

## 受益者のみなさまへ

毎々、格別のお引き立てにあずかり、厚くお礼申し上げます。

さて、「フィデリティ・世界分散・ファンド(債券重視型)」、「フィデリティ・世界分散・ファンド(株式重視型)」は、第104期～第106期まで決算を行いましたので、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

第36作成期(2023年5月11日～2023年11月10日)

第104期(決算日 2023年7月10日)

第105期(決算日 2023年9月11日)


第106期(決算日 2023年11月10日)

### ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商品分類   | 追加型投信／内外／資産複合  |  |
|--------|--|--|
| 信託期間   | 原則無期限です。   |  |
| 運用方針   | <p>「フィデリティ・世界分散・ファンド(債券重視型)」、「フィデリティ・世界分散・ファンド(株式重視型)」は、主として、フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド、フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド、フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンドの各受益証券への投資を通じて、世界(日本を含みます。)の債券、株式、不動産投資信託(リート)へ実質的に分散投資を行い、主として配当等収入を確保することを目的に運用を行い、長期的な投資信託財産の成長を目指します。</p> <p>基本資産配分に関する運用にあたっては、FILインベストメント・マネジメント(香港)・リミテッドに、運用の指図に関する権限を委託します。</p> <p>ファンドの運用にあたっては、FILインベストメンツ・インターナショナルに、上記以外のファンドの運用の指図に関する権限を委託することがあります。</p> |  |
| 主要運用対象 | 当ファンド  | 主として、フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド、フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド、フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンドの各受益証券に投資を行います。       |
|        | マザーファンド  | フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド、フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド、フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンドに関しては、各マザーファンドの表紙をご参照ください。 |
| 組入制限   | 当ファンド  | 投資信託証券および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外への直接投資は行いません。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。                        |
|        | マザーファンド  | フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド、フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド、フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンドに関しては、各マザーファンドの表紙をご参照ください。 |
| 分配方針   | <p>毎決算時(原則1月、3月、5月、7月、9月および11月の各10日。同日が休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の収益分配方針に基づき分配を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>●分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収入と売買益(評価益を含みません。)等の全額とします。</li> <li>●収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。</li> <li>●留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</li> </ul>  |  |

### 〈お問合せ先〉

フィデリティ投信株式会社 カスタマー・コミュニケーション部  
東京都港区六本木七丁目7番7号 TRI-SEVEN ROPPONGI

 0120-00-8051 (無料)

受付時間: 営業日の午前9時～午後5時

 <https://www.fidelity.co.jp/>

お客様の口座内容などに関するご照会は、お申し込みされた販売会社にお尋ねください。

# フィデリティ・世界分散・ファンド (債券重視型／株式重視型)

## 愛称: 3つのチカラ

フィデリティ投信株式会社

## 《フィデリティ・世界分散・ファンド（債券重視型）》

### ■最近5作成期の運用実績

| 作成期                 | 基準価額        |               |             | 投資組<br>資産入<br>信証比<br>託券率 | 投資組<br>資産入<br>証比<br>券率 | 純資産<br>総額    |
|---------------------|-------------|---------------|-------------|--------------------------|------------------------|--------------|
|                     | (分配落)       | 税分<br>配<br>込金 | 騰<br>落<br>率 |                          |                        |              |
| 32作成期末（2021年11月10日） | 円<br>10,490 | 円<br>160      | %<br>4.9    | %<br>3.4                 | %<br>95.1              | 百万円<br>7,274 |
| 33作成期末（2022年5月10日）  | 10,211      | 90            | △1.8        | 3.7                      | 94.5                   | 6,851        |
| 34作成期末（2022年11月10日） | 10,054      | 160           | 0.0         | 3.9                      | 94.3                   | 6,638        |
| 35作成期末（2023年5月10日）  | 10,075      | 90            | 1.1         | 3.5                      | 94.4                   | 6,428        |
| 36作成期末（2023年11月10日） | 10,655      | 210           | 7.8         | 3.5                      | 95.0                   | 6,490        |

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。（分配金を再投資することにより算出したファンドの騰落率とは異なります。）

（注2）当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「投資信託受益証券組入比率」「投資証券組入比率」は実質比率を記載しています。

（注3）当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークは設定しておりません。

（注4）32作成期対応期間（第92期～第94期）、33作成期対応期間（第95期～第97期）、34作成期対応期間（第98期～第100期）、35作成期対応期間（第101期～第103期）、36作成期対応期間（第104期～第106期）の各作成期末税込分配金は、各作成期対応期間の累計です。

### ■過去6ヶ月間の基準価額等の推移

| 決算期   | 年 月 日            | 基準価額        |             | 投資組<br>資産入<br>信証比<br>託券率 | 投資組<br>資産入<br>証比<br>券率 |
|-------|------------------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------|
|       |                  | 騰<br>落<br>率 | 騰<br>落<br>率 |                          |                        |
| 第104期 | (期首) 2023年5月10日  | 円<br>10,075 | %<br>—      | %<br>3.5                 | %<br>94.4              |
|       | 5月末              | 10,183      | 1.1         | 3.5                      | 94.7                   |
|       | 6月末              | 10,668      | 5.9         | 3.5                      | 94.1                   |
|       | (期末) 2023年7月10日  | 10,427      | 3.5         | 3.6                      | 94.2                   |
| 第105期 | (期首) 2023年7月10日  | 10,397      | —           | 3.6                      | 94.2                   |
|       | 7月末              | 10,533      | 1.3         | 3.5                      | 94.6                   |
|       | 8月末              | 10,786      | 3.7         | 3.5                      | 94.9                   |
|       | (期末) 2023年9月11日  | 10,687      | 2.8         | 3.5                      | 94.5                   |
| 第106期 | (期首) 2023年9月11日  | 10,537      | —           | 3.5                      | 94.5                   |
|       | 9月末              | 10,410      | △1.2        | 3.6                      | 94.7                   |
|       | 10月末             | 10,285      | △2.4        | 3.6                      | 94.7                   |
|       | (期末) 2023年11月10日 | 10,685      | 1.4         | 3.5                      | 95.0                   |

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

## 《フィデリティ・世界分散・ファンド（株式重視型）》

### ■最近5作成期の運用実績

| 作成期                 | 基準価額        |                   |                  | 投資組<br>資産入<br>信証比<br>託券率 | 投資組<br>資産入<br>証比<br>券率 | 純資産<br>総額    |
|---------------------|-------------|-------------------|------------------|--------------------------|------------------------|--------------|
|                     | (分配落)       | 税分<br>配<br>込<br>金 | 期<br>騰<br>落<br>率 |                          |                        |              |
| 32作成期末（2021年11月10日） | 円<br>10,625 | 円<br>220          | %<br>5.1         | %<br>1.7                 | %<br>97.3              | 百万円<br>4,893 |
| 33作成期末（2022年5月10日）  | 10,626      | 120               | 1.1              | 1.8                      | 96.7                   | 4,821        |
| 34作成期末（2022年11月10日） | 10,596      | 270               | 2.3              | 1.9                      | 96.6                   | 4,785        |
| 35作成期末（2023年5月10日）  | 10,691      | 170               | 2.5              | 1.7                      | 96.6                   | 4,786        |
| 36作成期末（2023年11月10日） | 11,166      | 420               | 8.4              | 1.7                      | 97.1                   | 4,832        |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。(分配金を再投資することにより算出したファンドの騰落率とは異なります。)

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「投資信託受益証券組入比率」「投資証券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注3) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークは設定しておりません。

(注4) 32作成期対応期間(第92期～第94期)、33作成期対応期間(第95期～第97期)、34作成期対応期間(第98期～第100期)、35作成期対応期間(第101期～第103期)、36作成期対応期間(第104期～第106期)の各作成期末税込分配金は、各作成期対応期間の累計です。

