

【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】	2025年8月20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・ハイ・イールド・ボンド・オープン ポートフォリオB（為替ヘッジあり）
【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】	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、2025年2月19日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するとともに、その他の情報について訂正すべき事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（3）【ファンドの仕組み】

＜訂正前＞

（略）

④ 委託会社の概況（2024年12月末日現在）

（略）

＜訂正後＞

（略）

④ 委託会社の概況（2025年6月末日現在）

（略）

3【投資リスク】

<訂正前>

(1) 投資リスク

(略)

■その他の留意点

(略)

<エマージング市場に関わる留意点>

エマージング市場（新興諸国市場）への投資においては、政治・経済的不確実性、決済システム等市場インフラの未発達、情報開示制度や監督当局による法制度の未整備、為替レートの変動、外国への送金規制等の状況によって有価証券の価格変動が大きくなる場合があります。

<ファミリーファンド方式にかかる留意点>

ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等に伴い、マザーファンドにおいて売買が生じ、ファンドの基準価額が影響を受ける場合があります。

(略)

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2020年1月～2024年12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。

※2020年1月～2024年12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写、使用、頒布することは禁じられています。 Copyright © 2022 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複写・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>

(1) 投資リスク

(略)

■その他の留意点

(略)

<カントリー・リスク>

投資対象国及び地域の政治・経済・社会情勢等の変化、証券市場・為替市場における脆弱性や規制等の混乱により、有価証券の価格変動が大きくなる場合があります。税制・規制等は投資対象国及び地域の状況により異なり、また、それらが急遽変更されたり、新たに導入されたりすることがあります。これらの要因により、運用上の制約を受ける場合やファンドの基準価額の変動に影響を与える場合があります。なお、新興国への投資は先進国に比べて、上記のリスクの影響が大きくなる可能性があります。

<ファミリーファンド方式にかかる留意点>

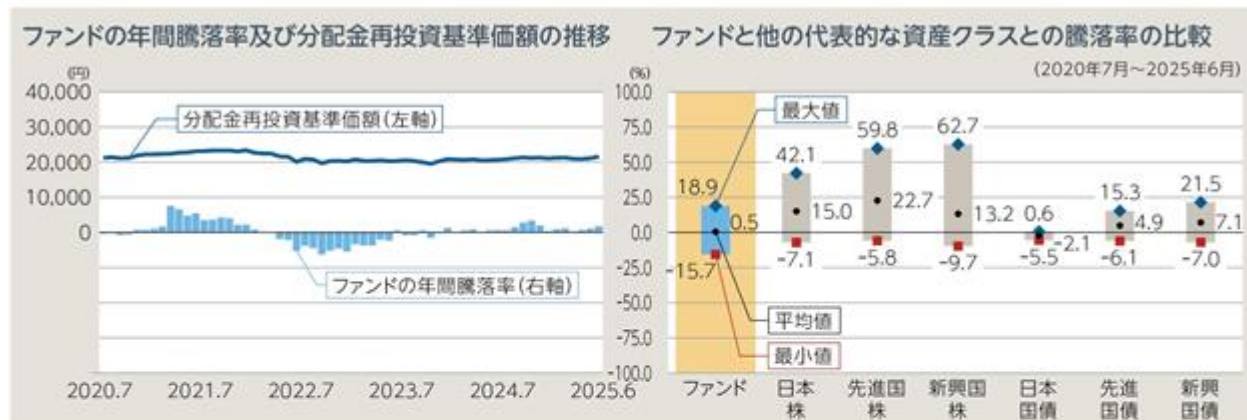
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等に伴い、マザーファンドにおいて売買が生じ、ファンドの基準価額に影響を受ける場合があります。

<購入・換金申込受付の中止及び取消しについての留意点>

金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策の変更や資産凍結を含む規制の導入、クーデターや重大な政治体制の変更等））があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止すること、及び既に受付けた購入・換金のお申込みの受付を取消す場合があります。

(略)

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



※「ファンドの年間騰落率」は、ファンドの2020年7月～2025年6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。

※2020年7月～2025年6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に係る標章又は商標は、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に係る標章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・ダイバースファイド (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】

（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12月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更となる場合があります。

（略）

（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・ハイ・イールド・ボンド・ オープン ポートフォリオB (為替ヘッジあり)	1.82%	1.70%	0.12%

(比率は年率、表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間は2024年5月23日～2024年11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。

<訂正後>

（略）

※ 上記「（５）課税上の取扱い」の記載は、2025年6月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更となる場合があります。

（略）

（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・ハイ・イールド・ボンド・ オープン ポートフォリオB (為替ヘッジあり)	1.83%	1.71%	0.13%

(比率は年率、表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間は2024年11月23日～2025年5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】

（2025年6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	2,308,618,847	99.80
預金・その他の資産（負債控除後）	—	4,701,754	0.20
合計（純資産総額）		2,313,320,601	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

（2025年6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	2,297,375,893	△99.31

（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。

（参考）マザーファンドの投資状況

フィデリティ・ハイ・イールド・ボンド・オープン・マザーファンド

（2025年6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	260,213,798	3.16
	ケイマン諸島	10,565,914	0.13
	イギリス	1,306,402	0.02
	小計	272,086,114	3.31
新株予約権証券	イギリス	2,905,940	0.04
	アメリカ	1,114,424	0.01
	小計	4,020,364	0.05
国債証券	アメリカ	1,889,514	0.02
	小計	1,889,514	0.02
社債券	アメリカ	5,817,002,356	70.72
	カナダ	315,582,352	3.84
	イギリス	175,262,471	2.13
	フランス	151,294,302	1.84
	ケイマン諸島	121,420,059	1.48
	オランダ	91,255,692	1.11
	アイルランド	90,633,161	1.10
	オーストラリア	75,015,779	0.91
	バミューダ	50,112,614	0.61
	パナマ	45,607,881	0.55
	リベリア	35,933,436	0.44
	ルクセンブルグ	31,526,295	0.38
	日本	29,315,047	0.36
	マルタ	20,321,984	0.25
	マーシャル諸島	17,150,391	0.21
	シンガポール	7,353,307	0.09
	小計	7,074,787,127	86.02
預金・その他の資産（負債控除後）	—	872,173,684	10.60
合計（純資産総額）		8,224,956,803	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

(2025年6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	6,257,849	△0.08
貸付債権	アメリカ	622,172,675	7.56

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

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

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

(2025年6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・ハイ・イールド・ボンド・オープン・マザーファンド	日本	249,337,817	9.2871	2,315,649,669	9.2590	2,308,618,847	99.80

種類別投資比率

(2025年6月30日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.80

（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・ハイ・イールド・ボンド・オープン・マザーファンド

（2025年6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	MESQUITE ENERGY INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 エネルギー	5,503	12,641.91 69,568,447	29,151.70 160,421,811	0.000 —	1.95
2	ALTICE FRANCE 5.125% 7/29 RGS	アメリカ・ドル フランス	社債券 —	700,000	12,185.90 85,301,344	12,055.43 84,388,027	5.125 2029/07/15	1.03
3	ECHOSTAR CORP 10.75% 11/30/29	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	491,922	14,603.36 71,837,162	14,921.80 73,403,624	10.750 2029/11/30	0.89
4	CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	475,000	14,343.86 68,133,358	14,434.52 68,563,950	5.125 2027/05/01	0.83
5	CHS/CMNTY HEAL 4.75% 02/15/31 REGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	410,000	12,380.24 50,758,989	12,423.54 50,936,512	4.750 2031/02/15	0.62
6	ACRISURE LLC 6% 08/01/29 RGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	350,000	13,901.76 48,656,160	14,047.15 49,165,022	6.000 2029/08/01	0.60
7	EG GBL FIN 12% 11/30/28 RGS	アメリカ・ドル イギリス	社債券 —	300,000	16,029.30 48,087,925	15,986.73 47,960,203	12.000 2028/11/30	0.58
8	WINDSTREAM ESCR 8.25% 10/01/31 RGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	310,000	15,011.72 46,536,358	15,123.96 46,884,264	8.250 2031/10/01	0.57
9	TRANSDIGM INC 6.375% 05/31/33 REGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	320,000	14,281.74 45,701,572	14,476.37 46,324,371	6.375 2033/05/31	0.56
10	ECHOST CRP CNV 3.875% 11/12/30	アメリカ・ドル アメリカ	外国新 株予約 権付社 債(CB) —	264,697	15,308.72 40,521,747	17,290.17 45,766,556	3.875 2030/11/30	0.56
11	ECHOSTAR CORP PIK VAR 11/30/30	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	335,337	13,140.48 44,064,919	13,250.11 44,432,537	6.750 2030/11/30	0.54
12	TRANSDIGM INC 6% 01/15/33 RGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	300,000	14,355.01 43,065,045	14,506.05 43,518,156	6.000 2033/01/15	0.53
13	TENET HEALTHCARE 6.25% 2/1/27	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	300,000	14,508.51 43,525,541	14,478.83 43,436,483	6.250 2027/02/01	0.53
14	ALLIANT HLDGS 5.875% 11/01/29 RGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	300,000	14,067.56 42,202,702	14,265.38 42,796,133	5.875 2029/11/01	0.52
15	SCIH SALT HLDG 4.875% 5/28 RGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	300,000	13,995.16 41,985,487	14,067.42 42,202,267	4.875 2028/05/01	0.51
16	PRIMO WATER HOL 6.25% 04/01/29	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	290,000	14,489.97 42,020,936	14,517.78 42,101,567	6.250 2029/04/01	0.51
17	CSC HLDGS 5.5% 04/15/27 144A	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	300,000	13,425.76 40,277,308	13,805.17 41,415,515	5.500 2027/04/15	0.50
18	CLOUD SOFTWARE 9% 09/30/29 REGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	275,000	14,734.70 40,520,444	14,950.33 41,113,405	9.000 2029/09/30	0.50
19	MINERVA MERGER 6.5% 02/15/30 REGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	270,000	13,904.94 37,543,353	14,228.60 38,417,209	6.500 2030/02/15	0.47

20	ICAHN LP/FN COR 5.25% 05/15/27	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	270,000	13,744.06 37,108,967	13,990.96 37,775,599	5.250 2027/05/15	0.46
21	TENET HEALTH 6.125% 10/28	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	250,000	14,470.71 36,176,796	14,511.27 36,278,163	6.125 2028/10/01	0.44
22	ARTERA SERVICES 8.5% 1/31/31 RGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	300,000	12,568.20 37,704,614	12,027.34 36,082,018	8.500 2031/02/15	0.44
23	II-VI INC 5% 12/15/29 RGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	250,000	14,032.23 35,080,584	14,210.64 35,526,599	5.000 2029/12/15	0.43
24	ASGN INC 4.625% 05/15/28 144A	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	235,000	13,869.90 32,594,269	14,071.62 33,068,312	4.625 2028/05/15	0.40
25	CABLEVS LHT LLC 5.625% 9/15/28 RGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	235,000	13,759.99 32,335,978	13,977.21 32,846,434	5.625 2028/09/15	0.40
26	PIKE CORP 5.5% 09/01/2028 RGS	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	225,000	14,310.99 32,199,734	14,450.30 32,513,175	5.500 2028/09/01	0.40
27	CHOBANI LLC/FIN 8.75% 10/01/29 RE	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	208,392	15,454.26 32,205,457	15,537.97 32,379,882	9.500 2029/10/01	0.39
28	1261229 BC LTD 10% 04/15/32 RGS	アメリカ・ドル カナダ	社債券 —	215,000	14,356.02 30,865,462	14,590.62 31,369,835	10.000 2032/04/15	0.38
29	VISTRA OPERATI 5% 7/31/27 144A	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	215,000	14,412.64 30,987,196	14,438.43 31,042,615	5.000 2027/07/31	0.38
30	CHS/CMNTY HEALT 10.875% 01/15/	アメリカ・ドル アメリカ	社債券 —	200,000	15,277.45 30,554,910	15,422.26 30,844,530	10.875 2032/01/15	0.38

（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・ハイ・イールド・ボンド・オープン・マザーファンド

（2025年6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	2.17
		運輸	0.00
		消費者サービス	0.06
		一般消費財・サービス流通・小売り	0.00
		生活必需品流通・小売り	0.32
		ヘルスケア機器・サービス	0.15
		銀行	0.17
		ソフトウェア・サービス	0.08
		公益事業	0.23
		メディア・娯楽	0.13
	小計		3.31
新株予約権証券	外国	—	0.05
	小計		0.05
公社債券	国内	社債券	0.36
	小計		0.36
	外国	国債証券	0.02
		社債券	85.66
	小計		85.68
合計（対純資産総額比）			89.40

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

（2025年6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	アメリカ・ドル	売建	15,923,700	2,322,775,787	2,297,375,893	△99.31

