625% 4/17/32 144A	200,000.00	199,472.00	
MGIC INVT CORP 5.25% 08/15/28	125,000.00	122,635.00	
MICROSTRATEGY 6.125% 06/15/28	250,000.00	245,530.00	
MILEAGE PLUS 6.5% 6/20/27 144A	108,000.00	108,653.40	
MINERAL RES 8.5% 5/1/30 144A	45,000.00	47,001.15	
MINERAL RES LT 8% 11/1/27 144A	180,000.00	184,698.00	
MINERVA MERGE 6.5% 02/15/30 144A	250,000.00	234,647.50	
MISC CAPITAL T 3.75% 4/27 144A	200,000.00	192,562.00	
MITER BRANDS 6.75% 4/1/32 144A	75,000.00	75,761.25	
MIWD HOLDCO II 5.5% 02/01/30 144A	40,000.00	37,404.80	
MOLINA HEA 4.375% 6/15/28 144A	120,000.00	113,943.60	
MOLINA HEALTHCA 3.875% 11/15/30 144A	170,000.00	152,666.80	
MOOG INC 4.25% 12/15/2027 144A	55,000.00	52,303.35	

MOZART DEBT 3.875% 04/01/29 144A	125,000.00	116,487.50	
MPT OPER PARTNE 3.5% 03/15/31	50,000.00	32,560.50	
MURPHY OIL USA 3.75% 02/15/31 144A	95,000.00	84,262.15	
MURPHY OIL USA INC 4.75% 09/15	120,000.00	114,518.40	
NBM US HO 6.625% 08/06/29 144A	55,000.00	54,230.00	
NCL CORP 5.875% 02/15/27 144A	200,000.00	198,334.00	
NCL CORP 7.75% 02/15/29 144A	180,000.00	189,498.60	
NCL CORP LTD 5.875 03/15/26 144A	55,000.00	54,692.55	
NCL FINANCE LTD 6.125% 03/15/28 144A	70,000.00	70,022.40	
NCR ATLEOS ESCR 9.5% 04/01/29 144A	205,000.00	224,077.30	
NEPTUNE BID US 9.29% 4/29 144A	455,000.00	439,075.00	
NESCO HOLDING 5.5% 04/15/29 144A	135,000.00	126,230.40	
NEW COTAI LLC CONV 5% 2/24/27	213,562.76	446,858.68	
NEW FORTRESS EN 6.75% 09/15/25	114,000.00	112,277.46	
NEXA RESOURCES 6.5% 01/18/28 1	68,000.00	68,680.00	
NEXSTAR 5.625% 7/15/27 144A	220,000.00	212,603.60	
NEXTERA ENERGY 4.25% 9/24 144A	21,000.00	20,842.50	
NORTHERN OIL 8.75% 06/31 144A	115,000.00	121,711.40	
NOVA CHEM CORP 9% 02/15/30 144A	145,000.00	154,203.15	
NRG ENERGY INC 3.875% 02/15/32 144A	9,000.00	7,850.70	
NTH OIL & GAS 8.125% 03/01/28 144A	270,000.00	275,464.80	
OCCIDENTAL PETE 4.5% 07/15/44	65,000.00	51,387.70	
OCCIDENTAL PETE 5.875% 9/01/25	115,000.00	115,320.85	

OCCIDENTAL PETE 6.2% 03/15/40	75,000.00	76,692.75	
OCCIDENTAL PETE 6.6% 03/15/46	170,000.00	180,030.00	
OCCIDENTAL PETE 7.5% 05/01/31	175,000.00	195,615.00	
OCCIDENTAL PETRO 4.3% 08/15/39	70,000.00	57,422.40	
OCCIDENTAL PETROLEUM 4.4% 4/46	137,000.00	109,610.96	
OCCIDENTL PETE 8.875% 07/15/30	125,000.00	145,160.00	
OIL & GAS HLDG 7.5% 10/27 144A	200,000.00	206,750.00	
OLYMPUS WTR 9.75% 11/15/28 144A	200,000.00	212,104.00	
OPEN TEXT 4.125% 2/15/30 144A	245,000.00	223,386.10	
OPEN TEXT CORP 3.875% 12/01/29 144A	145,000.00	131,845.60	
OPEN TEXT HOLDI 4.125% 12/01/31 144A	145,000.00	128,932.55	
ORGANON F 4.125% 04/30/28 144A	215,000.00	201,661.40	
ORGANON FINAN 5.125% 04/30/31 144A	215,000.00	196,135.90	
PACIFIC GAS & ELEC 3.95% 12/47	165,000.00	120,436.80	
PACIFIC GAS & ELE 3.75% 8/15/42	30,000.00	22,104.90	
PANTHER 7.125% 6/1/31 144A	155,000.00	159,172.60	
PAO TMK 4.3% 02/12/27 RGS	200,000.00	30,000.00	
PAPA JOHNS IN 3.875% 09/15/29 144A	60,000.00	53,397.60	
PARK INTERMEDIA 7% 2/1/30 144A	65,000.00	66,095.25	
PBF HLD LLC/FIN 6% 02/15/28	150,000.00	146,715.00	
PBF HLD LLC/FIN 7.875% 08/31/30 144A	320,000.00	330,275.20	
PERFORMANCE FO 4.25% 08/01/29 144A	95,000.00	87,490.25	