### ■過去6ヶ月間の基準価額等の推移

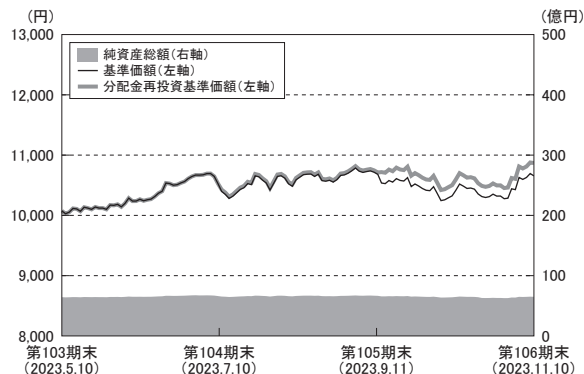
| 決算期   | 年 月 日            | 基準価額        |        | 投資組<br>資産入<br>信証比<br>託券率 | 投資組<br>資産入<br>証比<br>券率 |
|-------|------------------|-------------|--------|--------------------------|------------------------|
|       |                  | 騰           | 落 率    |                          |                        |
| 第104期 | (期首) 2023年5月10日  | 円<br>10,691 | %<br>— | %<br>1.7                 | %<br>96.6              |
|       | 5月末              | 10,774      | 0.8    | 1.8                      | 96.9                   |
|       | 6月末              | 11,350      | 6.2    | 1.8                      | 96.3                   |
|       | (期末) 2023年7月10日  | 11,067      | 3.5    | 1.8                      | 96.5                   |
| 第105期 | (期首) 2023年7月10日  | 11,032      | —      | 1.8                      | 96.5                   |
|       | 7月末              | 11,261      | 2.1    | 1.7                      | 96.8                   |
|       | 8月末              | 11,498      | 4.2    | 1.7                      | 97.0                   |
|       | (期末) 2023年9月11日  | 11,388      | 3.2    | 1.8                      | 96.6                   |
| 第106期 | (期首) 2023年9月11日  | 11,038      | —      | 1.8                      | 96.6                   |
|       | 9月末              | 10,938      | △0.9   | 1.8                      | 96.9                   |
|       | 10月末             | 10,732      | △2.8   | 1.8                      | 96.9                   |
|       | (期末) 2023年11月10日 | 11,201      | 1.5    | 1.7                      | 97.1                   |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

## ■運用経過の説明

### ●基準価額等の推移

#### (債券重視型)

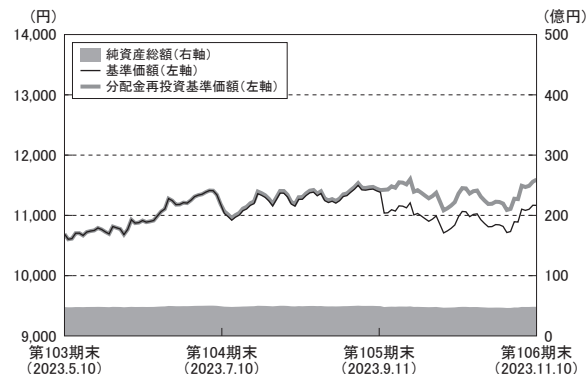


第104期首: 10,075円

第106期末: 10,655円 (既払分配金210円)

騰落率: 7.9% (分配金再投資ベース)

#### (株式重視型)



第104期首: 10,691円

第106期末: 11,166円 (既払分配金420円)

騰落率: 8.4% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、2023年5月10日の値をファンドの基準価額と同一になるように指数化しています。

\* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

\* 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客様の損益の状況を示すものではありません。

※当ファンドは、運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマーク及び参考指数は設定しておりません。

### ●基準価額の主な変動要因

当期のフィデリティ・世界分散・ファンド(債券重視型)のリターンは+7.9%、フィデリティ・世界分散・ファンド(株式重視型)のリターンは+8.4%でした。

#### <プラス要因>

- ・世界の株式市場が堅調に推移したこと
- ・円に対して米ドル、英ポンド、ユーロが上昇したこと

#### <マイナス要因>

- ・世界の国債及びリートが低迷したこと

## ●投資環境

### 【債券】

当期の世界の債券市場はハイ・イールド債券や新興国債券が国債を上回るパフォーマンスを見せるなどまちまちの展開となりました。期初は3月に発生した銀行セクターを巡る懸念から依然として不透明感が残る中、米地銀のファースト・リパブリック・バンク(FRC)が破綻・閉鎖に追い込まれましたが、大手銀行がFRCを買収したことなどが市場の安心感につながり、ボラティリティが大幅に低下しました。その後、期中盤にかけては堅調な企業業績や労働市場、経済の底堅さに加え、インフレ率の鈍化傾向が示されたことを背景に市場には楽観的な見方が広がりました。しかし、10月に入ると、中東情勢の緊迫化を受けて投資家心理は悪化しました。主要中央銀行の金融政策に目を向けると、米連邦準備制度理事会(FRB)は、5月と7月の米連邦公開市場委員会(FOMC)で0.25%幅の利上げを行った後、9月のFOMCに続いて11月も政策金利を据え置き、追加利上げを見送りましたが、高い金利水準が長期化するとの見方を示しました。欧州中央銀行(ECB)は5月、6月、7月、9月と利上げを実施しましたが、10月の会合では政策金利の据え置きを決定しました。一方、日銀はイールド・カーブ・コントロールの運用の柔軟化を進めました。こうした状況の下、先進国を中心に国債利回りが上昇し、数年来の高水準となりました。社債は、景気後退リスクが和らいだことなどから、多くの地域でクレジット・スプレッドが縮小しました。投資適格債券は国債利回りの上昇が逆風となり、下落する展開となった一方、ハイ・イールド債券はアジアを除くすべての地域でプラスのパフォーマンスとなりました。

### 【株式】

当期の世界の株式市場は上昇しました。前半は、先進国のインフレ率に鎮静化の兆しが見え、市場では主要中央銀行が金融引き締めペースをさらに緩めるのではないかと期待が高まりました。また、堅調な企業業績や米国の4-6月期のGDP(国内総生産)の伸び率など、経済の底堅さが示され、市場では世界経済のソフトランディング(軟着陸)に対する期待が高まり、投資家心理を下支えしました。しかし期後半に入ると、インフレ率が依然として目標よりも高い水準で推移していることから、主要中央銀行は積極的な金融引き締め姿勢を維持し、高い金利水準が長期化する可能性が高いとの見方を示唆したことなどが投資家心理の重石となりました。また、中国の軟調な経済データや低迷が続く不動産セクターも市場の下押し圧力となりました。期終盤は、中東情勢の緊迫化が投資家心理をさらに冷やす展開となりました。このような状況の下、米国と日本が最も上昇した一方、日本を除く太平洋地域及び欧州は下落して期を終えました。中国経済の軟化を背景に、新興国市場は横ばいとなりました。業種別では、情報技術及びコミュニケーション・サービスが最も上昇しました。

### 【不動産投資信託(リート)】

当期の世界のリート市場は高い金利水準が長期化するとの見方から、下落して期を終えました。低迷が続く中国の不動産セクターの影響が世界の不動産セクター全体に波及し、投資家心理をさらに冷やす展開となりました。国別に見ると、米国は住宅の供給不足により、既に価格が高騰している市場に住宅ローン金利の上昇という圧力がさらに加わりました。ユーロ圏では、ドイツの不動産市場は借入れコスト上昇による先行き不透明感が残るものの、住宅価格に落ち着きが見られたことから横ばいで期を終えました。アジアでは、中国の不動産市場のボラティリティが上昇する中、中国不動産開発大手2社が経営難に陥ったことなどを背景に香港の不動産銘柄が急落しました。中国政府は、住宅ローン金利の引き下げや株式取引に係る印紙税の引き下げなど資本市場の活性化に向けた支援策を打ち出しました。日本は円安に加え、物流やサービス業にけん引された景気回復が市場を下支えたことなどから、海外投資家の関心が高まったものの、下落して期を終えました。英国のリート市場は6月に英イングランド銀行(中央銀行、BOE)が市場予想を上回る利上げを行ったことから、下落しました。