（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・ハイ・イールド・ボンド・オープン・マザーファンド

（2025年6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	アメリカ・ドル	売建	43,228	6,238,687	6,257,849	△0.08
貸付債権	アメリカ・ドル	—	4,755,643.14	617,715,190	622,172,675	7.56

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

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

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

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

2025年6月末日および同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次のとおりです。

年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり純資産額 (円) (分配落)	1口当たり純資産額 (円) (分配付)
2015年11月24日 (第26特定期間)	9,625	9,692	0.6439	0.6484
2016年5月23日 (第27特定期間)	8,169	8,228	0.6129	0.6174
2016年11月22日 (第28特定期間)	7,970	8,016	0.6081	0.6116
2017年5月22日 (第29特定期間)	7,870	7,914	0.6213	0.6248
2017年11月22日 (第30特定期間)	8,657	8,686	0.6126	0.6146
2018年5月22日 (第31特定期間)	7,630	7,656	0.5956	0.5976
2018年11月22日 (第32特定期間)	6,576	6,599	0.5708	0.5728
2019年5月22日 (第33特定期間)	6,020	6,040	0.5818	0.5838
2019年11月22日 (第34特定期間)	4,713	4,729	0.5751	0.5771
2020年5月22日 (第35特定期間)	4,059	4,074	0.5255	0.5275
2020年11月24日 (第36特定期間)	4,134	4,148	0.5602	0.5622
2021年5月24日 (第37特定期間)	4,057	4,071	0.5713	0.5733
2021年11月22日 (第38特定期間)	3,923	3,937	0.5740	0.5760
2022年5月23日 (第39特定期間)	3,130	3,142	0.5026	0.5046
2022年11月22日 (第40特定期間)	2,892	2,904	0.4780	0.4800
2023年5月22日 (第41特定期間)	2,698	2,710	0.4657	0.4677
2023年11月22日 (第42特定期間)	2,403	2,413	0.4487	0.4507
2024年5月22日 (第43特定期間)	2,322	2,333	0.4509	0.4529
2024年11月22日 (第44特定期間)	2,382	2,393	0.4502	0.4522
2025年5月22日 (第45特定期間)	2,269	2,279	0.4338	0.4358
2024年6月末日	2,367	—	0.4481	—

2024年7月末日	2,345	—	0.4501	—
2024年8月末日	2,452	—	0.4536	—
2024年9月末日	2,457	—	0.4565	—
2024年10月末日	2,394	—	0.4509	—
2024年11月末日	2,384	—	0.4510	—
2024年12月末日	2,514	—	0.4440	—
2025年1月末日	2,493	—	0.4459	—
2025年2月末日	2,452	—	0.4446	—
2025年3月末日	2,341	—	0.4363	—
2025年4月末日	2,288	—	0.4330	—
2025年5月末日	2,280	—	0.4354	—
2025年6月末日	2,313	—	0.4432	—

②【分配の推移】

期	1口当たりの分配金(円)
第26特定期間（第162期～第167期計算期間合計）	0.0280
第27特定期間（第168期～第173期計算期間合計）	0.0270
第28特定期間（第174期～第179期計算期間合計）	0.0260
第29特定期間（第180期～第185期計算期間合計）	0.0210
第30特定期間（第186期～第191期計算期間合計）	0.0180
第31特定期間（第192期～第197期計算期間合計）	0.0120
第32特定期間（第198期～第203期計算期間合計）	0.0120
第33特定期間（第204期～第209期計算期間合計）	0.0120
第34特定期間（第210期～第215期計算期間合計）	0.0120
第35特定期間（第216期～第221期計算期間合計）	0.0120
第36特定期間（第222期～第227期計算期間合計）	0.0120
第37特定期間（第228期～第233期計算期間合計）	0.0120
第38特定期間（第234期～第239期計算期間合計）	0.0120
第39特定期間（第240期～第245期計算期間合計）	0.0120
第40特定期間（第246期～第251期計算期間合計）	0.0120
第41特定期間（第252期～第257期計算期間合計）	0.0120
第42特定期間（第258期～第263期計算期間合計）	0.0120
第43特定期間（第264期～第269期計算期間合計）	0.0120
第44特定期間（第270期～第275期計算期間合計）	0.0120
第45特定期間（第276期～第281期計算期間合計）	0.0120

③【収益率の推移】

期	収益率(%)
第26特定期間（第162期～第167期計算期間合計）	△6.6
第27特定期間（第168期～第173期計算期間合計）	△0.6
第28特定期間（第174期～第179期計算期間合計）	3.5
第29特定期間（第180期～第185期計算期間合計）	5.6
第30特定期間（第186期～第191期計算期間合計）	1.5
第31特定期間（第192期～第197期計算期間合計）	△0.8
第32特定期間（第198期～第203期計算期間合計）	△2.1
第33特定期間（第204期～第209期計算期間合計）	4.0
第34特定期間（第210期～第215期計算期間合計）	0.9
第35特定期間（第216期～第221期計算期間合計）	△6.5
第36特定期間（第222期～第227期計算期間合計）	8.9
第37特定期間（第228期～第233期計算期間合計）	4.1
第38特定期間（第234期～第239期計算期間合計）	2.6
第39特定期間（第240期～第245期計算期間合計）	△10.3
第40特定期間（第246期～第251期計算期間合計）	△2.5
第41特定期間（第252期～第257期計算期間合計）	△0.1
第42特定期間（第258期～第263期計算期間合計）	△1.1
第43特定期間（第264期～第269期計算期間合計）	3.2
第44特定期間（第270期～第275期計算期間合計）	2.5
第45特定期間（第276期～第281期計算期間合計）	△1.0

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

(4) 【設定及び解約の実績】

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

期	設定数量 (口)	解約数量 (口)	発行済数量 (口)
第26特定期間 (2015年5月23日～2015年11月24日)	594,451,376	4,024,490,048	14,949,002,959
第27特定期間 (2015年11月25日～2016年5月23日)	731,360,275	2,352,894,193	13,327,469,041
第28特定期間 (2016年5月24日～2016年11月22日)	1,212,953,104	1,432,933,188	13,107,488,957
第29特定期間 (2016年11月23日～2017年5月22日)	1,961,400,401	2,402,018,501	12,666,870,857
第30特定期間 (2017年5月23日～2017年11月22日)	3,507,409,257	2,041,266,931	14,133,013,183
第31特定期間 (2017年11月23日～2018年5月22日)	770,242,754	2,090,047,135	12,813,208,802
第32特定期間 (2018年5月23日～2018年11月22日)	204,182,797	1,496,935,327	11,520,456,272
第33特定期間 (2018年11月23日～2019年5月22日)	146,573,096	1,319,957,360	10,347,072,008
第34特定期間 (2019年5月23日～2019年11月22日)	155,308,384	2,306,698,705	8,195,681,687
第35特定期間 (2019年11月23日～2020年5月22日)	159,788,117	630,927,095	7,724,542,709
第36特定期間 (2020年5月23日～2020年11月24日)	185,486,949	530,665,729	7,379,363,929
第37特定期間 (2020年11月25日～2021年5月24日)	292,411,987	570,366,924	7,101,408,992
第38特定期間 (2021年5月25日～2021年11月22日)	129,461,197	394,161,882	6,836,708,307
第39特定期間 (2021年11月23日～2022年5月23日)	164,496,538	774,163,022	6,227,041,823
第40特定期間 (2022年5月24日～2022年11月22日)	335,886,994	511,806,302	6,051,122,515
第41特定期間 (2022年11月23日～2023年5月22日)	200,072,010	455,855,200	5,795,339,325
第42特定期間 (2023年5月23日～2023年11月22日)	220,133,652	660,033,019	5,355,439,958
第43特定期間 (2023年11月23日～2024年5月22日)	225,389,978	429,259,763	5,151,570,173
第44特定期間 (2024年5月23日～2024年11月22日)	539,668,084	399,284,247	5,291,954,010
第45特定期間 (2024年11月23日～2025年5月22日)	540,390,966	601,924,253	5,230,420,723

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

＜参考情報＞

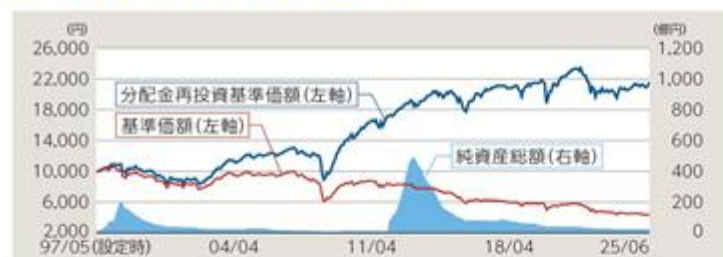
(2025年6月30日現在)

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

※下記データは過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

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

基準価額・純資産の推移



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

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後のものです。

基準価額	4,432円
純資産総額	23.1億円

分配の推移

(1万口当たり/税引前)

決算期	分配金
2025年 2 月	20円
2025年 3 月	20円
2025年 4 月	20円
2025年 5 月	20円
2025年 6 月	20円
直近1年間累計	240円
設定累計	11,780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	92.7%	銘柄	クーポン	償還日	業種	格付	比率	
転換社債	0.9%	1 メスキート・エナジー	—	—	エネルギー	—	2.0%	
株式	3.3%	2 アルティス・フランス	5.125%	2029/7/15	通信	D	1.0%	
新興市場債(ワラン)	0.0%	3 エコスター	10.75%	2029/11/30	通信	B	0.9%	
現金・その他	3.0%	4 CCOホールディングス/キャピタル	5.125%	2027/5/1	メディア	BB/Ba	0.8%	
		5 CHS/コミュニティ・ヘルス・システムズ	4.75%	2031/2/15	ヘルスケア	B	0.6%	
		6 アグリシア/アグリシア・ファイナンス	6%	2029/8/1	保険	CCC/Caa	0.6%	
		7 eGグローバル・ファイナンス	12%	2028/11/30	小売	B	0.6%	
		8 ウィンドストームサービス/ウィンドストーム・ファイナンス	8.25%	2031/10/1	通信	B	0.6%	
		9 トランスダイム	6.375%	2033/5/31	資本財	B	0.6%	
		10 エコスター	—	—	通信	—	0.6%	

※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。

※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。

※債券以外の銘柄は、クーポン・償還日・格付の属性を表示していません。

※2049/12/31は、永久債を表示しております。

※業種は原則としてICE BofAの分類によります。一部弊社の判断で分類しているものが含まれます。

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

※債券等には、金銭債権が含まれます。

※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



※当ファンドは、ベンチマークを設定していません。

※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。

※2025年は年初以降6月末までの実績となります。

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

（5）【その他】

<訂正前>

（略）

（e）運用報告書の作成

委託会社は、毎特定期間終了後および償還後に当該期間中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況等のうち、重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を作成し、これを販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

また、委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託会社は、運用報告書（全体版）を交付したものとみなします。

上記の規定にかかわらず、委託会社は、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

（略）

<訂正後>

（略）

（e）運用報告書の作成

委託会社は、毎特定期間終了後および償還後に当該期間中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況等のうち、重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第2項に規定する事項を記載した書面）を作成し、これを販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

また、委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に規定する事項を記載した書面）を電磁的方法により提供します。

上記の規定にかかわらず、委託会社は、受益者から運用報告書（全体版）の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行なうものとします。

（略）

第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第45特定期間（2024年11月23日から2025年5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・ハイ・イールド・ボンド・オープン ポートフォリオB（為替ヘッジあり）】****（１）【貸借対照表】**

（単位：円）

	第44特定期間 2024年11月22日現在	第45特定期間 2025年 5月22日現在
資産の部		
流動資産		
預金	78,173	64,429
親投資信託受益証券	2,440,783,255	2,240,917,606
派生商品評価勘定	8,488,941	25,930,599
未収入金	18,183,110	94,561,893
流動資産合計	2,467,533,479	2,361,474,527
資産合計	2,467,533,479	2,361,474,527
負債の部		
流動負債		
未払金	68,026,145	73,134,906
未払収益分配金	10,583,908	10,460,841
未払解約金	1,665,698	4,321,568
未払受託者報酬	112,130	103,172
未払委託者報酬	3,364,065	3,095,393
その他未払費用	1,209,783	1,151,231
流動負債合計	84,961,729	92,267,111
負債合計	84,961,729	92,267,111
純資産の部		
元本等		
元本	5,291,954,010	5,230,420,723
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△2,909,382,260	△2,961,213,307
（分配準備積立金）	60,573,360	47,457,216
元本等合計	2,382,571,750	2,269,207,416
純資産合計	2,382,571,750	2,269,207,416
負債純資産合計	2,467,533,479	2,361,474,527