PETRONAS CAP 3.404% 4/61 144A	40,000.00	26,993.20	
PETRONAS CAP 4.8% 4/21/60 144A	200,000.00	178,064.00	
PETRONAS CAP LTD 3.5% 04/21/20	200,000.00	185,496.00	
PG&E 4.55% 07/01/30	267,500.00	256,297.10	
PG&E 4.95% 07/01/50	947,500.00	801,793.45	
PG&E CORP 5.25% 07/01/30	655,000.00	631,524.80	
PIKE CORP 5.5% 9/01/28 144A	350,000.00	338,243.50	
POLYONE CO 5.75% 5/15/25 144A	140,000.00	139,454.00	
POST HLDGS 6.25% 2/15/32 144A	260,000.00	262,867.80	
PROSUS NV 4.027% 8/3/50 144A	200,000.00	137,374.00	
QORVO INC 4.375% 10/15/29	130,000.00	123,281.60	
RADIATE HOLDC 6.5% 9/15/28 144A	350,000.00	186,287.50	
RADIOLO PIK 8.5%/VAR 1/29 144A	145,001.00	137,025.94	
RAND PARENT LLC 8.5% 02/15/30 144A	380,000.00	379,673.20	
REALOGY GR 5.25% 04/15/30 144A	185,000.00	123,141.55	
REALOGY GROUP 5.75% 01/15/29 144A	210,000.00	143,673.60	
ROBLOX CO 3.875% 05/01/30 144A	415,000.00	372,591.15	
ROLLS-ROYCE PLC 5.75% 10/15/27	175,000.00	176,986.25	
ROYAL CARI 5.375% 7/15/27 144A	140,000.00	138,971.00	
ROYAL CARIBB 6.25% 03/32 144A	120,000.00	122,392.80	
ROYAL CARIBBEAN 4.25% 07/01/26 144A	315,000.00	306,743.85	
ROYAL CARIBBEAN 5.5% 08/31/26	310,000.00	307,985.00	
RURAL/METRO C 10.125 7/19 REGS	10,000.00	-	
SABRE GLBL 8.625% 06/27 144A	221,000.00	208,111.28	
SALLY HOLDINGS 6.75% 3/1/32	210,000.00	208,893.30	