## ●ポートフォリオ

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、世界（日本を含む）の債券、株式、不動産投資信託（リート）に分散投資を行い、主に配当等収入を確保することを目的とした運用を行うとともに、長期的な投資信託財産の成長を目指しております。

マザーファンドの組み入れは、「債券重視型」について債券70%、株式15%、リート15%、「株式重視型」について債券35%、株式50%、リート15%の基本配分比率に基づき、各資産の利回り水準、流動性、リスク・リターン特性などを考慮して、配当等収入の確保とリスクの分散を目指して決定しております。当期につきましても、原則として、この比率を目標とした運用を行いました。

## ●ベンチマークとの差異

当ファンドは、運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマーク及び参考指数は設定しておりません。

## ■ 分配金

### (債券重視型)

当作成期の1万口当たり分配金(税引前)は、分配方針に基づき下記表中の分配額とさせていただきます。また、収益分配に充てなかった利益につきましては投資信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

### ● 分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり・税引前)

| 項目        | 第104期                 | 第105期                 | 第106期                  |
|-----------|-----------------------|-----------------------|------------------------|
|           | 2023年5月11日～2023年7月10日 | 2023年7月11日～2023年9月11日 | 2023年9月12日～2023年11月10日 |
| 当期分配金     | 30                    | 150                   | 30                     |
| (対基準価額比率) | 0.29%                 | 1.40%                 | 0.28%                  |
| 当期の収益     | 30                    | 150                   | 30                     |
| 当期の収益以外   | —                     | —                     | —                      |
| 翌期繰越分配対象額 | 941                   | 983                   | 1,102                  |

### (株式重視型)

当作成期の1万口当たり分配金(税引前)は、分配方針に基づき下記表中の分配額とさせていただきます。また、収益分配に充てなかった利益につきましては投資信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

### ● 分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり・税引前)

| 項目        | 第104期                 | 第105期                 | 第106期                  |
|-----------|-----------------------|-----------------------|------------------------|
|           | 2023年5月11日～2023年7月10日 | 2023年7月11日～2023年9月11日 | 2023年9月12日～2023年11月10日 |
| 当期分配金     | 35                    | 350                   | 35                     |
| (対基準価額比率) | 0.32%                 | 3.07%                 | 0.31%                  |
| 当期の収益     | 35                    | 350                   | 35                     |
| 当期の収益以外   | —                     | —                     | —                      |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,970                 | 1,975                 | 2,103                  |

- \* 「当期の収益」および「当期の収益以外」は円未満切捨てのため、合計額が「当期分配金」と一致しない場合があります。
- \* 当期分配金の「対基準価額比率」は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
- \* 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」が当該決算期末日時点の基準価額を上回ることがありますが、実際には基準価額を超えて分配金が支払われることはありません。

## ■ 今後の運用方針

当ファンドは、中長期的な観点から見たリスクの分散と配当等を含む収益の獲得に着目し、複数の資産に投資を行っています。今後も、投資信託証券への投資を通じ、基本資産配分比率から大きく乖離しない形で、3つの資産へ分散投資を行ってまいります。また、各投資信託証券におきましては、引き続きグローバルに展開する社内の調査ネットワークを活用した銘柄選択を行ってまいります。



《フィデリティ・世界分散・ファンド（債券重視型）》

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用明細

| 項目          | 第104期～第106期            |         | 項目の概要   |
|-------------|------------------------|---------|---|
|             | 2023年5月11日～2023年11月10日 |         |   |
|             | 金額                     | 比率      |   |
| (a) 信託報酬    | 45円                    | 0.431%  | (a) 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>当作成期中の平均基準価額は10,458円です。                              |
| （投信会社）      | (10)                   | (0.094) | 委託した資金の運用の対価  |
| （販売会社）      | (32)                   | (0.304) | 購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの<br>管理及び事務手続き等の対価                                |
| （受託会社）      | (3)                    | (0.033) | 運用財産の保管・管理、投信会社からの指図の実行の対価  |
| (b) 売買委託手数料 | 0                      | 0.000   | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{当作成期中の売買委託手数料}}{\text{当作成期中の平均受益権口数}}$                    |
| （投資証券）      | (0)                    | (0.000) | 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料  |
| (c) 有価証券取引税 | 0                      | 0.001   | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{当作成期中の有価証券取引税}}{\text{当作成期中の平均受益権口数}}$                    |
| （投資証券）      | (0)                    | (0.001) | 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金   |
| (d) その他費用   | 2                      | 0.019   | (d) その他費用＝ $\frac{\text{当作成期中のその他費用}}{\text{当作成期中の平均受益権口数}}$                        |
| （保管費用）      | (0)                    | (0.002) | 保管費用は、有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等のために、海外<br>における保管銀行等に支払う費用。また、信託事務の諸費用等が含まれます。          |
| （監査費用）      | (0)                    | (0.003) | 監査費用は、ファンドの監査人等に対する報酬及び費用   |
| （その他）       | (2)                    | (0.014) | その他には、法定書類等（有価証券届出書、目論見書、運用報告書等）の作成、<br>印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含ま<br>れます。 |
| 合計          | 47                     | 0.451   |   |

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

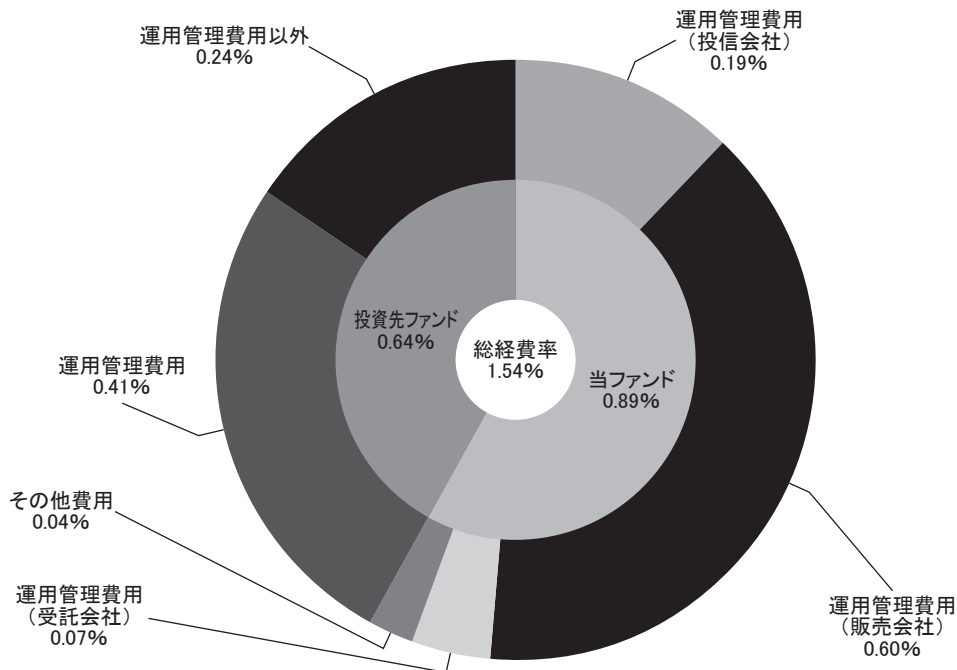
(注2) 「金額」欄は、各項目毎に円未満を四捨五入しています。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## (参考情報)