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第44特定期間 自 2024年 5 月23日 至 2024年11月22日	第45特定期間 自 2024年11月23日 至 2025年 5 月22日
営業収益		
受取利息	32	258
有価証券売買等損益	136,069,320	△117,475,809
為替差損益	△53,550,878	113,551,281
営業収益合計	82,518,474	△3,924,270
営業費用		
受託者報酬	665,443	659,344
委託者報酬	19,964,426	19,781,746
その他費用	1,241,909	1,173,069
営業費用合計	21,871,778	21,614,159
営業利益又は営業損失（△）	60,646,696	△25,538,429
経常利益又は経常損失（△）	60,646,696	△25,538,429
当期純利益又は当期純損失（△）	60,646,696	△25,538,429
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（△）	125,423	△729,703
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△2,828,601,091	△2,909,382,260
剰余金増加額又は欠損金減少額	219,093,791	335,813,105
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	219,093,791	335,813,105
剰余金減少額又は欠損金増加額	296,508,197	297,322,993
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	296,508,197	297,322,993
分配金	63,888,036	65,512,433
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△2,909,382,260	△2,961,213,307

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第44特定期間 2024年11月22日現在	第45特定期間 2025年 5 月22日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	5,151,570,173 円	5,291,954,010 円
期中追加設定元本額	539,668,084 円	540,390,966 円
期中一部解約元本額	399,284,247 円	601,924,253 円
2. 受益権の総数	5,291,954,010 口	5,230,420,723 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	2,909,382,260 円	2,961,213,307 円
4. 1口当たり純資産額	0.4502 円	0.4338 円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第44特定期間 自 2024年5月23日 至 2024年11月22日	第45特定期間 自 2024年11月23日 至 2025年5月22日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.33%以内の額	1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左
2. 分配金の計算過程 （自2024年5月23日 至2024年6月24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（9,494,412円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、有価証券売買等損益から費用を控除し、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（93,057,601円）及び分配準備積立金（69,282,230円）より分配対象収益は171,834,243円（1口当たり0.032579円）であり、うち10,548,802円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。 （自2024年6月25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（9,440,497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（92,283,355円）及び分配準備積立金（67,264,960円）より分配対象収益は168,988,812円（1口当たり0.032392円）であり、うち10,434,116円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。 （自2024年7月23日 至2024年8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（10,591,979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（99,571,996円）及び分配準備積立金（65,416,915円）より分配対象収益は175,580,890円（1口当たり0.032423円）であり、うち10,830,682円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。	2. 分配金の計算過程 （自2024年11月23日 至2024年12月23日） 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（10,014,297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（111,813,236円）及び分配準備積立金（60,049,265円）より分配対象収益は181,876,798円（1口当たり0.031885円）であり、うち11,408,329円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。 （自2024年12月24日 至2025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（10,443,769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（110,131,816円）及び分配準備積立金（57,284,077円）より分配対象収益は177,859,662円（1口当たり0.031755円）であり、うち11,202,080円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。 （自2025年1月23日 至2025年2月25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（9,883,186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（109,860,221円）及び分配準備積立金（56,210,410円）より分配対象収益は175,953,817円（1口当たり0.031528円）であり、うち11,161,899円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。

（自2024年8月23日 至2024年9月24日）

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（11,706,889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（99,276,621円）及び分配準備積立金（64,473,526円）より分配対象収益は175,457,036円（1口当たり0.032604円）であり、うち10,763,042円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。

（自2024年9月25日 至2024年10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（8,756,398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（99,117,080円）及び分配準備積立金（65,044,148円）より分配対象収益は172,917,626円（1口当たり0.032238円）であり、うち10,727,486円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。

（自2024年10月23日 至2024年11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（9,180,813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（98,069,298円）及び分配準備積立金（61,976,455円）より分配対象収益は169,226,566円（1口当たり0.031978円）であり、うち10,583,908円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。

（自2025年2月26日 至2025年3月24日）

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（8,131,920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（105,663,118円）及び分配準備積立金（52,684,935円）より分配対象収益は166,479,973円（1口当たり0.031045円）であり、うち10,725,060円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。

（自2025年3月25日 至2025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（8,321,477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（104,184,537円）及び分配準備積立金（49,112,403円）より分配対象収益は161,618,417円（1口当たり0.030626円）であり、うち10,554,224円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。

（自2025年4月23日 至2025年5月22日）

計算期間末における配当等収益から費用を控除した額（11,533,114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（103,348,996円）及び分配準備積立金（46,384,943円）より分配対象収益は161,267,053円（1口当たり0.030833円）であり、うち10,460,841円（1口当たり0.002000円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

I. 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	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。 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。 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。
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。

II. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第44特定期間 2024年11月22日現在	第45特定期間 2025年 5 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	73,450,427	95,017,515
合 計	73,450,427	95,017,515

(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44特定期間 2024年11月22日 現在				第45特定期間 2025年 5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	2,435,821,034	—	2,427,332,093	8,488,941	2,257,231,252	—	2,231,300,653	25,930,599
アメリカ・ドル	2,435,821,034	—	2,427,332,093	8,488,941	2,257,231,252	—	2,231,300,653	25,930,599
合計	2,435,821,034	—	2,427,332,093	8,488,941	2,257,231,252	—	2,231,300,653	25,930,599

(注1) 時価の算定方法

- 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。
 - 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。
 - 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。
 - ① 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。
 - ② 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。
- 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】

① 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・ハイ・イールド・ボンド・オープン・マザーファンド	252,452,246	2,240,917,606	
親投資信託受益証券 合計		252,452,246	2,240,917,606	
合計		252,452,246	2,240,917,606	

（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。

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ 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。

（参考情報）

ファンドは、「フィデリティ・ハイ・イールド・ボンド・オープン・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・ハイ・イールド・ボンド・オープン・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11月22日現在	2025年 5 月22日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	367,687,651	250,238,701
貸付債権	356,342,766	608,669,101
株式	205,444,583	180,864,748
新株予約権証券	5,588,806	4,946,955
国債証券	—	1,831,792
社債券	7,917,296,611	7,282,238,496
派生商品評価勘定	10,648	1,671,540
未収入金	30,479,070	26,919,699
未収利息	116,125,034	119,085,611
前払費用	1,545,759	1,999,448
その他未収収益	13,732	26,057
流動資産合計	9,000,534,660	8,478,492,148
資産合計	9,000,534,660	8,478,492,148
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	168	74,667
未払金	106,509,876	213,728,213
未払解約金	56,630,123	140,643,919
流動負債合計	163,140,167	354,446,799
負債合計	163,140,167	354,446,799
純資産の部		
元本等		
元本	943,972,384	915,225,523
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	7,893,422,109	7,208,819,826
元本等合計	8,837,394,493	8,124,045,349
純資産合計	8,837,394,493	8,124,045,349
負債純資産合計	9,000,534,660	8,478,492,148

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	2024年11月22日現在	2025年 5月22日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	970,108,165 円	943,972,384 円
期中追加設定元本額	82,346,446 円	68,063,508 円
期中一部解約元本額	108,482,227 円	96,810,369 円
2. 期末元本額及びその内訳		
フィデリティ・ハイ・イールド・ボンド・オープン ポートフォリオA（為替ヘッジなし）	683,257,865 円	662,773,277 円
フィデリティ・ハイ・イールド・ボンド・オープン ポートフォリオB（為替ヘッジあり）	260,714,519 円	252,452,246 円
計	943,972,384 円	915,225,523 円
3. 受益権の総数	943,972,384 口	915,225,523 口
4. 1口当たり純資産額	9.3619 円	8.8766 円

（金融商品に関する注記）

I. 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	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。 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。 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。
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。

II. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) 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。 (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。 (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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2024年11月22日現在	2025年 5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	16,295,565	△5,101,397
新株予約権証券	△4,308,175	△1,926,109
国債証券	—	14,350
社債券	240,718,361	△59,140,186
合 計	252,705,751	△66,153,342

(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11月22日 現在				2025年5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	56,630,123	—	56,619,475	10,648	140,643,919	—	139,047,046	1,596,873
アメリカ・ドル	56,630,123	—	56,619,475	10,648	140,643,919	—	139,047,046	1,596,873
買建	832,844	—	832,676	△168	—	—	—	—
アメリカ・ドル	832,844	—	832,676	△168	—	—	—	—
合計	57,462,967	—	57,452,151	10,480	140,643,919	—	139,047,046	1,596,873

(注1) 時価の算定方法

- 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。
 - 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。
 - 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。
 - ① 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。
 - ② 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。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客相場の仲値により評価しております。

(注2) デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されていません。

(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

① 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	PG&E CORP	9,452	17.40	164,464.80	
	SEA LTD ADR	458	163.26	74,773.08	
	MESQUITE ENERGY INC	5,503	87.30	480,411.90	
	CALIFORNIA RES CORP	2,579	42.41	109,375.39	
	NORTHEAST GROCERY INC PP	26,283	6.93	182,141.19	
	CAESARS ENTERTAINMENT INC	1,097	27.96	30,672.12	
	REGIONS FIN 5.70%/VAR PFD PERP	4,000	22.99	91,960.00	
	PURE WEST ENERGY	2	0.22	0.44	
	NOBLE CORP PLC	337	23.27	7,841.99	
	GTT COMMUNICATIONS INC	1,089	46.53	50,671.17	
	CANO HEALTH LLC	6,652	10.25	68,183.00	
	SPIRIT AVIATION HOLDINGS INC	86	5.74	493.64	
	SOUTHEASTERN GROCERS CVR RT	15,991	0.03	623.64	
アメリカ・ドル 小計		73,529		1,261,612.36 (180,864,748)	
合計		73,529		180,864,748 (180,864,748)	

(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	CANO HEALTH LLC WT	204.00	563.04	
		GTT COMM INC WT 12/30/27	290.00	2,847.80	
		NOBLE CORP PLC TR 1 WT 2/04/28	1,176.00	18,816.00	
		NOBLE CORP PLC TR2 WT 2/04/28	1,176.00	6,856.08	
		SPIRIT AVIATION WT RESTR RGS	536.00	3,076.64	
		SPIRIT AVIATION WT UNRESTRICT	409.00	2,347.66	
	アメリカ・ドル	小計	3,791.00	34,507.22 (4,946,955)	
新株予約権証券 合計				4,946,955 (4,946,955)	
国債証券	アメリカ・ドル	USTN 4.125% 11/15/32	13,000.00	12,777.57	
	アメリカ・ドル	小計	13,000.00	12,777.57 (1,831,792)	
国債証券 合計				1,831,792 (1,831,792)	
社債券	アメリカ・ドル	1011778 BC 6.125% 6/15/29 REGS	200,000.00	203,412.00	
		1011778 BC ULC 4% 10/15/30 RGS	180,000.00	164,291.40	
		1261229 BC LTD 10% 04/15/32 RGS	215,000.00	213,144.55	
		ACADEMY LTD 6% 11/15/27 REGS	100,000.00	100,052.00	
		ACADIA HEA 7.375% 03/15/33 RGS	45,000.00	46,051.65	
		ACRISURE LLC 6% 08/01/29 RGS	350,000.00	336,000.00	
		ACURIS FIN US/A 5% 05/01/28 REGS	100,000.00	93,658.00	
		ADT SECURITY CO 4.125% 08/01/29 REGS	100,000.00	94,393.00	
		ADV SALES & MRK 6.5% 11/28 RGS	150,000.00	117,840.00	
		ADVANCED DRAIN 6.375% 06/15/30 REGS	120,000.00	121,197.60	
		AETHON UNITED 7.5% 10/01/29 REGS	100,000.00	101,701.00	
		AIR LEASE CORP 4.125%/VAR PERP	100,000.00	96,259.00	

AIR TRANSPORT S 7.25% 3/15/32 RGS	80,000.00	82,288.80	
ALBERTSONS 6.25% 03/15/33 RGS	60,000.00	60,760.20	
ALBERTSONS C 3.5% 03/15/29 RGS	65,000.00	60,643.05	
ALBERTSONS COM 6.5% 02/28 REGS	150,000.00	152,607.00	
ALCOA INC GLB 5.95 2/1/37	110,000.00	113,403.40	
ALLEGHENY TECH 4.875% 10/01/29	40,000.00	38,409.60	
ALLEGHENY TECH 5.125% 10/01/31	30,000.00	28,753.80	
ALLEN MEDIA 10.5% 02/15/28 RGS	150,000.00	51,000.00	
ALLIANT HLDG 6.75% 10/27 144A	145,000.00	145,000.00	
ALLIANT HLDGS 5.875% 11/01/29 RGS	300,000.00	291,435.00	
ALLIED 7.875% 2/15/31 RGS	185,000.00	190,135.60	
ALLIED UNIVERS 4.625% 6/28 RGS	60,000.00	57,276.00	
ALLISON TR 5.875% 6/1/29 144A	75,000.00	75,228.75	
ALLY FINL INC 4.7%/VAR PERP	100,000.00	94,928.00	
ALLY FINL INC 4.7%/VAR PERP	125,000.00	110,750.00	
ALPHA GENERATI 6.75% 10/32 RGS	70,000.00	70,935.90	
ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18 Escrow	460,000.00	—	
ALTICE FING SA 5.75% 08/29 RGS	200,000.00	152,888.00	
ALTICE FR HLDG 6% 02/15/28 RGS	200,000.00	72,326.00	
ALTICE FRANCE 5.125% 7/29 RGS	700,000.00	589,057.00	
ALTICE FRANCE SA 5.5% 01/15/20	200,000.00	170,704.00	
ALUMINA PTY LTD 6.375% 9/15/32 RGS	200,000.00	197,542.00	
AMENTUM ESCROW 7.25% 08/01/32 RGS	65,000.00	65,588.90	
AMER AIR 7.25% 02/15/28 REGS	45,000.00	45,287.10	