SAMARCO PIK VAR 06/30/31 144A	110,573.00	103,523.96	
SASOL FING USA 4.375% 09/18/26	200,000.00	190,186.00	
SAUDI ARABIAN OIL 4.25% 04/39	765,000.00	668,173.95	
SCIH SALT 4.875% 05/01/28 144A	380,000.00	353,935.80	
SCIH SALT 6.625% 05/01/29 144A	125,000.00	118,471.25	
SCOTTS MIRACLE 4% 04/01/31	115,000.00	100,191.45	
SCRIPPS ESC I 3.875% 01/15/29 144A	160,000.00	109,513.60	
SCRIPPS ESC II 5.375% 01/15/31 144A	80,000.00	39,348.80	
SCRIPPS ESCRO 5.875% 7/27 144A	145,000.00	95,765.25	
SEADRILL FIN 8.375% 08/30 144A	45,000.00	47,034.45	
SEAGATE HDD 8.25% 12/29	95,000.00	102,343.50	
SEAGATE HDD CAY 8.5% 07/15/31	85,000.00	92,132.35	
SEALED AIR 6.125% 2/1/28 144A	150,000.00	151,018.50	
SEASPAN CORPORA 5.5% 08/01/29 144A	260,000.00	232,356.80	
SENSATA TECH 6.625% 7/32 144A	200,000.00	203,902.00	
SENSATA TECHNOL 4% 04/15/29 14	270,000.00	250,994.70	
SERVICE CO INTL 5.125% 6/1/29	105,000.00	102,677.40	
SIMMONS FOOD IN 4.625% 03/29 144A	115,000.00	103,068.75	
SISECAM UK 8.625% 5/02/32 144A	100,000.00	102,281.00	
SOUTHWESTERN EN 4.75% 02/01/32	155,000.00	143,754.75	
SOUTHWESTERN EN 5.375% 02/29	105,000.00	102,407.55	
SPA HOLDINGS 4.875% 2/28 144A	135,000.00	125,718.75	
SPRINGLEAF CORP 4% 09/15/30	205,000.00	180,453.30	
SS&C TECHNOLOGI 6.5% 6/32 144A	340,000.00	344,892.60	

STAPLES 10.75% 09/01/29 144A	95,000.00	91,322.55	
STATION CAS LLC 4.625% 12/01/31 144A	250,000.00	227,330.00	
STATION CAS LLC 6.625% 03/15/32 144A	290,000.00	292,230.10	
STERICYCL 3.875% 01/15/29 144A	115,000.00	108,205.80	
STRATHCONA RE 6.875% 8/26 144A	95,000.00	95,116.85	
STUDIO CITY 6.5% 1/15/28 144A	355,000.00	339,578.80	
SUNOCO LP /CORP 4.5% 05/15/29	160,000.00	151,270.40	
SUNOCO LP /CORP 6% 04/15/27	520,000.00	518,918.40	
SUNOCO LP 7.25% 05/01/32 144A	105,000.00	109,397.40	
SUPERIOR PLUS 4.5% 03/15/29 144A	125,000.00	115,925.00	
SURGERY CTR 7.25% 04/32 144A	205,000.00	213,167.20	
SYNAPTICS INC 4% 06/15/29 144A	90,000.00	82,861.20	
TALLGRASS LP 6% 12/31/30 144A	175,000.00	166,052.25	
TAYLOR MOR 5.875% 6/15/27 144A	165,000.00	165,372.90	
TELEFONICA CE 5.875% 4/27 144A	125,000.00	122,976.25	
TEMPUR SEALY 3.875% 10/15/31 1	170,000.00	145,965.40	
TEMPUR SEALY 4% 04/15/29 144A	180,000.00	163,672.20	
TENET HEALTH 6.125% 10/28	755,000.00	753,195.55	
TENET HEALTH 6.125% 6/30	230,000.00	230,943.00	
TENET HEALTH 6.75% 5/31	115,000.00	117,838.20	
TENET HEALTH 6.875% 11/15/31	25,000.00	26,643.25	
TENGIZCHEVR 3.25% 8/15/30 144A	150,000.00	124,030.50	
TERMOCANDELARIA POWER LTD 7.87	161,000.00	160,697.32	
TERRIER M 8.875% 12/15/27 144A	430,000.00	240,675.30	

TINKOFF CREDIT VAR PERP 144A	200,000.00	10,000.00	
TKC HOLDIN 10.5% 05/15/29 144A	280,000.00	273,478.80	
TKC HOLDINGS 6.875% 5/28 144A	305,000.00	296,441.70	
TOPS MARKETS CORP ESCROW	1,325,000.00	-	
TRANSALTA 7.75% 11/15/29 144A	110,000.00	115,419.70	
TRANSDIGM INC 5.5% 11/15/27	895,000.00	881,575.00	
TRANSDIGM INC 6.375% 03/01/29 144A	390,000.00	395,452.20	
TRANSDIGM INC 6.625% 03/01/32 144A	145,000.00	147,894.20	
TRANSDIGM INC 6.75% 8/28 144A	695,000.00	707,162.50	
TRANSDIGM INC 6.875% 12/15/30 144A	325,000.00	333,765.25	
TRANSOCEAN 8.375% 02/28 144A	86,000.00	89,102.88	
TRANSOCEAN 8.75% 02/15/30 144A	130,500.00	137,034.13	
TRANSOCEAN INC 8.25% 05/15/29 144A	100,000.00	101,185.00	
TRANSOCEAN INC 8.5% 05/15/31 144A	100,000.00	101,532.00	
TREEHOUSE FOODS 4% 09/01/28	60,000.00	54,052.20	
TRI POINTE GROUP 5.7% 06/15/28	55,000.00	54,759.10	
TRITON WAT 6.25% 04/01/29 144A	300,000.00	293,613.00	
TRONOX INC 4.625% 03/15/29 144A	170,000.00	154,273.30	
TTM TECH INC 4% 03/01/29 144A	170,000.00	157,275.50	
TULLOW OI 10.25% 05/15/26 144A	525,000.00	503,175.75	
TULLOW OIL 7% 03/01/25 144A	70,000.00	67,532.50	
TV AZTECA SAB 8.25% 8/9/24 RGS	400,000.00	152,000.00	
UBER TECH I 7.5% 09/15/27 144A	185,000.00	188,907.20	