### ●総経費率

当期中の運用・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く。)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)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.54%です。



|                      |       |
|----------------------|-------|
| 総経費率(①+②+③)          | 1.54% |
| ①当ファンドの費用の比率         | 0.89% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率   | 0.41% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.24% |

(注1)①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2)各費用は、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含みません。

(注3)その他費用には、保管費用、監査費用以外に法定書類等(有価証券届出書、目論見書、運用報告書等)の作成、印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含まれます。

(注4)各比率は、年率換算した値です。

(注5)投資先ファンドとは、当ファンドが実質的に組入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)です。

(注6)①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注7)①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注8)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2023年5月11日から2023年11月10日まで）

| 決 算 期                    | 第 104 期 ～ 第 106 期 |              |               |               |  |
|--------------------------|-------------------|--------------|---------------|---------------|--|
|                          | 設 定               |              | 解 約           |               |  |
|                          | 口 数               | 金 額          | 口 数           | 金 額           |  |
| フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド    | 千口<br>11,864      | 千円<br>24,234 | 千口<br>175,953 | 千円<br>354,977 |  |
| フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド    | 1,001             | 3,422        | 28,215        | 96,114        |  |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 4,348             | 9,705        | 20,503        | 45,143        |  |

(注) 金額の単位未満は切捨て。

## ■利害関係人との取引状況等（2023年5月11日から2023年11月10日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

#### <フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド>

| 区 分      | 第 104 期 ～ |                         |        | 第 106 期   |                         |            |
|----------|-----------|-------------------------|--------|-----------|-------------------------|------------|
|          | 買付額等<br>A | うち利害<br>関係人との<br>取引状況 B | B<br>A | 売付額等<br>C | うち利害<br>関係人との<br>取引状況 D | D<br>C     |
| 投資信託受益証券 | 百万円<br>-  | 百万円<br>-                | %<br>- | 百万円<br>71 | 百万円<br>71               | %<br>100.0 |
| 投資証券     | -         | -                       | -      | 773       | 773                     | 100.0      |
| 為替       | 73        | -                       | -      | 870       | 762                     | 87.6       |

(注) 平均保有割合23.8%

\*平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

#### <フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド>

| 区 分  | 第 104 期 ～ |                         |            | 第 106 期    |                         |            |
|------|-----------|-------------------------|------------|------------|-------------------------|------------|
|      | 買付額等<br>A | うち利害<br>関係人との<br>取引状況 B | B<br>A     | 売付額等<br>C  | うち利害<br>関係人との<br>取引状況 D | D<br>C     |
| 投資証券 | 百万円<br>89 | 百万円<br>89               | %<br>100.0 | 百万円<br>461 | 百万円<br>461              | %<br>100.0 |
| 為替   | 103       | 88                      | 85.6       | 493        | 455                     | 92.2       |

(注) 平均保有割合15.8%

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

#### <フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド>

| 種 類           | 第 104 期 ～ 第 106 期 |            |               |
|---------------|-------------------|------------|---------------|
|               | 買 付 額             | 売 付 額      | 作成期末保有額       |
| そ の 他 有 価 証 券 | 百万円<br>-          | 百万円<br>773 | 百万円<br>18,158 |

#### <フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド>

| 種 類           | 第 104 期 ～ 第 106 期 |            |              |
|---------------|-------------------|------------|--------------|
|               | 買 付 額             | 売 付 額      | 作成期末保有額      |
| そ の 他 有 価 証 券 | 百万円<br>89         | 百万円<br>461 | 百万円<br>6,198 |

### (3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目                         | 第 104 期 ～ 第 106 期 |
|-----------------------------|-------------------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)       | 7千円               |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | —                 |
| (B) / (A)                   | —                 |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

\*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは、フィデリティ証券株式会社、FIL INVESTMENTS SERVICES UK LIMITED、FIL DISTRIBUTORS、FIL LUXEMBOURG SAです。

### ■組入資産の明細 (2023年11月10日現在)

#### ●親投資信託残高

| 種 類                      | 期首 (前作成期末)      | 当 作 成 期 末       |                 |
|--------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|                          | 口 数             | 口 数             | 評 価 額           |
| フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド    | 千口<br>2,357,868 | 千口<br>2,193,778 | 千円<br>4,575,564 |
| フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド    | 303,820         | 276,606         | 967,873         |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 453,351         | 437,196         | 940,627         |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

(2023年11月10日現在)

| 項 目                      | 当 作 成 期 末     |           |
|--------------------------|---------------|-----------|
|                          | 評 価 額         | 比 率       |
| フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド    | 千円<br>967,873 | %<br>14.8 |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 940,627       | 14.4      |
| フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド    | 4,575,564     | 70.1      |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他  | 46,574        | 0.7       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額          | 6,530,639     | 100.0     |

(注1) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、11月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=151.43円、1シンガポール・ドル=111.34円、1イギリス・ポンド=185.08円、1ユーロ=161.56円です。

(注2) フィデリティ・ワールド債券・マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建資産(18,166,342千円)の投資信託財産総額(19,379,307千円)に対する比率は、93.7%です。

(注3) フィデリティ・ワールド株式・マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建資産(6,189,231千円)の投資信託財産総額(6,224,840千円)に対する比率は、99.4%です。

(注4) フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建資産(4,887,911千円)の投資信託財産総額(5,053,837千円)に対する比率は、96.7%です。

(注5) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年7月10日現在

2023年9月11日現在

2023年11月10日現在

| 項 目                           | 第 104 期 末      | 第 105 期 末      | 第 106 期 末      |
|-------------------------------|----------------|----------------|----------------|
|                               | 円              | 円              | 円              |
| (A) 資 産                       | 6,564,727,426  | 6,678,631,958  | 6,530,639,233  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等               | 38,132,066     | 120,735,466    | 36,272,829     |
| フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド(評価額)    | 967,344,588    | 983,683,642    | 967,873,020    |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド(評価額) | 981,869,272    | 975,796,030    | 940,627,202    |
| フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド(評価額)    | 4,577,381,500  | 4,590,783,095  | 4,575,564,138  |
| 未 収 入 金                       | —              | 7,633,725      | 10,302,044     |
| (B) 負 債                       | 33,302,663     | 116,825,067    | 39,814,233     |
| 未 払 収 益 分 配 金                 | 18,845,977     | 93,411,386     | 18,275,543     |
| 未 払 解 約 金                     | 4,716,047      | 12,851,020     | 11,343,934     |
| 未 払 信 託 報 酬                   | 9,355,688      | 9,775,340      | 9,070,968      |
| そ の 他 未 払 費 用                 | 384,951        | 787,321        | 1,123,788      |
| (C) 純 資 産 総 額 (A－B)           | 6,531,424,763  | 6,561,806,891  | 6,490,825,000  |
| 元 本                           | 6,281,992,608  | 6,227,425,774  | 6,091,847,907  |
| 次 期 繰 越 損 益 金                 | 249,432,155    | 334,381,117    | 398,977,093    |
| (D) 受 益 権 総 口 数               | 6,281,992,608口 | 6,227,425,774口 | 6,091,847,907口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)       | 10,397円        | 10,537円        | 10,655円        |

(注1) 当作成期における作成期首元本額6,381,345,305円、作成期中追加設定元本額72,990,132円、作成期中一部解約元本額362,487,530円です。