AMER AIR 8.5% 05/15/29 REGS	95,000.00	98,237.60	
AMER SPORTS 6.75% 2/16/31 RGS	60,000.00	61,785.00	
AMWINS GROUP 4.875% 06/30/29 RGS	50,000.00	47,954.50	
ANTERO MIDSTRE 5.375% 6/29 RGS	100,000.00	98,424.00	
ANTERO RES CRP 7.625% 02/01/29 RGS	38,000.00	38,932.52	
ANYWHERE REAL 7% 04/15/30 RGS	176,000.00	160,321.92	
ARCHROCK LP 6.875% 4/27 144A	36,000.00	36,003.96	
ARCOSA INC 0% 03/31/29 RGS	50,000.00	47,540.00	
ARDAGH METAL PA 4% 9/1/29 RGS	150,000.00	131,730.00	
ARDENT HEALTH S 5.75% 7/29 RGS	100,000.00	94,795.00	
ARIS WATER HLDNG 7.25% 03/30 RGS	100,000.00	100,287.00	
ARSENAL AIC PAREN 8% 10/30 RGS	65,000.00	67,820.35	
ARTERA SERVICES 8.5% 1/31/31 RGS	300,000.00	260,373.00	
ASBURY AUTOMOT 4.625% 11/15/29 RGS	50,000.00	47,381.00	
ASBURY AUTOMOT 5% 02/15/32 RGS	55,000.00	51,087.85	
ASGN INC 4.625% 05/15/28 144A	235,000.00	225,083.00	
ASHTON WO 4.625% 04/01/30 RGS	45,000.00	41,867.55	
ASSUREDPARTNER 5.625% 01/15/29 RGS	50,000.00	49,996.00	
ASSUREDPARTNER 7.5% 02/15/32 REGS	100,000.00	107,056.00	
ATLANTICA SUST 4.125% 6/28 RGS	200,000.00	190,334.00	
ATLAS LUXCO S 4.625% 6/28 RGS	40,000.00	37,997.60	
BALL CORP 3.125% 09/15/31	125,000.00	109,193.75	
BALL CORP 6% 06/15/29	100,000.00	101,537.00	
BARCLAYS PLC FRN VAR PERP	200,000.00	194,886.00	
BAUSCH HEALTH 11% 09/30/28 RGS	153,000.00	147,528.72	

BAUSCH HEALTH 14% 10/15/30 RGS	29,000.00	24,940.00	
BAUSCH HLTH 9.25% 04/01/26 RGS	100,000.00	98,811.00	
BAYTEX EN 7.375% 03/15/32 RGS	100,000.00	89,664.00	
BELLRING BRANDS 7% 3/30 RGS	75,000.00	77,558.25	
BLOCK INC 3.5% 06/01/31	100,000.00	89,570.00	
BLOCK INC 6.5% 05/15/32	100,000.00	101,606.00	
BOMBARDIER 7% 06/01/32 REGS	200,000.00	203,998.00	
BOMBARDIER INC 7.25% 07/01/31 REGS	80,000.00	82,129.60	
BOOZ ALLEN 3.875% 9/1/28 RGS	220,000.00	210,755.60	
BOOZ ALLEN HAMI 4% 07/01/29 REGS	35,000.00	33,180.35	
BRAND INDUSTRIA 10.375% 7/31/30 RGS	230,000.00	206,137.50	
BROADSTREET PAR 5.875% 04/30/29 RE	40,000.00	39,037.60	
BUILDERS FI 4.25% 02/01/32 RGS	100,000.00	90,144.00	
BWX TECH INC 4.125% 4/29 RGS	200,000.00	189,770.00	
C AND S GRP ENT 5% 12/15/28 RGS	200,000.00	165,466.00	
C&W SR FIN LTD 9% 01/15/33 RGS	200,000.00	198,306.00	
CABLEVS LHT LLC 5.625% 9/15/28 RGS	235,000.00	223,299.35	
GACI INTL INC 6.375% 06/15/33 RGS	55,000.00	55,000.00	
CAESARS ENT 6% 10/15/32 REGS	250,000.00	238,917.50	
CAESARS ENTERTA 4.625% 10/15/29 REGS	95,000.00	88,711.95	
CALIFORNIA BUYE 6.375% 2/15/32 RGS	150,000.00	147,138.00	
CANACOL ENERGY 5.75% 11/28 RGS	200,000.00	93,300.00	
CAPSTONE BORROW 8% 6/15/30 RGS	30,000.00	30,715.80	
CARNIVAL C 5.875% 06/15/31 RGS	80,000.00	79,553.60	

CARNIVAL CORP 4% 08/01/28 RGS	150,000.00	144,169.50	
CARNIVAL CORP 5.75% 03/15/30 REGS	100,000.00	99,738.00	
CARNIVAL CORP 5.75% 3/1/27 RGS	100,000.00	100,305.00	
CARNIVAL CORP 6.125% 02/15/33 REGS	100,000.00	99,774.00	
CARNIVAL CORP 7% 08/15/29 RGS	30,000.00	31,421.40	
CARVANA CO PIK VAR 06/01/30 RE	50,762.00	53,416.34	
CARVANA CO PIK VAR 06/01/31 RE	64,548.00	74,861.47	
CARVANA CO PIK VAR 12/01/28 RE	28,823.00	29,598.03	
CCO HLDGS/CAP 5% 2/1/28 144A	200,000.00	196,566.00	
CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144	475,000.00	470,501.75	
CCO HLDGS/CAP C 4.5% 06/01/33 REGS	160,000.00	142,104.00	
CELANESE US LLC 6.5% 04/15/30	45,000.00	44,992.35	
CELANESE US LLC 6.75% 04/15/33	90,000.00	86,923.80	
CENTENE CORP 2.45% 07/15/28	105,000.00	96,359.55	
CHARLES RIV 4.25% 5/1/28 144A	30,000.00	28,614.30	
CHEMOURS CO 4.625% 11/29 RGS	50,000.00	41,595.50	
CHEMOURS CO 5.375% 05/15/2027	130,000.00	127,236.20	
CHEMOURS CO 5.75% 11/15/28 RGS	100,000.00	89,949.00	
CHOBANI FIN 7.625% 07/01/29 RGS	100,000.00	104,698.00	
CHOBANI LLC/FIN 8.75% 10/01/29 RE	208,392.00	222,398.02	
CHS/CMNTY HEAL 4.75% 02/15/31 REGS	410,000.00	350,521.30	
CHS/CMNTY HEALT 10.875% 01/15/	200,000.00	211,000.00	
CHS/CMNTY HEALT 5.25% 05/15/30 REGS	100,000.00	89,274.00	
CHS/CMNTY HEALT 6.125% 04/01/30 REGS	140,000.00	106,162.00	

CHURCHILL 6.75% 05/01/31 REGS	150,000.00	152,134.50	
CIMPRESS PLC 7.375% 09/15/32 REGS	150,000.00	140,869.50	
CITGO PETE CO 8.375% 01/29 RGS	100,000.00	100,704.00	
CITIGROUP 6.75%/VAR PERP	100,000.00	98,664.00	
CITIGROUP INC VAR 12/29/2049	200,000.00	201,246.00	
CLEAN HARBORS 6.375% 2/31 RGS	25,000.00	25,413.00	
CLEAR CHANNEL 7.5% 6/1/29 RGS	70,000.00	62,338.50	
CLEAR CHANNEL 7.875% 04/30 RGS	100,000.00	101,250.00	
CLEAR CHANNEL 9% 09/15/28 RGS	100,000.00	104,684.00	
CLEARWY ENE 3.75% 01/15/32 RGS	100,000.00	86,876.00	
CLEARWY ENR 4.75% 3/15/28 144A	55,000.00	53,758.65	
CLEVELAND-CLIF 4.875% 03/01/31 RGS	100,000.00	84,354.00	
CLEVELAND-CLIFF 7% 3/15/32 RGS	50,000.00	45,637.00	
CLOUD SOFTWARE 8.25% 05/31/32 RGS	100,000.00	104,867.00	
CLOUD SOFTWARE 9% 09/30/29 REGS	275,000.00	279,818.00	
CLYDESDALE 6.625% 4/15/29 REGS	35,000.00	35,096.95	
CLYDESDALE ACQU 6.75% 4/15/32 RGS	90,000.00	90,382.50	
CLYDESDALE ACQU 6.875% 01/15/30 REGS	100,000.00	100,213.00	
CLYDESDALE ACQU 8.75% 4/30 RGS	150,000.00	151,119.00	
CMG MEDIA CORP 8.875% 06/18/29	125,000.00	115,751.25	
CNX MIDSTR 4.75% 04/15/30 RGS	35,000.00	32,436.60	
CNX RESOURCES 6% 01/15/29 RGS	40,000.00	39,774.80	
CNX RESOURCES 7.25% 3/1/32 RGS	100,000.00	102,000.00	
COLGATE ENER 5.875% 7/1/29 RGS	40,000.00	39,450.00	

COMMScope INC 4.75% 09/01/29 REGS	76,000.00	70,173.84	
COMSTOCK 5.875% 01/15/30 RGS	55,000.00	51,911.75	
COMSTOCK RESOUR 6.75% 03/29 RGS	100,000.00	98,267.00	
CONSLIDATED COM 5% 10/28 RGS	45,000.00	45,545.85	
CORELOGIC INC 4.5% 5/1/28 RGS	200,000.00	187,964.00	
COREWEAVE 9.25% 06/01/30 RGS	110,000.00	110,000.00	
CPI ACQUISITION 10% 6/30/29 RGS	30,000.00	31,462.50	
CRESTWOOD M P/F 6% 02/01/29 RGS	100,000.00	101,085.00	
CROCS INC 4.125% 08/15/31 REGS	85,000.00	74,619.80	
CROWN AMERICAS 5.875% 6/33 RGS	85,000.00	84,008.90	
CSC HLDGS 5.5% 04/15/27 144A	300,000.00	278,139.00	
CSC HLDGS LLC 4.625% 12/30 RGS	200,000.00	95,020.00	
CSC HOLDINGS 5.75% 01/30 144A	155,000.00	79,825.00	
CSC HOLDINGS 7.5% 4/1/28 144A	110,000.00	83,227.10	
CVR ENERGY 5.75% 02/15/28 144A	30,000.00	28,330.80	
CVR ENERGY INC 8.5% 01/15/29 REGS	30,000.00	29,051.10	
DANA INC 4.5% 02/15/32	100,000.00	93,493.00	
DARLING INGREDI 6% 06/15/30 REGS	40,000.00	39,777.20	
DAVITA INC 3.75% 02/15/31 REGS	225,000.00	197,817.75	
DAVITA INC 4.625% 06/01/30 RGS	125,000.00	116,416.25	
DAVITA INC 6.75% 07/15/33 REGS	80,000.00	79,853.60	
DELEK LOGISTIC 7.125% 06/01/28	55,000.00	54,910.90	
DELEK LOGISTIC 8.625% 03/15/29 REGS	100,000.00	103,081.00	
DISH DBS CORP 5.125% 06/01/29	130,000.00	85,170.80	

DISH DBS CORP 5.75% 12/28 RGS	100,000.00	84,086.00	
DOLYA HOLDCO 18 5% 7/15/28 RGS	200,000.00	194,804.00	
DT MIDSTREAM 4.375% 06/15/31 RGS	100,000.00	92,632.00	
DT MIDSTREAM IN 4.125% 6/15/29 RGS	100,000.00	94,517.00	
ECHOST CRP CNV 3.875% 11/12/30	259,174.00	273,988.37	
EHOSTAR CORP 10.75% 11/30/29	491,922.00	496,078.74	
EHOSTAR CORP PIK VAR 11/30/30	323,334.00	293,402.97	
EDISON INTL 5%/VAR PERP	100,000.00	88,781.00	
EG GBL FIN 12% 11/30/28 RGS	300,000.00	332,076.00	
ELASTIC NV 4.125% 06/30/29 RGS	145,000.00	137,433.90	
EMERGENT B 3.875% 08/15/28 RGS	55,000.00	41,284.10	
ENLINK MIDSTR 5.625% 01/15/28 RGS	200,000.00	202,884.00	
ENVIVA PARTNERS LP/ FIN ESCROW	125,000.00	—	
EQT CORP 7.5% 06/01/27 RGS	100,000.00	101,842.00	
EQT CORP 7.5% 6/01/30 RGS	100,000.00	107,711.00	
ERO COPPER 6.5% 2/15/30 RGS	200,000.00	195,500.00	
ESAB CORP 6.25% 04/15/29 REGS	100,000.00	101,666.00	
EXCELERATE ENRG 8% 05/15/30 REGS	100,000.00	102,741.00	
FERTITTA E 4.625% 1/15/29 RGS	175,000.00	162,802.50	
FERTITTA ENTMT 6.75% 1/30 RGS	100,000.00	90,160.00	
FIESTA PUR 9.625% 09/15/32 RGS	35,000.00	36,928.15	
FIESTA PURCH 7.875% 3/1/31 RGS	55,000.00	58,000.80	
FIRST QUANTUM 9.375% 02/28/29 RGS	200,000.00	209,672.00	
FOCUS FIN PART 6.75% 08/15/31 REGS	100,000.00	100,824.00	
FOOT LOCKER INC 4% 10/01/29 REGS	45,000.00	42,721.65	