UBER TECH INC 4.5% 08/15/29 144A	1,105,000.00	1,064,115.00	
UBER TECH INC 6.25% 01/15/28 144A	150,000.00	151,063.50	
UKG INC 6.875% 02/01/31 144A	115,000.00	117,985.40	
UNITED AIRLIN 4.625% 04/30/29 144A	105,000.00	98,758.80	
UNITED RENTAL6.125% 03/34 144A	245,000.00	246,514.10	
UNITI GRP/UNI 6% 01/15/30 144A	465,000.00	313,875.00	
UNITI/FIN 4.75% 04/15/28 144A	145,000.00	124,672.45	
UNITI/FIN/CSL 10.5% 2/28 144A	260,000.00	258,856.00	
UNITI/FIN/CSL 6.5% 02/15/29 144A	260,000.00	183,913.60	
UNIVISION 6.625% 06/01/27 144A	340,000.00	331,734.60	
UNIVISION COM 7.375% 06/30/30 144A	80,000.00	75,621.60	
UNIVISION COMM 8.5% 5/31/31 144A	245,000.00	238,950.95	
US AWYS 12-2 A 4.625% 12/03/26	14,591.92	14,454.17	
US FOODS 7.25% 01/15/32 144A	100,000.00	104,560.00	
US FOODS INC 4.625% 06/01/30 144A	75,000.00	69,928.50	
VALEANT PHARM 5.5% 11/25 144A	145,000.00	136,300.00	
VALLOUREC SA 7.5% 04/32 144A	200,000.00	208,254.00	
VENTURE GBL 6.25% 01/15/30 144A	355,000.00	364,176.75	
VENTURE GLOBAL 3.875% 08/15/29 144	155,000.00	143,723.75	
VICTORIA'S 4.625% 07/29 144A	120,000.00	100,977.60	
VIKING CRUI 9.125% 07/31 144A	55,000.00	59,864.20	
VIPER ENER 5.375% 11/1/27 144A	85,000.00	83,614.50	
VISTAJET MAL/XO 6.375% 02/01/30 144A	310,000.00	244,404.00	

	VOLCAN CO 4.375% 02/11/26 144A	50,000.00	39,281.00	
	VTR COMMUN 5.125% 1/15/28 144A	78,000.00	70,005.00	
	VTR COMMUNICACI 4.375% 04/15/2	100,000.00	85,250.00	
	VZ SECURED FINA 5% 01/15/32 14	500,000.00	435,525.00	
	WALTER ENERGY 9.5% 10/19 144A	735,000.00	-	
	WAND NEWCO 3 7.625% 01/30/32 144A	120,000.00	125,179.20	
	WASH MULT 5.75% 4/15/26 144A	115,000.00	113,394.60	
	WEEKLEY HOMES L 4.875% 09/15/28	80,000.00	75,323.20	
	WINDSTREA 7.75% 08/15/28 144A	415,000.00	397,877.10	
	WOLVERINE 8.5% 11/24 144A	124,000.00	12,090.00	
	WP ROCKET MRGR 10.125 7/19 REG	15,000.00	-	
	WR GRACE 4.875% 06/15/27 144A	215,000.00	207,382.55	
	WR GRACE HLD 7.375% 3/31 144A	275,000.00	281,644.00	
	WR GRACE HLG 5.625% 08/29 144A	165,000.00	150,249.00	
	WYNN RESORTS 7.125% 2/31 144A	345,000.00	359,814.30	
	ZEBRA TECHNOLOG 6.5% 5/32 144A	145,000.00	147,989.90	
	ZIGGO BOND CO 5.125% 02/28/30 144A	90,000.00	78,257.70	
	ZIGGO BV 4.875% 01/15/2030 144	135,000.00	122,643.45	
	アメリカ・ドル 小計	102,537,380.52	91,495,718.95 (14,414,235,564)	
社債券 合計			14,414,235,564 (14,414,235,564)	
合計			34,705,265,144 (33,797,975,850)	