(注2) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

## ■ 損益の状況

第104期 自2023年5月11日 至2023年7月10日  
 第105期 自2023年7月11日 至2023年9月11日  
 第106期 自2023年9月12日 至2023年11月10日

| 項 目            | 第 104 期        | 第 105 期        | 第 106 期        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
|                | 円              | 円              | 円              |
| (A) 有価証券売買損益   | 230,370,444    | 189,881,574    | 99,320,299     |
| 売 買 益          | 233,969,824    | 191,592,192    | 131,079,609    |
| 売 買 損          | △3,599,380     | △1,710,618     | △31,759,310    |
| (B) 信託報酬等      | △9,741,264     | △10,179,404    | △9,410,839     |
| (C) 当期損益金(A+B) | 220,629,180    | 179,702,170    | 89,909,460     |
| (D) 前期繰越損益金    | 296,325,395    | 491,549,517    | 563,339,250    |
| (E) 追加信託差損益金   | △248,676,443   | △243,459,184   | △235,996,074   |
| (配当等相当額)       | (32,445,936)   | (34,850,205)   | (36,389,829)   |
| (売買損益相当額)      | (△281,122,379) | (△278,309,389) | (△272,385,903) |
| (F) 合計(C+D+E)  | 268,278,132    | 427,792,503    | 417,252,636    |
| (G) 収益分配金      | △18,845,977    | △93,411,386    | △18,275,543    |
| 次期繰越損益金(F+G)   | 249,432,155    | 334,381,117    | 398,977,093    |
| 追加信託差損益金       | △248,676,443   | △243,459,184   | △235,996,074   |
| (配当等相当額)       | (32,466,263)   | (34,899,445)   | (36,409,946)   |
| (売買損益相当額)      | (△281,142,706) | (△278,358,629) | (△272,406,020) |
| 分配準備積立金        | 558,804,262    | 577,840,301    | 634,973,167    |
| 繰越損益金          | △60,695,664    | —              | —              |

(注1) (A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程は以下の通りです。

|                              | 第 104 期      | 第 105 期      | 第 106 期      |
|------------------------------|--------------|--------------|--------------|
| (a) 費用控除後の配当等収益              | 36,491,581円  | 35,303,263円  | 33,575,041円  |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 | 0円           | 84,519,988円  | 56,334,419円  |
| (c) 収益調整金                    | 32,466,263円  | 34,899,445円  | 36,409,946円  |
| (d) 分配準備積立金                  | 541,158,658円 | 551,428,436円 | 563,339,250円 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d)           | 610,116,502円 | 706,151,132円 | 689,658,656円 |
| 1万円当たり分配可能額                  | 971.21円      | 1,133.94円    | 1,132.10円    |
| (f) 分配金額                     | 18,845,977円  | 93,411,386円  | 18,275,543円  |
| 1万円当たり分配金(税引前)               | 30円          | 150円         | 30円          |

## ■分配金のお知らせ

| 決算期   | 年月日         | 1万口当たりの分配金(税込) |
|-------|-------------|----------------|
| 第104期 | 2023年7月10日  | 30円            |
| 第105期 | 2023年9月11日  | 150円           |
| 第106期 | 2023年11月10日 | 30円            |

(注1) 受益者が収益分配金を受け取る際、収益分配金落ち後の基準価額が個別元本と同額の場合または個別元本を上回っている場合には、収益分配金の全額が普通分配金となり、収益分配金落ち後の基準価額が個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となります。

(注2) 元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、収益分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

(注3) 個人の受益者が受け取る普通分配金に対する課税について、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%)の税率で源泉徴収(申告不要)されます。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人の受益者の場合は取扱いが異なります。

※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。

《フィデリティ・世界分散・ファンド（株式重視型）》

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用明細

| 項目          | 第104期～第106期            |         | 項目の概要   |
|-------------|------------------------|---------|---|
|             | 2023年5月11日～2023年11月10日 |         |   |
|             | 金額                     | 比率      |   |
| (a) 信託報酬    | 48円                    | 0.431%  | (a) 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>当作成期中の平均基準価額は11,069円です。                              |
| （投信会社）      | (10)                   | (0.094) | 委託した資金の運用の対価  |
| （販売会社）      | (34)                   | (0.304) | 購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの<br>管理及び事務手続き等の対価                                |
| （受託会社）      | (4)                    | (0.033) | 運用財産の保管・管理、投信会社からの指図の実行の対価  |
| (b) 売買委託手数料 | 0                      | 0.000   | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{当作成期中の売買委託手数料}}{\text{当作成期中の平均受益権口数}}$                    |
| （投資証券）      | (0)                    | (0.000) | 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料  |
| (c) 有価証券取引税 | 0                      | 0.001   | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{当作成期中の有価証券取引税}}{\text{当作成期中の平均受益権口数}}$                    |
| （投資証券）      | (0)                    | (0.001) | 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金   |
| (d) その他費用   | 2                      | 0.020   | (d) その他費用＝ $\frac{\text{当作成期中のその他費用}}{\text{当作成期中の平均受益権口数}}$                        |
| （保管費用）      | (0)                    | (0.001) | 保管費用は、有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等のために、海外<br>における保管銀行等に支払う費用。また、信託事務の諸費用等が含まれます。          |
| （監査費用）      | (0)                    | (0.004) | 監査費用は、ファンドの監査人等に対する報酬及び費用   |
| （その他）       | (2)                    | (0.015) | その他には、法定書類等（有価証券届出書、目論見書、運用報告書等）の作成、<br>印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含ま<br>れます。 |
| 合計          | 50                     | 0.452   |   |

(注1) 当作成期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 「金額」欄は、各項目毎に円未満を四捨五入しています。

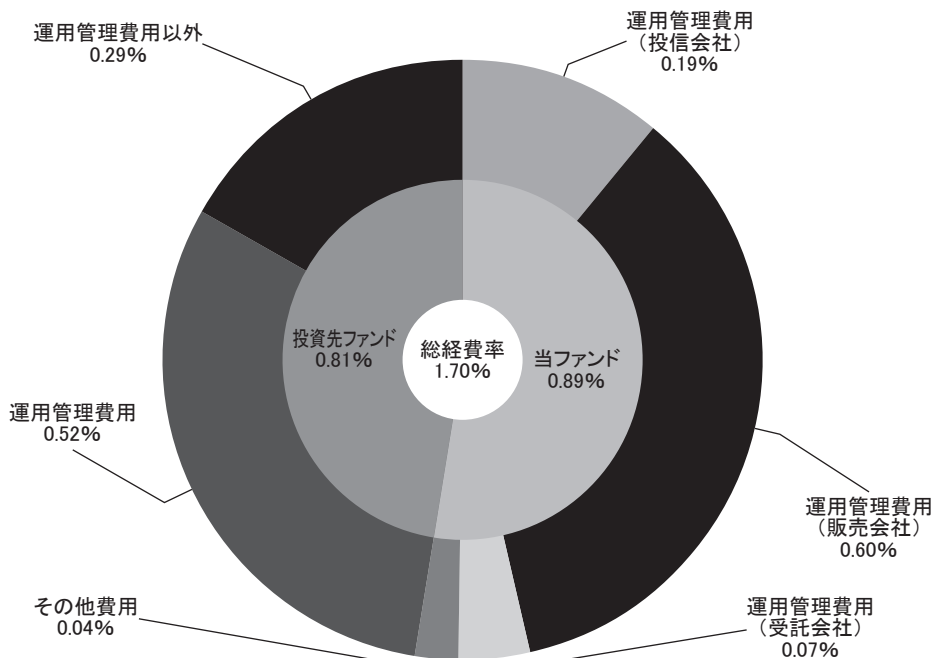
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## (参考情報)

### ●総経費率

当期中の運用・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く。)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)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.70%です。



|                      |       |
|----------------------|-------|
| 総経費率(①+②+③)          | 1.70% |
| ①当ファンドの費用の比率         | 0.89% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率   | 0.52% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.29% |

(注1)①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2)各費用は、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含みません。

(注3)その他費用には、保管費用、監査費用以外に法定書類等(有価証券届出書、目論見書、運用報告書等)の作成、印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含まれます。

(注4)各比率は、年率換算した値です。

(注5)投資先ファンドとは、当ファンドが実質的に組入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)です。