FORTRESS TR&INF 5.875% 04/15/33 REGS	100,000.00	95,953.00	
FORTRESS TR&INF 7% 06/32 RGS	85,000.00	86,528.30	
FORTRESS TR&INF 7.875% 12/01/30 REGS	100,000.00	104,758.00	
FORWARD AIR COR 9.5% 10/15/31 REGS	150,000.00	153,081.00	
FRONTIER 5.875% 11/01/29 144A	13,740.00	13,870.11	
FRONTIER COM 8.75% 05/15/30 REGS	75,000.00	78,693.75	
FRONTIER COMM 5.875% 10/15/27 RGS	80,000.00	80,061.60	
GARDEN SPIN 8.625% 7/20/30 RGS	25,000.00	25,880.25	
GATES CORP/THE 6.875% 7/29 RGS	100,000.00	101,944.00	
GEN DGTI INC 6.25% 04/01/33 REGS	70,000.00	70,722.40	
GENESEE & WY 6.25% 4/15/32 RGS	100,000.00	101,274.00	
GEO GRP INC/THE 10.25% 4/15/31	100,000.00	109,252.00	
GFL ENV INC 6.75% 01/15/31 RGS	45,000.00	46,683.00	
GFL ENVIRONMENT 3.5% 09/01/28 RGS	100,000.00	95,517.00	
GGAM FINANCE LT 5.875% 03/15/30 REGS	100,000.00	98,882.00	
GGAM FINANCE LT 6.875% 04/15/29 REGS	70,000.00	71,271.90	
GGAM FINANCE LT 7.75% 05/15/26	100,000.00	100,874.00	
GGAM FINANCE LT 8% 2/15/27 RGS	60,000.00	61,514.40	
GLOBAL INF 5.625% 06/01/29 RGS	100,000.00	97,328.00	
GOODYEAR TIRE & 5% WI 7/15/29	100,000.00	95,568.00	
GRAFTECH G 9.875% 12/23/29 RGS	100,000.00	75,686.00	
GREYSTAR REAL 7.75% 8/31/30 RGS	25,000.00	26,250.00	
GROUP 1 6.375% 01/15/30 RGS	55,000.00	55,754.60	

GSINC T5Y 6.85% + PERP	120,000.00	120,686.40	
H&E EQUIPMENT S 3.875% 12/15/28	135,000.00	135,892.35	
HAH GRP HLD CO 9.75% 10/01/31 REGS	30,000.00	30,145.50	
HARVEST MIDSTRE 7.5% 9/28 REGS	135,000.00	136,543.05	
HAT HLDGS I/II 8% 06/15/27 REGS	100,000.00	102,757.00	
HEALTHEQUITY IN 4.5% 10/01/29	35,000.00	33,416.25	
HERC HOL E 7.25% 06/15/33 REGS	80,000.00	80,998.40	
HERC HOLDINGS E 7% 06/30 RGS	80,000.00	80,921.60	
HERTZ 6% 01/15/28 RGS	48,000.00	9,360.00	
HERTZ CORP 5.5% 10/15/2024 RGS	250,000.00	15,000.00	
HERTZ CORP 6.25% 10/15/22	125,000.00	9,062.50	
HESS MIDST 5.125% 6/15/28 144A	135,000.00	132,872.40	
HESS MIDSTREA 5.875% 03/28 RGS	100,000.00	100,520.00	
HESS MIDSTREAM PAR 4.25% 2/30 RGS	55,000.00	51,856.20	
HFC PRESTIGE 6.625% 07/15/30 REGS	100,000.00	101,271.00	
HIGHTOWER HOLD 0% 04/30/29 RGS	135,000.00	133,544.70	
HILCORP 6.25% 11/01/28 144A	50,000.00	49,145.50	
HILTON DOM 5.875% 04/29 RGS	100,000.00	100,789.00	
HILTON DOMESTI 4% 05/01/31 RGS	200,000.00	183,898.00	
HILTON GRAND V 5% 06/01/29 RGS	100,000.00	93,773.00	
HILTON GRAND V 6.625% 01/31/32 RGS	100,000.00	100,338.00	
HOWARD ENER 7.375% 7/15/32 RGS	100,000.00	103,056.00	
HOWARD HUG 5.375% 08/01/28 RGS	150,000.00	146,872.50	
HTA GROUP LTD 7.5% 06/04/29 RGS	200,000.00	202,300.00	
HUB INTERNATIONAL 7.25% 06/15/30 REGS	100,000.00	103,818.00	

HUDSON AUTOMOTI 8% 05/32 RGS	35,000.00	36,629.25	
ICAHN LP/FN 10% 11/15/29 REGS	35,000.00	34,184.85	
ICAHN LP/FN 9% 06/15/30	100,000.00	92,777.00	
ICAHN LP/FN COR 5.25% 05/15/27	270,000.00	256,259.70	
II-VI INC 5% 12/15/29 RGS	250,000.00	242,252.50	
INSIGHT ENTERPR 6.625% 05/15/32 REGS	45,000.00	45,659.70	
INSULET CORP 6.5% 04/01/33 REG	25,000.00	25,600.25	
IVANHOE MINES 7.875% 1/23/30 RGS	200,000.00	198,258.00	
JACOBS ENTE 6.75% 02/15/29 RGS	45,000.00	42,310.35	
JANE ST GRP/J 6.75% 5/1/33 RGS	80,000.00	81,570.40	
JANE ST GRP/JSG 4.5% 11/15/29	45,000.00	43,254.45	
JANE ST GRP/JSG 6.125% 11/01/32 REGS	80,000.00	79,642.40	
JAZZ SECU DAC 4.375% 01/15/29 REGS	70,000.00	66,857.00	
JBS USA/LUX/FIN 5.5% 01/15/30	61,000.00	61,568.52	
JPMORGAN CHASE 6.5%/VAR PERP	100,000.00	101,344.00	
KAISER AL 4.625% 03/01/28 RGS	100,000.00	96,518.00	
KEHE DIST/FIN 9% 02/15/29 RGS	100,000.00	103,484.00	
KENNEDY-WILSON 4.75% 02/01/30	200,000.00	177,034.00	
KINETIK 5.875% 06/15/30 REGS	65,000.00	64,325.95	
KINETIK HLDG LP 6.625% 12/15/28 REGS	100,000.00	101,633.00	
KOBE US MIDC PIK VAR 11/26 RGS	173,643.00	153,022.88	
KODIAK GAS SVCS 7.25% 2/29 RGS	100,000.00	101,463.00	
KONTOOR BR 4.125% 11/15/29 RGS	25,000.00	22,781.50	

KRAFT HEINZ CO 4.375% 6/1/46	25,000.00	19,371.50	
KRONOS ACQUISIT 8.25% 6/30/31 RGS	100,000.00	83,129.00	
L BRANDS INC 6.625% 10/01/30 RGS	250,000.00	254,260.00	
LBM ACQUISITION 6.25% 01/15/29	185,000.00	153,590.70	
LCM INV HLD 8.25% 8/1/31 RGS	35,000.00	37,045.40	
LCM INVEST 4.875% 05/01/29 RGS	35,000.00	33,493.60	
LCPR SENIOR SE 5.125% 7/29 RGS	200,000.00	134,160.00	
LEVEL 3 FINL 10.5% 5/15/30 RGS	165,000.00	179,127.30	
LEVEL 3 FINL 11% 11/15/29 REGS	39,214.00	44,259.27	
LEVEL 3 FINL 4% 04/15/31 RGS	75,000.00	59,999.25	
LEVEL 3 FINL 4.5% 04/01/30 RGS	185,000.00	156,325.00	
LEVEL 3 FINL 4.875% 6/29 RGS	15,000.00	13,200.00	
LGI HOMES 8.75% 12/15/28 RGS	45,000.00	46,180.80	
LGI HOMES INC 7% 11/15/32 REGS	100,000.00	93,375.00	
LIFE TIME INC 6% 11/15/31 REGS	100,000.00	99,810.00	
LIFEPOINT HLT 11% 10/15/30 RGS	100,000.00	110,173.00	
LIGHTNING POW 7.25% 08/15/32 RGS	50,000.00	52,018.50	
LINDBLAD EXPEDI 9% 05/15/28 REGS	100,000.00	102,746.00	
MACQUARIE AIRF 6.4% 03/29 RGS	20,000.00	20,569.00	
MACQUARIE AIRF 8.125% 3/29 RGS	50,000.00	52,303.00	
MADISON 5.875% 06/30/29 RGS	100,000.00	95,997.00	
MADISON IAQ 4.125% 06/28 RGS	65,000.00	62,585.25	
MAGIC MERGER 5.25% 05/1/28 RGS	85,000.00	57,581.55	
MARRIOTT OWN 4.5% 06/15/29 RGS	85,000.00	79,923.80	
MATADOR RES CO 6.5% 04/15/32 REGS	100,000.00	97,723.00	

MATCH GROUP INC 5% 12/27 144A	110,000.00	108,972.60	
MATCH GRP 5.625% 02/15/29 144A	100,000.00	99,010.00	
MATIV 8% 10/01/29 RGS	50,000.00	42,754.00	
MEDLINE BORROW 6.25% 04/29 RGS	195,000.00	197,228.85	
MERCER INTL 5.125% 02/01/29	100,000.00	80,137.00	
MESQUITE ENERGY 7.25% PERP	381,000.00	3,429.00	
MINERAL RES LT 9.25% 10/28 RGS	50,000.00	50,729.00	
MINERAL RES LTD 8% 11/1/27 RGS	125,000.00	124,192.50	
MINERVA MERGER 6.5% 02/15/30 REGS	270,000.00	259,259.40	
MIWD HOLDCO II 5.5% 02/01/30 REGS	20,000.00	18,051.40	
MODIVCARE ESC 5% 10/01/29 REGS	25,000.00	1,250.00	
MOHEGAN TRIBA 8.25% 04/15/30 RGS	75,000.00	76,512.00	
MOLINA HEALTHC 3.875% 11/15/30 RGS	80,000.00	72,965.60	
MOLINA HLTH 6.25% 01/15/33 RGS	35,000.00	34,878.20	
MOZART DEBT 5.25% 10/01/29 RGS	145,000.00	140,689.15	
MPT OPER PARTNE 3.5% 03/15/31	200,000.00	130,580.00	
MPT OPER PARTNE 8.5% 02/15/32 REGS	75,000.00	76,669.50	
MPT OPER PARTNERSHIP LP/CORP 4	100,000.00	75,006.00	
MURPHY OIL CORP 6% 10/01/32	100,000.00	92,399.00	
MURPHY OIL CORP VAR 12/1/42	100,000.00	76,884.00	
NABORS IND 8.875% 08/15/31 REGS	100,000.00	70,646.00	
NATION STAR 6.5% 8/01/29 REGS	100,000.00	101,719.00	
NCL CORP LTD 5.875% 03/15/26 R	6,000.00	5,994.36	
NCL CORP LTD 6.25% 3/1/30 RGS	100,000.00	98,405.00	