（注1）新株予約権証券における券面総額の数値は証券数を表示しております。

（注2）T B A取引の買約定は、特殊債券に属します。

T B A取引の売約定については、貸借対照表流動負債の「売付債券」に別途計上しておりま
す。

有価証券明細表注記

1. 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に関するもので、内書きであります。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株 予約権証券 時価比率	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 15銘柄	2.07%	-%	-%	86.98%
	新株予約権証券 3銘柄	-%	0.07%	-%	
	国債証券 215銘柄	-%	-%	43.47%	
	特殊債券 96銘柄	-%	-%	6.24%	
	社債券 498銘柄	-%	-%	48.15%	
イギリス・ポンド	国債証券 1銘柄	-%	-%	100%	2.60%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	-%	-%	100%	2.62%
ユーロ	国債証券 1銘柄	-%	-%	100%	7.80%

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

その他特定資産の明細表

特定資産の 種類/通貨	銘柄	数量	帳簿単価 帳簿金額	評価単価 評価金額	評価損益	備考
貸付債権/ アメリカ・ ドル	ACRISURE TERM B6 1LN 11/06/30 C1	14,662.50	99.20 14,545.93	99.89 14,647.25	101.32	-
	AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C1	22,348.62	98.43 21,998.64	100.20 22,395.10	396.46	-
	AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C2	11,251.38	98.43 11,075.18	100.20 11,274.78	199.60	-
	ALLIANT HOLD TM B6 1LN 11/30 C1	86,210.31	99.91 86,138.75	100.45 86,605.15	466.40	-
	APPLIED SYSTEMS TM 2LN 02/32 C1	5,000.00	100.00 5,000.00	103.59 5,179.70	179.70	-
	APPLIED SYSTEMS TM B 1LN 02/31 C1	10,000.00	99.87 9,987.50	100.89 10,089.40	101.90	-
	ASCEND LEARNING TM 2LN 11/29 C1	20,000.00	85.00 17,000.00	96.87 19,375.00	2,375.00	-
	ASSETMARK TERM 1LN 05/30/2031	20,000.00	99.75 19,950.00	99.56 19,912.60	37.40	-
	ATHENAHEALTH TM B 1LN 02/15/29 C1	200,941.06	97.09 195,099.70	99.65 200,249.82	5,150.12	-
	BAYER ENVIR SCI TERM 1LN 10/29 C1	162,537.35	97.32 158,187.85	99.76 162,153.76	3,965.91	-
	CLEAR CHANNEL TM B 1LN 08/27 C1	245,000.00	99.00 242,550.00	97.50 238,875.00	3,675.00	-
	CONSOLIDATED EN TM B 1LN 11/30 C1	144,637.50	96.99 140,298.37	95.16 137,647.16	2,651.21	-