(注6)①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注7)①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注8)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2023年5月11日から2023年11月10日まで）

| 決 算 期                    | 第 104 期 ～ 第 106 期 |              |              |               |  |
|--------------------------|-------------------|--------------|--------------|---------------|--|
|                          | 設 定               |              | 解 約          |               |  |
|                          | 口 数               | 金 額          | 口 数          | 金 額           |  |
| フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド    | 千口<br>9,992       | 千円<br>20,428 | 千口<br>76,526 | 千円<br>154,016 |  |
| フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド    | 3,706             | 12,730       | 69,763       | 236,315       |  |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 4,442             | 9,908        | 7,153        | 16,070        |  |

(注) 金額の単位未満は切捨て。

## ■利害関係人との取引状況等（2023年5月11日から2023年11月10日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

#### 〈フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド〉

| 区 分      | 第 104 期 ～ 第 106 期 |                         |        | 第 106 期   |                         |            |
|----------|-------------------|-------------------------|--------|-----------|-------------------------|------------|
|          | 買付額等<br>A         | うち利害<br>関係人との<br>取引状況 B | B<br>A | 売付額等<br>C | うち利害<br>関係人との<br>取引状況 D | D<br>C     |
| 投資信託受益証券 | 百万円<br>—          | 百万円<br>—                | %<br>— | 百万円<br>71 | 百万円<br>71               | %<br>100.0 |
| 投資証券     | —                 | —                       | —      | 773       | 773                     | 100.0      |
| 為替       | 73                | —                       | —      | 870       | 762                     | 87.6       |

(注) 平均保有割合8.8%

\*平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

#### 〈フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド〉

| 区 分  | 第 104 期 ～ 第 106 期 |                         |            | 第 106 期    |                         |            |
|------|-------------------|-------------------------|------------|------------|-------------------------|------------|
|      | 買付額等<br>A         | うち利害<br>関係人との<br>取引状況 B | B<br>A     | 売付額等<br>C  | うち利害<br>関係人との<br>取引状況 D | D<br>C     |
| 投資証券 | 百万円<br>89         | 百万円<br>89               | %<br>100.0 | 百万円<br>461 | 百万円<br>461              | %<br>100.0 |
| 為替   | 103               | 88                      | 85.6       | 493        | 455                     | 92.2       |

(注) 平均保有割合39.5%

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

#### 〈フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド〉

| 種 類           | 第 104 期 ～ 第 106 期 |            |               |
|---------------|-------------------|------------|---------------|
|               | 買 付 額             | 売 付 額      | 作成期末保有額       |
| そ の 他 有 価 証 券 | 百万円<br>—          | 百万円<br>773 | 百万円<br>18,158 |

#### 〈フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド〉

| 種 類           | 第 104 期 ～ 第 106 期 |            |              |
|---------------|-------------------|------------|--------------|
|               | 買 付 額             | 売 付 額      | 作成期末保有額      |
| そ の 他 有 価 証 券 | 百万円<br>89         | 百万円<br>461 | 百万円<br>6,198 |

### (3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目                        | 第 104 期 ～ 第 106 期 |
|----------------------------|-------------------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額(A)       | 5千円               |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額(B) | —                 |
| (B)／(A)                    | —                 |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

\*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは、フィデリティ証券株式会社、FIL INVESTMENTS SERVICES UK LIMITED、FIL DISTRIBUTORS、FIL LUXEMBOURG SAです。

### ■組入資産の明細 (2023年11月10日現在)

#### ●親投資信託残高

| 種 類                      | 期首 (前作成期末)    | 当 作 成 期 末     |                 |
|--------------------------|---------------|---------------|-----------------|
|                          | 口 数           | 口 数           | 評 価 額           |
| フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド    | 千口<br>879,622 | 千口<br>813,087 | 千円<br>1,695,857 |
| フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド    | 761,406       | 695,349       | 2,433,098       |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 328,471       | 325,760       | 700,873         |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

(2023年11月10日現在)

| 項 目                      | 当 作 成 期 末       |           |
|--------------------------|-----------------|-----------|
|                          | 評 価 額           | 比 率       |
| フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド    | 千円<br>2,433,098 | %<br>50.0 |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 700,873         | 14.4      |
| フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド    | 1,695,857       | 34.9      |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他  | 33,041          | 0.7       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額          | 4,862,870       | 100.0     |

(注1) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、11月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=151.43円、1シンガポール・ドル=111.34円、1イギリス・ポンド=185.08円、1ユーロ=161.56円です。

(注2) フィデリティ・ワールド債券・マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建資産(18,166,342千円)の投資信託財産総額(19,379,307千円)に対する比率は、93.7%です。

(注3) フィデリティ・ワールド株式・マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建資産(6,189,231千円)の投資信託財産総額(6,224,840千円)に対する比率は、99.4%です。

(注4) フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建資産(4,887,911千円)の投資信託財産総額(5,053,837千円)に対する比率は、96.7%です。

(注5) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年7月10日現在

2023年9月11日現在

2023年11月10日現在

| 項 目                           | 第 104 期 末      | 第 105 期 末      | 第 106 期 末      |
|-------------------------------|----------------|----------------|----------------|
|                               | 円              | 円              | 円              |
| (A) 資 産                       | 4,880,331,798  | 4,979,103,488  | 4,862,870,569  |
| コール・ローン等                      | 27,859,177     | 179,964,226    | 33,041,394     |
| フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド(評価額)    | 2,443,324,573  | 2,395,164,844  | 2,433,098,457  |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド(評価額) | 711,403,375    | 713,068,570    | 700,873,117    |
| フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド(評価額)    | 1,697,744,673  | 1,671,523,838  | 1,695,857,601  |
| 未 収 入 金                       | —              | 19,382,010     | —              |
| (B) 負 債                       | 26,091,267     | 186,034,469    | 30,271,973     |
| 未 払 収 益 分 配 金                 | 15,400,065     | 151,976,747    | 15,148,449     |
| 未 払 解 約 金                     | 3,463,279      | 26,204,803     | 7,505,142      |
| 未 払 信 託 報 酬                   | 6,950,565      | 7,283,916      | 6,712,041      |
| そ の 他 未 払 費 用                 | 277,358        | 569,003        | 906,341        |
| (C) 純 資 産 総 額 (A－B)           | 4,854,240,531  | 4,793,069,019  | 4,832,598,596  |
| 元 本                           | 4,400,018,756  | 4,342,192,777  | 4,328,128,440  |
| 次 期 繰 越 損 益 金                 | 454,221,775    | 450,876,242    | 504,470,156    |
| (D) 受 益 権 総 口 数               | 4,400,018,756口 | 4,342,192,777口 | 4,328,128,440口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)       | 11,032円        | 11,038円        | 11,166円        |

(注1) 当作成期における作成期首元本額4,476,487,322円、作成期中追加設定元本額115,277,494円、作成期中一部解約元本額263,636,376円です。