NCL FINANCE LTD 6.125% 03/15/2	35,000.00	35,008.40	
NEPTUNE BID 9.29% 04/15/29 RGS	200,000.00	183,500.00	
NEPTUNE BID US 9.29% 4/29 RGS	100,000.00	91,750.00	
NEW GOLD IN 6.875% 4/01/32 RGS	70,000.00	70,760.90	
NEWELL BRANDS I STEP 04/01/36	100,000.00	92,803.00	
NEWELL BRANDS INC 6.375% 05/30	65,000.00	61,410.05	
NEXTERA ENERGY 4.5% 9/27 144A	60,000.00	57,867.60	
NEXTERA ENGY 7.25% 01/29 RGS	100,000.00	100,891.00	
NEXTERA ENGY OP 8.625% 03/15/3	100,000.00	103,510.00	
NGL ENERGY PART 8.375% 02/15/32 REGS	100,000.00	94,920.00	
NORTHERN O & G 8.75% 6/31 REGS	100,000.00	99,676.00	
NOVA CHEM CORP 4.25% 5/29 RGS	150,000.00	143,091.00	
NOVA CHEM CORP 9% 02/15/30 RGS	100,000.00	107,198.00	
NOVELIS CORP 3.875% 08/15/31 REGS	100,000.00	88,618.00	
NRG ENERGY 3.375% 02/15/29 RGS	40,000.00	37,252.00	
NRG ENERGY 3.625% 2/15/31 REGS	75,000.00	67,700.25	
NRG ENERGY INC 6% 02/01/33 REGS	100,000.00	98,996.00	
NUFARM AU/AM 5% 01/27/30 REGS	150,000.00	138,178.50	
OLIN CORP 5% 02/01/30	75,000.00	70,796.25	
OLYMPUS WA 6.25% 10/01/29 RGS	200,000.00	185,302.00	
OLYMPUS WATER U 4.25% 10/01/28 RGS	200,000.00	188,140.00	
ON SEMICONDUCTO CV 0% 05/01/27	46,000.00	50,209.00	
ONEMAIN FIN 3.875% 09/15/28	100,000.00	93,523.00	
ONEMAIN FIN 6.625% 05/15/29	100,000.00	101,306.00	

ONEMAIN FIN 6.75% 03/15/32	100,000.00	98,719.00	
ONTARIO GAMING 0% 07/31/30 RGS	30,000.00	29,118.90	
ORGANON FINANC 5.125% 4/31 RGS	200,000.00	166,876.00	
OT MIDCO INC 10% 02/15/30 RGS	200,000.00	160,252.00	
OWENS MINOR INC 10% 4/15/30 RGS	100,000.00	105,072.00	
PANTHER ESCROW 7.125% 06/01/31 REGS	95,000.00	97,967.80	
PARK INTERMEDIA 7% 2/1/30 RGS	40,000.00	40,282.40	
PARKLAND CORP 6.625% 08/32 REGS	100,000.00	100,118.00	
PATRICK INDUSTR 6.375% 11/01/32 REGS	100,000.00	98,138.00	
PBF HLD LLC/FI 7.875% 9/30 RGS	100,000.00	88,837.00	
PBF HLD LLC/FIN 6% 02/15/28	150,000.00	139,324.50	
PENNYMAC FIN 6.875% 02/15/33 REGS	100,000.00	100,000.00	
PERMIAN RES 6.25% 02/01/33 REGS	100,000.00	98,375.00	
PERMIAN RES 7% 01/15/32 RGS	100,000.00	101,750.00	
PG&E CORP 5% 07/01/28	150,000.00	146,308.50	
PIKE CORP 5.5% 09/01/2028 RGS	225,000.00	222,358.50	
PITNEY 7.25% 03/15/29 REGS	85,000.00	84,801.95	
POST HLDGS INC 6.25% 10/15/34 RGS	50,000.00	49,194.00	
POST HLDGS INC 6.375% 03/01/33 RGS	200,000.00	197,172.00	
PRAIRIE ACQUIRO 9% 8/1/29 RGS	100,000.00	101,530.00	
PRIMO WATER HOL 6.25% 04/01/29	290,000.00	290,179.80	
QORVO INC 4.375% 10/15/29	200,000.00	190,730.00	
QUEEN MERGERCO 6.75% 04/30/32 RGS	100,000.00	101,103.00	
QUIKRETE HLDGS 6.375% 03/01/32 RGS	100,000.00	100,889.00	

RAILWORKS HLD 8.25% 11/15/28 RGS	100,000.00	101,025.00	
RAND PARENT LLC 8.5% 2/28/30 RGS	150,000.00	143,698.50	
REALOGY GROUP L 5.25% 04/15/30 REGS	5,000.00	3,901.55	
REALOGY GRP CV 0.25% 06/15/26	100,000.00	93,700.00	
REDFIN CORP CV 0.5% 04/01/27	100,000.00	88,750.00	
ROBLOX COR 3.875% 05/01/30 RGS	200,000.00	184,890.00	
ROCKIES EXPRESS 6.75% 03/15/33	80,000.00	81,968.80	
ROLLER BEAR CO 4.375% 10/15/29 REGS	25,000.00	23,766.00	
ROYAL CARIB 5.625% 9/30/31 RGS	100,000.00	99,052.00	
ROYAL CARIBB 5.375% 7/27 RGS	70,000.00	70,079.10	
ROYAL CARIBBEAN 6.25% 03/15/32	75,000.00	75,750.00	
RYAN SPECIALTY 5.875% 08/01/32 REGS	40,000.00	39,682.80	
SABLE INTL 7.125% 10/32 RGS	200,000.00	196,700.00	
SABRE GLB 11.125% 7/15/30 REGS	55,000.00	55,275.00	
SABRE GLBL INC 10.75% 11/15/29	35,000.00	35,113.75	
SABRE GLBL INC 8.625% 6/27 RGS	80,000.00	81,979.20	
SCIH SALT HLDG 4.875% 5/28 RGS	300,000.00	289,935.00	
SCOTSMAN INC 6.625% 04/15/30 R	45,000.00	46,030.50	
SCOTTS MIRACLE 4.375% 02/01/32	100,000.00	89,075.00	
SCRIPPS ESCRO 5.875% 7/27 144A	95,000.00	81,320.00	
SEADRILL FINANC 8.375% 7/31/30 RGS	225,000.00	219,991.50	
SEAGATE HDD 8.25% 12/29	55,000.00	58,678.40	
SEAGATE TECH PL 5.875% 7/15/30 RGS	50,000.00	49,842.00	
SEALED AIR 6.125% 2/28 RGS	85,000.00	85,624.75	

SEASpan CORPORA 5.5% 08/01/29 REGS	125,000.00	115,736.25	
SENSATA TECHNOL 4% 04/15/29 RE	90,000.00	84,079.80	
SERVICE CO INTL 5.125% 6/1/29	55,000.00	54,029.80	
SERVICE CO INTL 5.75% 10/15/32	100,000.00	98,859.00	
SIRIUS XM RADIO 3.875% 09/01/31 REGS	100,000.00	86,698.00	
SITIO ROYAL 7.875% 11/28 RGS	105,000.00	108,413.55	
SNAP INC 6.875% 03/01/33 REGS	55,000.00	55,668.25	
SOUTHWESTERN EN 4.75% 02/01/32	100,000.00	93,695.00	
SPCM SA 3.125% 03/15/27 REGS	100,000.00	95,556.00	
SPIRIT LOYAL PIK VAR 3/30 RGS	12,613.00	10,027.33	
SPRINGLEAF CORP 4% 09/15/30	95,000.00	85,446.80	
STAPLES 10.75% 09/01/29 RGS	100,000.00	90,400.00	
STAPLES 12.75% 01/15/30 RGS	100,000.00	64,107.00	
STARWOOD PPTY 6.5% 07/01/30 REGS	100,000.00	101,043.00	
STATION CAS 4.5% 02/15/28 144A	350,000.00	339,531.50	
SUNNOVA ENERGY 5.875% 9/26 RGS	90,000.00	28,068.30	
SUNOCO LP /CORP 4.5% 05/15/29	105,000.00	100,261.35	
SUNOCO LP /CORP 6% 04/15/27	165,000.00	164,937.30	
SUNOCO LP/SUNOC 5.875% 3/15/28	50,000.00	49,801.50	
SURGERY CTR HLD 7.25% 04/15/32 REGS	100,000.00	100,624.00	
TALOS PROD INC 9% 02/01/29 RGS	25,000.00	24,571.00	
TEMPUR SEALY 3.875% 10/15/31 R	85,000.00	74,975.95	
TEMPUR SEALY 4% 04/15/29 RGS	150,000.00	140,520.00	
TENET HEALTH 6.125% 10/28	250,000.00	249,822.50	

TENET HEALTHCARE 6.25% 2/1/27	300,000.00	300,570.00	
TERRAFORM POWER 5% 1/28 144A	80,000.00	78,200.00	
TEVA PH FIN NV 6% 12/01/32	200,000.00	199,536.00	
TEVA PHARMA II 5.75% 12/01/30	200,000.00	199,576.00	
THOR INDUSTRIES 4% 10/15/29 REGS	105,000.00	95,755.80	
TKC HOLDINGS 10.5% 5/15/29 RGS	150,000.00	152,617.50	
TMS INTERNATIONAL 6.25% 04/15/29	60,000.00	55,249.20	
TOLEDO HOSP/THE 6.015% 11/48	100,000.00	86,000.00	
TOPS MARKETS CORP ESCROW	340,000.00	—	
TRANSDIGM 6.375% 03/01/29 RGS	200,000.00	202,000.00	
TRANSDIGM I 6.75% 8/15/28 RGS	200,000.00	202,500.00	
TRANSDIGM INC 6% 01/15/33 RGS	300,000.00	297,390.00	
TRANSDIGM INC 6.375% 03/01/29 REGS	290,000.00	293,184.20	
TRANSDIGM INC 6.375% 05/31/33 REGS	320,000.00	315,596.80	
TRANSMONT 8.5% 06/15/30 REGS	100,000.00	101,883.00	
TRANSOCEAN INC 8.5% 05/15/31 REGS	100,000.00	85,051.00	
TRANSOCEAN INC 8.75% 2/30 RGS	64,000.00	64,040.96	
TRANSOCEAN PO 6.875% 2/27 144A	52,500.00	52,449.60	
TRONOX INC 4.625% 03/15/29 RGS	100,000.00	82,301.00	
TRUENOORD CAPIT 8.75% 03/01/30 RGS	100,000.00	103,245.00	
TTM TECH INC 4% 03/01/29 REGS	100,000.00	94,156.00	
TULLOW OIL PLC 10.25% 5/26 RGS	200,000.00	171,010.00	
TURN POINT 7.625% 03/15/32 RGS	60,000.00	62,890.80	
UBER TECH INC 4.5% 08/15/29 REGS	120,000.00	117,477.60	

UKG INC 6.875% 02/01/31 REGS	70,000.00	72,254.00	
UNISYS 6.875% 11/01/27 RGS	45,000.00	44,888.85	
UNITED AIRLINE 4.625% 04/15/29 REGS	100,000.00	94,574.00	
UNITED RENTALS 6.125% 03/34 RGS	200,000.00	201,556.00	
UNITI GRP/UNIT 6% 01/15/30 RGS	200,000.00	179,628.00	
UNITI/FIN/CS 6.5% 02/15/29 RGS	100,000.00	92,235.00	
UNITI/FIN/CSL 10.5% 2/28 RGS	131,000.00	138,739.48	
UNIVISION 6.625% 06/01/27 RGS	150,000.00	149,550.00	
UNIVISION 8.5% 07/31/31 RGS	100,000.00	95,000.00	
UNIVISION COMM 4.5% 5/29 RGS	100,000.00	87,959.00	
UNIVISION COMM 8.5% 7/31 RGS	200,000.00	190,662.00	
UNIVISION COMMU 8% 8/15/28 RGS	100,000.00	98,750.00	
US ACUTE CARE 9.75% 5/29 RGS	100,000.00	101,962.00	
US FOODS INC 4.625% 06/01/30 REGS	40,000.00	38,385.60	
US FOODS INC 5.75% 4/15/33 RGS	50,000.00	48,982.50	
USA COMPRESSIO 7.125% 03/15/29	100,000.00	100,493.00	
VALARIS LTD 8.375% 4/30 RGS	100,000.00	98,399.00	
VENTURE GBL 6.25% 01/15/30 REGS	100,000.00	100,340.00	
VENTURE GLO 3.875% 11/1/33 RGS	100,000.00	84,607.00	
VENTURE GLOBAL 3.875% 08/15/29 RGS	100,000.00	91,912.00	
VENTURE GLOBAL 4.125% 08/15/31 RGS	100,000.00	89,524.00	
VENTURE GLOBL 7.5% 05/01/33 REGS	55,000.00	57,005.30	
VERTIV GROUP 4.125% 11/15/28 REGS	100,000.00	96,554.00	
VFH PARENT / VA 7.5% 06/31 RGS	65,000.00	67,470.65	