CORELOGIC TERM B 1LN 06/02/28 C1	354,531.66	90.37 320,393.80	98.37 348,770.52	28,376.72	-
COTIVITI INC TERM 1LN 05/01/31 C1	145,000.00	100.00 145,000.00	99.20 143,851.60	1,148.40	-
COTIVITI TM B 1LN 05/01/31 C1	34,912.50	99.49 34,737.93	100.25 34,999.78	261.85	-
COX MEDIA TM B 1LN INCR 12/26 C1	296,163.70	90.30 267,462.47	81.36 240,970.63	26,491.84	-
CSC SERVICEWORKS TM B 1LN 3/28 C1	441,147.98	85.43 376,916.83	82.20 362,658.93	14,257.90	-
EXAMWORKS TERM B 1LN 11/01/28 C1	19,550.00	99.84 19,518.91	100.22 19,593.98	75.07	-
FINASTRA TSFR3M+725 1LN 09/29 C1	413,833.69	97.99 405,552.87	100.00 413,833.69	8,280.82	-
FINASTRA TSFR3M+725 1LN 09/29 C1	9,664.91	97.99 9,471.61	100.00 9,664.91	193.30	-
FRST EAGLE TERM B 1LN 2/1/27 C1	0.03	66.66 0.02	99.37 0.02	-	-
GREAT OUTDOOR TM B1 1LN 3/5/28 C1	458,473.01	99.63 456,817.92	100.12 459,046.10	2,228.18	-
HUNTER DOUGLAS TERM B 1LN 2/29 C1	75,264.00	96.30 72,486.00	99.32 74,755.96	2,269.96	-
HUNTER DOUGLAS TERM B 1LN 2/29 C2	27,636.00	96.30 26,615.95	99.32 27,449.45	833.50	-
INTERNET BRANDS TM B 1LN 04/28 C1	345,973.66	96.58 334,158.65	99.81 345,326.68	11,168.03	-
MULTI-COLOR TM B 1LN 10/29/28 C1	360,750.00	99.42 358,690.11	97.81 352,860.39	5,829.72	-
NEPTUNE BID US 1 TERM B 04/29 C1	306,125.00	87.77 268,688.97	94.05 287,931.99	19,243.02	-
NORTHEAST GROCE TM B 1LN 12/28 C1	50,000.00	97.00 48,500.00	100.12 50,062.50	1,562.50	-
SANCHEZ DIP ROLL UP TL 5/11/20 C1	89,000.00	- -	- -	-	-
SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C1	108,722.08	- -	- -	-	-
SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C2	98,160.45	- -	- -	-	-
SOFTBANK SVF II TERM 1LN 12/24 C1	536,446.67	100.98 541,741.39	98.88 530,438.46	11,302.93	-
SUBCOM TERM B 1LN 01/30/2031 C1	30,000.00	99.00 29,700.00	100.42 30,127.50	427.50	-
SUNSOURCE TERM 1LN 03/25/31 C1	44,887.50	99.49 44,663.06	100.54 45,130.79	467.73	-
TOPGLF CLL TERM B 1LN 03/09/30 C1	23,687.50	99.88 23,660.97	100.23 23,742.45	81.48	-

TRANSDIGM TERM K 1LN 03/15/30 C1	271,626.14	100.23 272,259.02	100.32 272,495.34	236.32	-
TRUIST INSURANCE TM 2L 03/32 C1	160,000.00	100.00 160,000.00	102.55 164,086.40	4,086.40	-
UBER TERM B 1LN 03/01/30 C1	113,952.04	100.00 113,960.01	100.44 114,456.84	496.83	-
UKG TERM B 1LN 02/10/31 C1	579,477.42	99.32 575,555.70	100.43 582,015.53	6,459.83	-
貸付債権 / アメリカ・ドル 小計		5,828,384.11 (918,203,633)	5,862,675.16 (923,605,845)	34,291.05 (5,402,212)	
貸付債権 合計		918,203,633 (918,203,633)	923,605,845 (923,605,845)	5,402,212 (5,402,212)	
合計		918,203,633 (918,203,633)	923,605,845 (923,605,845)	5,402,212 (5,402,212)	

1. 小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

Aコース（為替ヘッジ付き）

（2024年8月30日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	18,521,265,537	円
負債総額	13,138,147	円
純資産総額（ - ）	18,508,127,390	円
発行済数量	39,558,038,221	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.4679	円

Bコース（為替ヘッジなし）

（2024年8月30日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	5,031,361,233	円
負債総額	3,159,085	円
純資産総額（ - ）	5,028,202,148	円
発行済数量	7,204,320,919	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6979	円

（参考）マザーファンドの純資産額計算書

フィデリティ・ストラテジック・インカム・マザーファンド

（2024年8月30日現在）

種 類	金 額	単 位
資産総額	38,087,394,100	円
負債総額	640,873,104	円
純資産総額（ - ）	37,446,520,996	円
発行済数量	8,265,790,724	口
1単位当たり純資産額（ / ）	4.5303	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（2024年2月末日現在）

（略）

< 訂正後 >

(1) 資本金等（2024年8月末日現在）

（略）

2【事業の内容及び営業の概況】

< 訂正前 >

（略）

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。

< 訂正後 >

（略）

2024年8月30日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、追加型株式投資信託176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6,194,119,636,582円です。