(注2) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

## ■ 損益の状況

第104期 自2023年5月11日 至2023年7月10日  
 第105期 自2023年7月11日 至2023年9月11日  
 第106期 自2023年9月12日 至2023年11月10日

| 項 目            | 第 104 期        | 第 105 期        | 第 106 期        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
|                | 円              | 円              | 円              |
| (A) 有価証券売買損益   | 171,735,408    | 161,640,997    | 77,164,036     |
| 売 買 益          | 173,477,368    | 163,783,681    | 99,731,278     |
| 売 買 損          | △1,741,960     | △2,142,684     | △22,567,242    |
| (B) 信託報酬等      | △7,228,469     | △7,577,639     | △7,054,036     |
| (C) 当期損益金(A+B) | 164,506,939    | 154,063,358    | 70,110,000     |
| (D) 前期繰越損益金    | 641,114,808    | 776,158,673    | 764,478,721    |
| (E) 追加信託差損益金   | △335,999,907   | △327,369,042   | △314,970,116   |
| (配当等相当額)       | (76,843,882)   | (79,702,850)   | (90,884,890)   |
| (売買損益相当額)      | (△412,843,789) | (△407,071,892) | (△405,855,006) |
| (F) 合計(C+D+E)  | 469,621,840    | 602,852,989    | 519,618,605    |
| (G) 収益分配金      | △15,400,065    | △151,976,747   | △15,148,449    |
| 次期繰越損益金(F+G)   | 454,221,775    | 450,876,242    | 504,470,156    |
| 追加信託差損益金       | △335,999,907   | △327,369,042   | △314,970,116   |
| (配当等相当額)       | (76,879,910)   | (79,727,413)   | (90,944,482)   |
| (売買損益相当額)      | (△412,879,817) | (△407,096,455) | (△405,914,598) |
| 分配準備積立金        | 790,221,682    | 778,245,284    | 819,440,272    |

(注1) (A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程は以下の通りです。

|                              | 第 104 期      | 第 105 期        | 第 106 期      |
|------------------------------|--------------|----------------|--------------|
| (a) 費用控除後の配当等収益              | 28,066,356円  | 26,489,378円    | 25,567,773円  |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 | 79,849,596円  | 127,573,980円   | 44,542,227円  |
| (c) 収益調整金                    | 76,879,910円  | 79,727,413円    | 90,944,482円  |
| (d) 分配準備積立金                  | 697,705,795円 | 776,158,673円   | 764,478,721円 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d)           | 882,501,657円 | 1,009,949,444円 | 925,533,203円 |
| 1万円当たり分配可能額                  | 2,005.68円    | 2,325.90円      | 2,138.41円    |
| (f) 分配金額                     | 15,400,065円  | 151,976,747円   | 15,148,449円  |
| 1万円当たり分配金(税引前)               | 35円          | 350円           | 35円          |

## ■分配金のお知らせ

| 決算期   | 年月日         | 1万口当たりの分配金(税込) |
|-------|-------------|----------------|
| 第104期 | 2023年7月10日  | 35円            |
| 第105期 | 2023年9月11日  | 350円           |
| 第106期 | 2023年11月10日 | 35円            |

(注1) 受益者が収益分配金を受け取る際、収益分配金落ち後の基準価額が個別元本と同額の場合または個別元本を上回っている場合には、収益分配金の全額が普通分配金となり、収益分配金落ち後の基準価額が個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となります。

(注2) 元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、収益分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

(注3) 個人の受益者が受け取る普通分配金に対する課税について、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%)の税率で源泉徴収(申告不要)されます。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人の受益者の場合は取扱いが異なります。

※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。

# フィデリティ・ワールド債券・マザーファンド 運用報告書

## 《第36期》

決算日 2023年11月10日

(計算期間：2023年5月11日から2023年11月10日まで)

### ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | <ul style="list-style-type: none"> <li>●投資信託証券への投資を通じて、実質的に主として世界(日本を含みます。)の各種債券に投資を行い、配当等収入を確保するとともに、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目指します。</li> <li>●主として投資信託証券(国内投資信託証券、外国籍投資信託証券を含みます。)に投資を行います。</li> <li>●投資信託証券の投資に際しては、別に定める投資信託証券(「ファンド・ユニバース」)の中から、主として投資目的、利回り水準、リスク・リターン特性、通貨配分、セクター配分などを考慮して選定したファンドに投資します。</li> <li>●組入れた投資信託証券(「投資対象ファンド」)は定期的にモニターを行い、主としてファンド全体の利回り水準、リスク・リターン特性、通貨分散、セクター分散などを考慮して組入れ比率の調整を行います。また投資対象ファンドの入替えを行う可能性もあります。</li> <li>●ファンド・ユニバースは、投資信託証券(国内投資信託証券、外国籍投資信託証券を含みます。)の中から、当該投資信託証券の投資対象を勘案して適宜見直します。</li> <li>●組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</li> <li>●ファンドの基本資産配分に関する運用にあたっては、FILインベストメント・マネジメント(香港)・リミテッドに、運用の指図に関する権限を委託します。</li> <li>●ファンドの運用にあたっては、FILインベストメント・インターナショナルに、上記以外のファンドの運用の指図に関する権限を委託することがあります。</li> <li>●資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては上記のような運用ができない場合もあります。</li> </ul> |
| 主要運用対象 | <p>主として、世界(日本を含みます。)の各種債券(主として国債、政府機関債、投資適格債券、ハイ・イールド債、エマージング債等)を主要投資対象とする投資信託証券に投資を行います。</p>   |
| 組入制限   | <ul style="list-style-type: none"> <li>●投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>●投資信託証券および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外への直接投資は行いません。</li> <li>●外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>   |

## ■最近5期の運用実績

| 決算期               | 基準価額        |          | 投資<br>受組 | 信託<br>証入<br>比 | 証券<br>率   | 純資<br>産額      |
|-------------------|-------------|----------|----------|---------------|-----------|---------------|
|                   | 期騰<br>落     | 中率       |          |               |           |               |
| 32期 (2021年11月10日) | 円<br>19,552 | %<br>3.6 |          | %<br>4.9      | %<br>93.5 | 百万円<br>20,836 |
| 33期 (2022年5月10日)  | 18,826      | △3.7     |          | 5.2           | 93.1      | 19,752        |
| 34期 (2022年11月10日) | 18,962      | 0.7      |          | 5.5           | 93.0      | 19,341        |
| 35期 (2023年5月10日)  | 19,160      | 1.0      |          | 5.0           | 93.3      | 18,960        |
| 36期 (2023年11月10日) | 20,857      | 8.9      |          | 4.9           | 93.9      | 19,341        |

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークは設定しておりません。

## ■当期中の基準価額等の推移

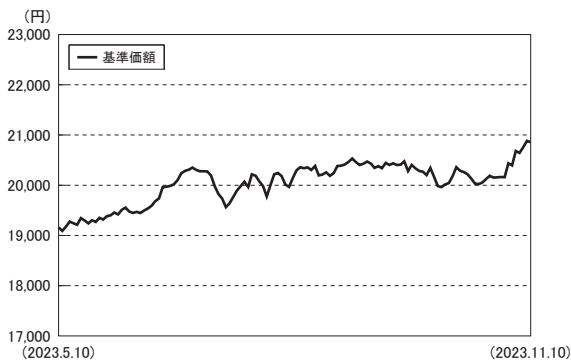
| 年月日                 | 基準価額        |        | 投資<br>組入<br>率 | 信託<br>証入<br>比 | 証券<br>率   |
|---------------------|-------------|--------|---------------|---------------|-----------|
|                     | 騰<br>落      | 率      |               |               |           |
| (期首)<br>2023年5月10日  | 円<br>19,160 | %<br>— |               | %<br>5.0      | %<br>93.3 |
| 5月末                 | 19,456      | 1.5    |               | 5.0           | 93.5      |
| 6月末                 | 20,305      | 6.0    |               | 5.1           | 93.3      |
| 7月末                 | 20,003      | 4.4    |               | 5.1           | 93.3      |
| 8月末                 | 20,533      | 7.2    |               | 5.0           | 93.8      |
| 9月末                 | 20,202      | 5.4    |               | 5.1           | 93.4      |
| 10月末                | 20,159      | 5.2    |               | 5.0           | 93.5      |
| (期末)<br>2023年11月10日 | 20,857      | 8.9    |               | 4.9           | 93.9      |