VIKING CRUISES 9.125% 7/31 RGS	100,000.00	107,437.00	
VIRGIN MED S 4.5% 08/15/30 RGS	100,000.00	91,520.00	
VIRIDIEN 10% 10/15/30 REGS	200,000.00	191,546.00	
VISTAJET MAL/XO 6.375% 02/01/30 REGS	150,000.00	133,164.00	
VISTRA OP CO 5.625% 02/27 144A	150,000.00	149,709.00	
VISTRA OPERATI 5% 7/31/27 144A	215,000.00	213,985.20	
VISTRA OPERATI 7.75% 10/31 RGS	100,000.00	105,250.00	
VM CONSOLIDATED 5.5% 4/29 RGS	100,000.00	99,136.00	
WALKER & D 6.625% 04/01/33 RGS	45,000.00	45,457.20	
WALTER ENERGY 9.5% 10/19 144A	340,000.00	—	
WAND NEWCO 3 7.625% 01/30/32 RGS	175,000.00	181,676.25	
WASTE MGMT 3.875% 01/15/29 RGS	65,000.00	63,229.40	
WASTE PRO USA 7% 02/01/33 REGS	55,000.00	56,841.95	
WAYFAIR LLC 7.25% 10/31/29 RGS	55,000.00	53,056.30	
WAYFAIR LLC 7.75% 09/15/30 RGS	100,000.00	96,997.00	
WESCO DIST 6.375% 03/15/33 RGS	90,000.00	91,207.80	
WINDSTREAM ESCR 8.25% 10/01/31 RGS	310,000.00	321,361.50	
WOLFSPEED INC CV 1.875% 12/29	150,000.00	22,500.00	
WR GRACE HLD 7.375% 3/1/31 RGS	120,000.00	121,441.20	
WR GRACE HOLD 5.625% 8/29 REGS	130,000.00	114,037.30	
WRANGLER 6.625% 4/01/32 RGS	100,000.00	102,518.00	
WYNN LLC/CORP 7.125% 02/15/31	100,000.00	104,125.00	
WYNN LLC/CORP 7.125% 02/31 RGS	190,000.00	197,940.10	
XPO INC 7.125% 06/01/31 REGS	100,000.00	103,304.00	

		YUM BRANDS INC 4.625% 01/31/32	200,000.00	188,260.00	
		ZF NORTH AMER C 6.875% 04/14/28 REGS	150,000.00	147,403.50	
	アメリカ・ドル	小計	55,553,665.00	50,796,864.51 (7,282,238,496)	
社債券 合計				7,282,238,496 (7,282,238,496)	
合計				7,289,017,243 (7,289,017,243)	

（注）新株予約権証券における券面総額の数値は証券数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株 予約権証券 時価比率	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 13銘柄	2.42%	-%	-%	100%
	新株予約権証券 6銘柄	-%	0.07%	-%	
	国債証券 1銘柄	-%	-%	0.02%	
	社債券 472銘柄	-%	-%	97.49%	

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ 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。

④ 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	AMER TM 1ST OUT TL B ILN 06/28 C1	36,822.98	100.39 36,968.43	100.00 36,822.98	△145.45	—
	AMERICAN AIR TERM B ILN 5/7/32	5,000.00	99.00 4,950.00	100.37 5,018.75	68.75	—
	AMERICAN ROCK SAL TM ILN 06/28 C1	98,896.05	84.22 83,293.22	80.83 79,940.64	△3,352.58	—
	ASCEND LEARNING TM 2LN 11/29 C1	4,701.99	99.44 4,676.12	98.62 4,637.33	△38.79	—
	ASURION TM B10 ILN 8/19/28 C1	99,489.80	100.00 99,489.80	99.25 98,743.62	△746.18	—
	AUTHENTIC BRND TM B1 ILN 12/28 C1	29,180.99	100.87 29,435.74	99.06 28,907.56	△528.18	—
	BASS PRO TERM B 1LN 01/23/32 C1	14,962.50	99.49 14,887.68	99.35 14,865.24	△22.44	—
	BASS PRO TERM B 1LN 01/23/32 C1	160,000.00	98.62 157,800.00	99.35 158,960.00	1,160.00	—
	BAUSCH HLTH TM B 1LN 10/08/30 C1	100,000.00	97.50 97,500.00	95.18 95,188.00	△2,312.00	—
	CAMPING WORLD TM B ILN 06/28 C1	7,772.38	97.84 7,605.27	96.22 7,479.28	△125.99	—
	CAMPING WORLD TM B ILN 06/28 C2	138,792.50	97.85 135,811.23	96.22 133,558.63	△2,252.60	—
	CANO HEALTH TERM ILN 6/28/29 C1	41,614.34	98.99 41,198.16	89.00 37,036.76	△4,161.40	—
	CAST & CREW TM B INC ILN 12/28 C1	74,614.30	95.87 71,535.71	96.95 72,338.56	802.85	—
	CLARIOS TERM B 1LN 01/28/32 C1	20,000.00	99.87 19,975.00	99.65 19,931.20	△43.80	—
	CLUB CAR TERM ILN 1/6/28 C1	19,948.32	97.74 19,499.48	96.67 19,284.43	△215.05	—
	CLUB CAR TERM ILN 1/6/28 C1	24,935.40	98.24 24,499.03	96.67 24,105.54	△393.49	—
	CLUB CAR TERM ILN 1/6/28 C1	54,857.88	98.25 53,897.87	96.67 53,032.20	△865.67	—
	CONSOLIDATED EN TM B ILN 11/30 C1	99,748.11	97.74 97,503.77	91.54 91,311.41	△6,192.36	—
	CONSTANT CO TERM B ILN 2/10/28 C1	104,544.06	92.89 97,113.97	94.40 98,695.86	1,581.89	—
	CONVERGINT TM B 1LN 03/18/2028 C1	9,625.45	100.49 9,673.38	100.18 9,643.54	△29.84	—
	COX MEDIA TERM B2 ILN 06/29 C1	173,442.60	89.12 154,575.51	95.93 166,397.36	11,821.85	—
	CSC SERVICEWORKS TM B 1LN 3/28 C1	75,000.00	82.75 62,062.50	85.16 63,875.25	1,812.75	—
	CSC SERVICEWORKS TM B 1LN 3/28 C1	198,449.60	84.41 167,525.19	85.16 169,013.57	1,488.38	—
	DARKTRACE TERM ILN 07/02/2031 C1	100,000.00	100.01 100,010.00	99.95 99,950.00	△60.00	—

ECO MATERIAL TECH TM 1LN 02/32 C1	5,000.00	99.75 4,987.50	99.81 4,990.65	3.15	—
ENSEMBLE HEALTH TM B 1LN 08/29 C1	4,962.41	100.66 4,995.21	100.03 4,964.29	△30.92	—
ENSEMBLE HEALTH TM B 1LN 08/29 C1	5,000.00	99.50 4,975.00	100.03 5,001.90	26.90	—
GLOVES BUYER IN 1 TERM B 01/3	10,000.00	99.50 9,950.00	97.07 9,707.50	△242.50	—
GTT CMM TM NEW\$HLDCO 1LN 10/31 C1	39,383.09	74.49 29,339.98	79.00 31,112.64	1,772.66	—
HERSCHEND ENTER 1 TERM 05/32	5,000.00	99.75 4,987.50	100.20 5,010.40	22.90	—
HEXION TM 1LN 03/15/29 C1	197,484.79	100.56 198,592.67	99.44 196,390.72	△2,201.95	—
INTERNET BRANDS TM B 1LN 12/31	100,000.00	88.75 88,750.00	91.98 91,984.00	3,234.00	—
INTERNET BRANDS TM B 1LN 12/31	26,564.18	96.99 25,767.25	91.98 24,434.79	△1,332.46	—
INTRAFFI TERM B 1LN 07/18/31	99,750.00	99.50 99,251.25	100.06 99,812.84	561.59	—
LUMEN TM B2 1LN SPR PRI 04/30 C1	150,000.00	93.62 140,437.50	95.51 143,274.00	2,836.50	—
MYEYEDR TERM B 1LN 04/15/31 C1	147,321.68	100.68 148,332.30	100.05 147,395.34	△936.96	—
NATGASOLINE LLC TM B 1LN 03/30 C1	65,000.00	97.00 63,050.00	97.75 63,537.50	487.50	—
NATGASOLINE LLC TM B 1LN 03/30 C1	35,000.00	97.75 34,212.50	97.75 34,212.50	—	—
NCR VOYIX TM 1LN 09/30/31 C1	4,987.50	99.49 4,962.56	100.21 4,998.17	35.61	—
NEPTUNE BID US 1 TERM B 04/29 C1	149,238.58	90.24 134,687.81	91.28 136,226.46	1,538.65	—
NEW FORTR TM B 1LN 10/28 C1	75,000.00	71.00 53,250.00	49.72 37,296.75	△15,953.25	—
NEW FORTR TM B 1LN 10/28 C1	185,000.00	92.00 170,200.00	49.72 91,998.65	△78,201.35	—
NOVOLEX TERM 1LN 03/30/29 C1	46,600.00	100.34 46,758.47	99.37 46,308.75	△449.72	—
PAREXEL TERM B 1LN 11/15/2028 C1	37,300.75	100.60 37,525.30	100.03 37,312.31	△212.99	—
PF CHANGS TERM B 1LN 03/01/26 C1	44,761.90	95.99 42,971.42	95.00 42,523.80	△447.62	—
PF CHANGS TERM B 1LN 03/01/26 C2	119.05	96.00 114.29	95.00 113.09	△1.20	—
RADIOLOGY PARTN TM B 1LN 01/29 C1	74,235.47	95.00 70,523.70	99.01 73,504.99	2,981.29	—
RADIOLOGY PARTN TM B 1LN 01/29 C2	764.53	94.99 726.30	99.01 757.00	30.70	—
SANCHEZ DIP ROLL UP TL 5/11/20 C1	44,000.00	— —	— —	—	—

SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C1	53,418.37	— —	— —	— —	— —
SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C2	48,229.11	— —	— —	— —	— —
SANDISK TERM B 1LN 2/20/2032 C1	100,000.00	98.50 98,500.00	98.50 98,500.00	— —	— —
SFR TERM B14 1LN 08/15/28	19,949.11	90.00 17,954.20	91.50 18,253.43	299.23	—
SFR TERM B14 1LN 08/15/28 C1	154,605.60	87.50 135,279.90	91.50 141,464.12	6,184.22	—
SFR TERM B14 1LN 08/15/28 C1	24,936.39	89.49 22,318.06	91.50 22,816.79	498.73	—
THE TRAVEL CORP TM B 1LN 12/31 C1	43,915.38	99.00 43,476.23	91.00 39,962.99	△3,513.24	—
THE TRAVEL CORP TM B 1LN 12/31 C2	3,547.08	99.00 3,511.61	91.00 3,227.84	△283.77	—
THE TRAVEL CORP TM B 1LN 12/31 C3	7,537.54	98.99 7,462.16	91.00 6,859.16	△603.00	—
TKC HOLDINGS TERM 1LN 05/15/28 C1	139,256.31	100.00 139,256.31	100.12 139,430.38	174.07	—
TRAEGER GRILLS TERM B 1LN 6/28 C1	89,981.42	96.95 87,244.18	87.97 79,158.45	△8,085.73	—
TRIPADVISOR TM B 1LN 07/01/31 C1	4,975.00	100.16 4,983.25	99.00 4,925.25	△58.00	—
TRUIST INSURANCE TM 2L 03/32 C1	52,631.58	102.04 53,710.52	100.00 52,631.58	△1,078.94	—
UKG TERM B 1LN 02/10/31 C1	196,992.41	100.51 198,014.80	100.24 197,477.01	△537.79	—
UNITED PLANET FIT TM 1LN 12/26 C1	144,216.79	96.03 138,493.19	96.06 138,538.97	45.78	—
UNITED PLANET FIT TM 1LN 12/26 C1	25,000.00	95.25 23,812.50	96.06 24,015.75	203.25	—
VIALTO TM 1LN 04/29/29 C1	66,611.06	90.17 60,067.85	84.60 56,352.95	△3,714.90	—
VIALTO TM 1LN 04/29/29 C2	32,325.95	90.17 29,150.57	84.60 27,347.75	△1,802.82	—
WEBER-STEPHEN TM B 1LN 10/27 C1	59,618.52	95.37 56,860.56	98.48 58,713.51	1,852.95	—
WESTINGHOUSE TM B 1LN 1/21/31 C1	58,805.61	100.32 58,998.49	99.82 58,701.52	△296.97	—
WHITE CAP TM B 1LN 10/19/29 C1	4,975.00	100.00 4,975.00	98.93 4,922.16	△52.84	—
WHP TERM B 1LN 02/20/32 C1	55,000.00	99.50 54,725.00	98.75 54,312.50	△412.50	—
WIN WASTE TERM B 1LN 03/25/28 C1	59,844.96	97.99 58,648.06	99.14 59,330.88	682.82	—
WIN WASTE TERM B 1LN 03/25/28 C1	14,961.24	97.62 14,605.91	99.14 14,832.72	226.81	—
YAHOO MEDIA TERM B1 1LN 09/27 C1	25,000.00	90.12 22,531.25	89.42 22,356.25	△175.00	—

貸付債権／アメリカ・ドル 小計		4,345,415.17 (622,958,719)	4,245,738.71 (608,669,101)	△99,676.46 (△14,289,618)	
貸付債権 合 計		622,958,719 (622,958,719)	608,669,101 (608,669,101)	△14,289,618 (△14,289,618)	
合 計		622,958,719 (622,958,719)	608,669,101 (608,669,101)	△14,289,618 (△14,289,618)	