3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

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

財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。第39期事業年度の中間会計期間（2024年1月1日から2024年6月30日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により中間監査を受けております。

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

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

	第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					純資産合計
	資本金	利益剰余金			株主資本合計	
		利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	1,000,000	250,000	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					純資産合計
	資本金	利益剰余金			株主資本合計	
		利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	1,000,000	250,000	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	第38期
	(2022年12月31日)	(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	第38期
	(2022年12月31日)	(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。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

		第39期中間会計期間末 (2024年6月30日)	
科目	注記 番号	金額 (千円)	構成比 (%)
(資産の部)			
流動資産			
現金及び預金		2,812,717	
未収委託者報酬		11,491,045	
未収運用受託報酬		546,945	
未収収益		1,875	
未収入金		217,153	
その他		88,005	
流動資産計		15,157,741	55.4
固定資産			
無形固定資産			
無形固定資産		7,487	
投資その他の資産			
長期貸付金		11,888,660	
長期差入保証金		11,755	
会員預託金		230	
繰延税金資産		288,014	
投資その他の資産計		12,188,660	44.6
固定資産計		12,196,147	44.6
資産合計		27,353,889	100.0

		第39期中間会計期間末 (2024年6月30日)	
科目	注記 番号	金額 (千円)	構成比 (%)
(負債の部)			
流動負債			
未払手数料		5,328,744	
その他未払金		2,430,004	
未払費用		1,597,606	
未払法人税等		1,832,277	
賞与引当金		741,477	
未払消費税等	*1	1,036,186	
その他		12	
流動負債計		12,966,309	47.4
固定負債			
退職給付引当金		1,995,763	
固定負債計		1,995,763	7.3
負債合計		14,962,073	54.7
(純資産の部)			
株主資本			
資本金		1,000,000	
利益剰余金			
利益準備金		250,000	
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		11,141,816	
利益剰余金合計		11,391,816	
株主資本合計		12,391,816	45.3
純資産合計		12,391,816	45.3
負債・純資産合計		27,353,889	100.0

(2) 中間損益計算書

		第39期中間会計期間 自 2024年1月1日 至 2024年6月30日	
科目	注記 番号	金額 (千円)	百分比 (%)
営業収益			
委託者報酬		34,574,853	
運用受託報酬		2,191,830	
その他営業収益		75,363	
営業収益計		36,842,047	100.0
営業費用及び一般管理費		30,803,706	83.6
営業利益		6,038,340	16.4
営業外収益	*2	12,928	0.0
営業外費用	*3	199,989	0.5
経常利益		5,851,279	15.9
特別損失			
特別退職金		190,390	0.5
特別損失計		190,390	0.5
税引前中間純利益		5,660,889	15.4
法人税等	*1	1,832,226	5.0
中間純利益		3,828,662	10.4

注記事項
(重要な会計方針)

項目	第39期中間会計期間 自 2024年1月1日 至 2024年6月30日
1 引当金の計上基準	<p>(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中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 過去勤務債務については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による按分額を定額法により費用処理しております。数理計算上の差異については、発生年度に全額費用処理しております。</p>
2 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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時間で支払いを受けます。</p>
3 その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>(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す。</p> <p>(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。</p>

(中間貸借対照表関係)

項目	第39期中間会計期間末 2024年6月30日
*1 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「未払消費税等」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

項目	第39期中間会計期間 自 2024年1月1日 至 2024年6月30日
*1 税金費用の取扱い	税金費用については、簡便法による税効果会計を適用しているため、法人税等調整額は法人税等に含めて表示しております。
*2 営業外収益の主要な項目	営業外収益のうち主要な項目は以下のとおりであります。 貸付金利息 12,657千円
*3 営業外費用の主要な項目	営業外費用のうち主要な項目は以下のとおりであります。 為替差損 199,831千円

(金融商品関係)

第39期中間会計期間(2024年6月30日)

1. 金融商品の時価等に関する事項

2024年6月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 長期貸付金	11,888,660	11,888,660	-
資産計	11,888,660	11,888,660	-

(注) 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。長期差入保証金及び会員預託金については、重要性が乏しいため、注記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。