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】

（2025年6月30日現在）

種 類	金 額	単 位
I 資産総額	2,315,299,889	円
II 負債総額	1,979,288	円
III 純資産総額（I－II）	2,313,320,601	円
IV 発行済数量	5,219,238,685	口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.4432	円

（参考）マザーファンドの純資産額計算書

フィデリティ・ハイ・イールド・ボンド・オープン・マザーファンド

（2025年6月30日現在）

種 類	金 額	単 位
I 資産総額	8,336,137,249	円
II 負債総額	111,180,446	円
III 純資産総額（I－II）	8,224,956,803	円
IV 発行済数量	888,316,828	口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	9.2590	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12月末日現在）

（略）

<訂正後>

(1) 資本金等（2025年6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12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179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6,719,769,129,858円です。

<訂正後>

（略）

2025年6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173本、単位型株式投資信託2本、親投資信託50本で、親投資信託を除いた純資産の合計は総額6,785,054,631,130円です。

3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

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

当社の財務諸表は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第39期事業年度（2024年1月1日から2024年12月31日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

当社は財務諸表の適正性を確保するための特段の取り組みを行っております。
具体的には、企業会計基準及び同適用指針、日本公認会計士協会が公表する委員会報告等の公開情報、各種関係諸法令の改廃に応じて、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38期 (2023年12月31日)	第39期 (2024年12月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	2,269,485	3,084,299
立替金	59,949	21,131
前払費用	460,082	484,198
未収委託者報酬	9,026,865	12,960,510
未収運用受託報酬	5,354,461	1,086,735
未収収益	5,845	6,173
未収入金	*1 152,986	221,095
流動資産計	17,329,675	17,864,144
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 5,953,460	10,338,660
長期差入保証金	11,755	18,010
繰延税金資産	288,014	391,802
その他	230	30
投資その他の資産合計	6,253,460	10,748,502
固定資産計	6,260,947	10,755,990
資産合計	23,590,622	28,620,134
負債の部		
流動負債		
預り金	7	281
未払金		
未払手数料	4,192,323	6,016,095
その他未払金	*1 2,192,059	3,057,214
未払費用	3,445,819	1,829,913
未払法人税等	1,616,600	1,974,827
未払消費税等	1,176,325	1,106,116
賞与引当金	376,001	587,810
流動負債合計	12,999,137	14,572,260
固定負債		
退職給付引当金	2,028,331	1,704,391
固定負債合計	2,028,331	1,704,391
負債合計	15,027,469	16,276,651
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	7,313,153	11,093,482
利益剰余金合計	7,563,153	11,343,482
株主資本合計	8,563,153	12,343,482
純資産合計	8,563,153	12,343,482
負債・純資産合計	23,590,622	28,620,134

（２）【損益計算書】

(単位：千円)

	第38期 (自 2023年1月1日 至 2023年12月31日)	第39期 (自 2024年1月1日 至 2024年12月31日)
営業収益		
委託者報酬	55,200,925	74,361,841
運用受託報酬	10,031,924	3,700,902
その他営業収益	153,966	142,274
営業収益計	65,386,816	78,205,018
営業費用	*1	
支払手数料	25,160,937	33,922,199
広告宣伝費	282,742	271,857
調査費		
調査費	551,589	699,501
委託調査費	15,194,030	16,481,661
営業雑経費		
通信費	139,609	81,011
印刷費	47,328	42,205
協会費	27,212	29,487
その他	2,007	865
営業費用計	41,405,457	51,528,790
一般管理費		
給料		
給料・手当	2,762,834	2,592,272
賞与	1,333,847	1,721,474
福利厚生費	575,347	564,602
交際費	17,945	20,876
旅費交通費	108,866	156,220
租税公課	205,434	228,830
弁護士報酬	2,569	3,599
不動産賃貸料・共益費	427,958	444,013
退職給付費用	272,377	218,294
消耗器具備品費	17,110	27,813
事務委託費	7,249,585	7,484,171
諸経費	288,510	259,961
一般管理費計	13,262,388	13,722,133
営業利益	10,718,971	12,954,093
営業外収益		
受取利息	*1 16,559	44,132
保険配当金	10,648	-
雑益	108	593
営業外収益計	27,315	44,726
営業外費用		
寄付金	1,500	1,100
為替差損	112,525	171,971
雑損	306	305
営業外費用計	114,331	173,376
経常利益	10,631,955	12,825,442
特別損失		
特別退職金	52,541	273,189
特別損失計	52,541	273,189
税引前当期純利益	10,579,414	12,552,253
法人税、住民税及び事業税	3,230,427	3,875,711
法人税等調整額	83,253	(103,787)
法人税等合計	3,313,680	3,771,923
当期純利益	7,265,733	8,780,329

（３）【株主資本等変動計算書】

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	利益剰余金 合計		
			繰越利益剰余金			
当期首残高	1,000,000	250,000	5,047,420	5,297,420	6,297,420	6,297,420
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	(5,000,000)	(5,000,000)	(5,000,000)	(5,000,000)
当期純利益	-	-	7,265,733	7,265,733	7,265,733	7,265,733
当期変動額合計	-	-	2,265,733	2,265,733	2,265,733	2,265,733
当期末残高	1,000,000	250,000	7,313,153	7,563,153	8,563,153	8,563,153

第39期（自 2024年1月1日 至 2024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	利益剰余金 合計		
			繰越利益剰余金			
当期首残高	1,000,000	250,000	7,313,153	7,563,153	8,563,153	8,563,153
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	-	-	8,780,329	8,780,329	8,780,329	8,780,329
当期変動額合計	-	-	3,780,329	3,780,329	3,780,329	3,780,329
当期末残高	1,000,000	250,000	11,093,482	11,343,482	12,343,482	12,343,482

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

賞与引当金は、当期末において発生していると認められる賞与支給見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

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

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す。

(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。

第39期（自 2024年1月1日 至 2024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38期 (2023年12月31日)	第39期 (2024年12月31日)
未収入金	4,375 千円	20 千円
その他未払金	1,487,550 千円	2,139,526 千円
長期貸付金	5,943,660 千円	10,288,660 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38期 (自 2023年1月1日 至 2023年12月31日)	第39期 (自 2024年1月1日 至 2024年12月31日)
営業費用	19,338,423 千円	20,907,744 千円
受取利息	12,877 千円	43,474 千円

(株主資本等変動計算書関係)

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

① 金銭による配当

該当事項はありません。

② 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

第39期（自 2024年1月1日 至 2024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

① 金銭による配当

該当事項はありません。

② 金銭以外による配当

2024年12月11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 2024年12月11日
(5) 効力発生日 2024年12月11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おりません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

上記の金融商品については、現金及び預金であること、及び短期間で決済されるため時価が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。

2024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39期（2024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	10,338,660	10,338,660	-
資産計	10,338,660	10,338,660	-

(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

上記の金融商品については、現金及び預金であること、及び短期間で決済されるため時価が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(10,338,660千円)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。

第39期（2024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	-	10,338,660	-	10,338,660
資産計	-	10,338,660	-	10,338,660

(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。

(退職給付関係)

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。

第39期（自 2024年1月1日 至 2024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	2,028,331
勤務費用	170,987
利息費用	31,416
数理計算上の差異の発生額	△49,451
退職給付の支払額	△476,892
退職給付債務の期末残高	1,704,391

(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	1,704,391
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,704,391
退職給付引当金	1,704,391
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,704,391

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	150,332
利息費用	27,620
数理計算上の差異の費用処理額	△49,451
確定給付型年金制度に係る退職給付費用	128,501

(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89,793千円であります。

(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、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38期 (2023年12月31日)	第39期 (2024年12月31日)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払費用	89,646	129,538
賞与引当金	115,131	179,987
退職給付引当金	621,075	521,884
資産除去債務	1,644	-
その他	125,470	120,245
繰延税金資産小計	952,966	951,654
評価性引当額	△664,952	△559,852
繰延税金資産合計	288,014	391,802
繰延税金資産又は繰延税金負債（△）の純額	288,014	391,802

3. 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38期 (2023年12月31日)	第39期 (2024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	0.33%	0.37%
評価性引当額	2.62%	△0.84%
過年度法人税等	△2.25%	△0.11%
その他	0.01%	0.01%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.32%	30.05%

(資産除去債務関係)

第38期（2023年12月31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。

第39期（2024年12月31日）

該当事項はありません。

(収益認識関係)

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

第39期（自 2024年1月1日 至 2024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	74,361,841	-	74,361,841
運用受託報酬	3,125,882	575,019	3,700,902
その他営業収益	142,274	-	142,274
合計	77,629,998	575,019	78,205,018

2. 収益を理解するための基礎となる情報

第38期（自 2023年1月1日 至 2023年12月31日）及び 第39期（自 2024年1月1日 至 2024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。

第39期（自 2024年1月1日 至 2024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	14,381,326	14,047,245

(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38期（自 2023年1月1日 至 2023年12月31日）及び 第39期（自 2024年1月1日 至 2024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。

第39期（自 2024年1月1日 至 2024年12月31日）

1.サービスごとの情報

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

2.地域ごとの情報

(1)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

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・世界割安成長株投信 Bコース（為替ヘッジなし）	12,037,120	資産運用業
フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド	10,494,207	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）	9,738,287	資産運用業
フィデリティ・日本成長株・ファンド	7,773,418	資産運用業

(関連当事者情報)

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	共通発生経費 負担額（注3）	千円 14,263,790	未払金	千円 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3） 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 46,398 5,000,000	長期貸付金 未収収益 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3）	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)
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 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3） 投資信託販売 に係る代行手 数料（注4） グループ通算 制度の通算税 効果額	千円 357,778 813,267 478,598	未収入金 未払金 未払金	千円 115,231 72,123 478,598

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

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

2. 親会社に関する注記

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

第39期（自 2024年1月1日 至 2024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	共通発生経費 負担額 (注3)	千円 15,291,594	未払金	千円 1,415,860
親会社	フィデリ ティ・ ジャパ ン・ホー ルディ ングス株 式会社	東京都港 区	千円 4,510,000	グループ 会社経営 管理	被所有直 接100 %	当社事業 活動の管 理等役員 の兼任	金銭の貸付 (注1) 利息の受取 (注1) 共通発生経費 負担額 (注3) グループ通算 制度の通算税 効果額 剰余金の配当	千円 4,345,000 43,474 253,613 87,964 5,000,000	長期貸付金 未収収益 未払金 未払金 未払金	千円 10,288,660 — 31,416 87,964 —
親会社	FIL Asia Holdings Pte. Limited	シンガ ポール、 ブルバード 市	千米ドル 189,735	グループ 会社経営 管理	被所有間 接100%	営業取引	共通発生経費 負担額 (注3)	千円 5,362,536	未払金	千円 604,284

(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 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3)	千円 326,438	未収入金	千円 89,593
							投資信託販売 に係る代行手 数料 (注4)	885,458	未払金	70,310
							グループ通算 制度の通算税 効果額	459,148	未払金	459,148

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

- ・FIL Limited（非上場）
- ・FIL Asia Holdings Pte. Limited（非上場）
- ・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38期 (自 2023年1月1日 至 2023年12月31日)	第39期 (自 2024年1月1日 至 2024年12月31日)
1株当たり純資産額	428,157円66銭	617,174円15銭
1株当たり当期純利益	363,286円66銭	439,016円48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38期 (自 2023年1月1日 至 2023年12月31日)	第39期 (自 2024年1月1日 至 2024年12月31日)
当期純利益(千円)	7,265,733	8,780,329
普通株式に係る当期純利益(千円)	7,265,733	8,780,329
期中平均株式数	20,000株	20,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

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

<更新・訂正後>

ファンドの運営における役割	名称	資本金の額 (2025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	SMBC日興証券株式会社	135,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
	マネックス証券株式会社	13,195百万円	
	三菱UFJ eスマート証券株式会社	7,196百万円	
	楽天証券株式会社	19,495百万円	
	株式会社ＳＢＩ証券	54,323百万円	
	四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	
	松井証券株式会社	11,945百万円	
	株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,900百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
	株式会社十六銀行	36,800百万円	
	株式会社常陽銀行	85,100百万円	
	PayPay銀行株式会社	72,210百万円	
	株式会社伊予銀行	20,900百万円	
	株式会社滋賀銀行	33,000百万円	
	株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	
	株式会社京都銀行	42,100百万円	

	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。
運用の委託先	FIAM LLC	199,967,776米ドル （約31,630百万円*） * 1米ドル158.18円で換算 （2024年12月末日現在）	主として米国においてファンドに対する投資顧問業務を営んでいます。

独立監査人の監査報告書

2025年8月18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・ハイ・イールド・ボンド・オープンポートフォリオB（為替ヘッジあり）の2024年11月23日から2025年5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・ハイ・イールド・ボンド・オープンポートフォリオB（為替ヘッジあり）の2025年5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

2025年3月7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2024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。

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。