2. 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。

(1) 時価で中間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) 時価で中間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(千円)			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1) 長期貸付金	-	11,888,660	-	11,888,660
資産計	-	11,888,660	-	11,888,660

(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。

(資産除去債務関係)

第39期中間会計期間(2024年6月30日)

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

(収益認識関係)

第39期中間会計期間(自 2024年1月1日 至 2024年6月30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	34,574,853	-	34,574,853
運用受託報酬	1,616,810	575,019	2,191,830
その他営業収益	75,363	-	75,363
合計	36,267,027	575,019	36,842,047

2. 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針に係る事項に関する注記の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中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後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	14,381,326	12,037,991

(注)なお、当中間会計期間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39期中間会計期間(自 2024年1月1日 至 2024年6月30日)

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第39期中間会計期間(自 2024年1月1日 至 2024年6月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の名称	委託者報酬 (単位:千円)	関連する セグメント名
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)	5,465,806	資産運用業
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	5,163,887	資産運用業
フィデリティ・US リート・ファンドB(為替ヘッジなし)	4,651,777	資産運用業
フィデリティ・日本成長株・ファンド	3,890,726	資産運用業

(1株当たり情報)

	第39期中間会計期間 自 2024年1月1日 至 2024年6月30日
1株当たり純資産額	619,590.80円
1株当たり中間純利益金額	191,433.14円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額	3,828,662千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	3,828,662千円
普通株式の期中平均株式数	20,000株

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

(重要な後発事象)

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 (2024年3月末日現在)	事業の内容
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。
<参考情報> 再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	
販売会社	auカブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
	大和証券株式会社	100,000百万円	
	野村證券株式会社	10,000百万円	
	岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	
	フィデリティ証券株式会社	12,657百万円	
	S M B C 日興証券株式会社	135,000百万円	
	株式会社 S B I 証券	54,323百万円	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	
	楽天証券株式会社	19,495百万円	
	マネックス証券株式会社	13,195百万円	
	静銀ティーエム証券株式会社	3,000百万円	
	西日本シティ T T 証券株式会社	3,000百万円	
	松井証券株式会社	11,945百万円	
	十六 T T 証券株式会社	3,000百万円	
O K B 証券株式会社	1,500百万円		
あかつき証券株式会社	3,067百万円		

三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社名古屋銀行	25,090百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社京都銀行	42,103百万円	
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958百万円	
株式会社第四北越銀行	32,776百万円	
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
ソニー銀行株式会社	38,500百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社北陸銀行	140,409百万円	
株式会社福岡銀行	82,300百万円	
株式会社三十三銀行	37,461百万円	
株式会社熊本銀行	10,000百万円	
株式会社十八親和銀行	36,800百万円	
日本生命保険相互会社	1,450,000百万円* *相互会社であるため、「基金」の額です。	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
明治安田生命保険相互会社	980,000百万円* *相互会社であるため、「基金」の額です。	

運用の委託先	FILインベストメンツ・ インターナショナル	225,365英ポンド (約40百万円 [*]) * 1英ポンド180.68円で 換算 (2023年12月末日現在)	主として英国および ヨーロッパにおいて投 資信託の販売および投 資信託会社に対する投 資運用業務を営んでい ます。
	FIL(ルクセンブル グ)・エスエイ	1,547,850ユーロ (約243百万円 [*]) * 1ユーロ157.12円で換算 (2023年12月末日現在)	主としてルクセンブル グおよびヨーロッパに おいて知的財産の保有 または管理、ファンド の運用および販売業務 を営んでいます。
	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。

新規募集は行ないません。

独立監査人の監査報告書

2024年10月16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 鶴見 将史
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているフィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）の2024年1月23日から2024年7月22日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジ付き）の2024年7月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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10月16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 鶴見 将史
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているフィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）の2024年1月23日から2024年7月22日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、フィデリティ・ストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）の2024年7月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2024年9月2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

中間監査意見

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2024年1月1日から2024年12月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2024年1月1日から2024年6月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、フィデリティ投信株式会社の2024年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年1月1日から2024年6月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・ 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。
- ・ 中間財務諸表に対する意見表明の基礎となる、中間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ために、中間財務諸表の中間監査を計画し実施する。監査人は、構成単位の財務情報の中間監査に関する指揮、監督及び査閲に関して責任がある。監査人は、単独で中間監査意見に対して責任を負う。

監査人は、監査役に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。