(注) 騰落率は期首比です。



## ■運用経過の説明

### ●基準価額の推移



### ●運用経過

当期の当ファンドの騰落率は、+8.9%でした。

当ファンドについては、従来通り、利回り水準、リスク・リターン特性、通貨分散、セクター分散などを考慮し、米国、欧州の投資適格債券を中心に、ハイ・イールド債券、エマージング債券にも分散投資を行いました。当期末時の各投資信託証券の組入れ比率は以下の通りでした。

| 組入れ投資信託証券  | 組入れ比率<br>(当期末現在) |
|--|------------------|
| フィデリティ・ファンズーユーロ・ボンド・ファンド                                 | 35.8%            |
| フィデリティ・ファンズーUSドル・ボンド・ファンド                                | 35.8%            |
| フィデリティ・ファンズーエマージング・マーケット・デット・ファンド                        | 9.3%             |
| フィデリティ・インベストメント・ファンズ・IXーフィデリティ・サステナブル・UK・アグリゲート・ボンド・ファンド | 8.0%             |
| フィデリティ・ファンズーヨーロッパ・ハイ・イールド・ファンド                           | 5.0%             |
| フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド (適格機関投資家専用)                        | 4.9%             |

※組入れ比率は、対純資産総額比率。

## ●投資環境

(以下、別途記載がない限り、現地通貨ベースでの相場の動きを記載しています。)

当期の世界の債券市場はハイ・イールド債券や新興国債券が国債を上回るパフォーマンスを見せるなどまちまちの展開となりました。期初は3月に発生した銀行セクターを巡る懸念から依然として不透明感が残る中、米地銀のファースト・リパブリック・バンク(FRC)が破綻・閉鎖に追い込まれましたが、大手銀行がFRCを買収したことが市場の安心感につながり、ボラティリティが大幅に低下しました。その後、期中盤にかけては堅調な企業業績や労働市場、経済の底堅さに加え、インフレ率の鈍化傾向が示されたことを背景に市場には楽観的な見方が広がりました。しかし、10月に入ると、中東情勢の緊迫化を受けて投資家心理は悪化しました。主要中央銀行の金融政策に目を向けると、米連邦準備制度理事会(FRB)は、5月と7月の米連邦公開市場委員会(FOMC)で0.25%幅の利上げを行った後、9月のFOMCに続いて11月も政策金利を据え置き、追加利上げを見送りましたが、高い金利水準が長期化するとの見方を示しました。欧州中央銀行(ECB)は5月、6月、7月、9月と利上げを実施しましたが、10月の会合では政策金利の据え置きを決定しました。一方、日銀はイールド・カーブ・コントロールの運用の柔軟化を進めました。こうした状況の下、先進国を中心に国債利回りが上昇し、数年来の高水準となりました。社債は、景気後退リスクが和らいだことなどから、多くの地域でクレジット・スプレッドが縮小しました。投資適格債券は国債利回りの上昇が逆風となり、下落する展開となった一方、ハイ・イールド債券はアジアを除くすべての地域でプラスのパフォーマンスとなりました。

## ■今後の運用方針

当ファンドは、今後も、各投資信託証券への投資を通じ、世界の債券市場へ分散投資を行います。各投資信託証券におきましては、トップダウン、ボトムアップ両面からの調査分析に基づき、発行体の信用力分析、定量面からの相対価値分析などを重視した運用を行ってまいります。

## ■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用明細

（2023年5月11日～2023年11月10日）

| 項目                  | 金額       |
|---------------------|----------|
| (a) 売買委託手数料         | －円       |
| (b) 有価証券取引税         | －        |
| (c) その他費用<br>（保管費用） | 0<br>(0) |
| 合計                  | 0        |

（注）費用明細の項目の概要および注記については、前述の「1万口（元本10,000円）当たりの費用明細」をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況（2023年5月11日から2023年11月10日まで）

### ● 投資信託受益証券、投資証券

|                                      | 買 付      |          | 売 付               |               |
|--------------------------------------|----------|----------|-------------------|---------------|
|                                      | 単位数又は口数  | 金 額      | 単位数又は口数           | 金 額           |
| 国内                                   | 千口       | 千円       | 千口                | 千円            |
| フィデリティ・USハイ・イールド・ファン<br>ド（適格機関投資家専用） | －<br>(－) | －<br>(－) | 84,830.124<br>(－) | 71,354<br>(－) |
| 外国                                   | 千口       | 千アメリカ・ドル | 千口                | 千アメリカ・ドル      |
| FF-US DOLLAR BOND FUND A-MDIST-USD   | －<br>(－) | －<br>(－) | 260.64707<br>(－)  | 2,897<br>(－)  |
|                                      | 千口       | 千ユーロ     | 千口                | 千ユーロ          |
| FF-EURO BOND FUND A-MDIST-EURO       | －<br>(－) | －<br>(－) | 163.67993<br>(－)  | 1,626<br>(－)  |
| FF-EURO HIGH YIELD A-MDIST-EURO      | －<br>(－) | －<br>(－) | 57.67915<br>(－)   | 563<br>(－)    |

（注1）金額は受渡し代金。

（注2）買付（ ）内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

（注3）売付（ ）内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

（注4）金額の単位未満は切捨て。

## ■ 利害関係人との取引状況等（2023年5月11日から2023年11月10日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

| 区 分      | 当 期       |                         |               | 期         |                         |               |
|----------|-----------|-------------------------|---------------|-----------|-------------------------|---------------|
|          | 買付額等<br>A | うち利害<br>関係人との<br>取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害<br>関係人との<br>取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託受益証券 | 百万円       | 百万円                     | %             | 百万円       | 百万円                     | %             |
| 投 資 証 券  | －         | －                       | －             | 71        | 71                      | 100.0         |
| 為 替      | －         | －                       | －             | 773       | 773                     | 100.0         |
|          | 73        | －                       | －             | 870       | 762                     | 87.6          |

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類           | 当 期      |            | 期             |
|---------------|----------|------------|---------------|
|               | 買 付 額    | 売 付 額      | 期 末 保 有 額     |
| そ の 他 有 価 証 券 | 百万円<br>－ | 百万円<br>773 | 百万円<br>18,158 |

### (3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目                        | 当 期 |
|----------------------------|-----|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額(A)       | －千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額(B) | －   |
| (B)／(A)                    | －   |

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは、フィデリティ証券株式会社、FIL INVESTMENTS SERVICES UK LIMITED、FIL DISTRIBUTORS、FIL LUXEMBOURG SAです。

### ■組入資産の明細（2023年11月10日現在）

#### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| ファンド名                            | 当 期 末            |          |      |
|----------------------------------|------------------|----------|------|
|                                  | 単位数又は口数          | 評 価 額    | 比 率  |
|                                  | 千口               | 千円       | %    |
| フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド（適格機関投資家専用） | 1, 107, 988. 397 | 953, 313 | 4. 9 |
| 合 計                              | 1, 107, 988. 397 | 953, 313 | 4. 9 |

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

#### (2) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| ファンド名  | 当 期 末          |           |              |       |
|--|----------------|-----------|--------------|-------|
|  | 単位数又は口数        | 評 価 額     |              | 比 率   |
|  |                | 外貨建金額     | 邦貨換算金額       |       |
|  | 千口             | 千アメリカ・ドル  | 千円           | %     |
| FF-US DOLLAR BOND FUND A-MDIST-USD                             | 4, 224. 96393  | 45, 714   | 6, 922, 487  | 35. 8 |
| FF-EMERGING MKT DEBT FD (class6) A-MIDST-USD                   | 1, 579. 84985  | 11, 853   | 1, 794, 992  | 9. 3  |
|  | 千口             | 千イギリス・ポンド | 千円           |       |
| FID INVE FUNDS IX - FID SUSTAINABLE UK AGGREGATE BOND FD I-ACC | 4, 383. 35354  | 8, 323    | 1, 540, 603  | 8. 0  |
|  | 千口             | 千ユーロ      | 千円           |       |
| FF-EURO BOND FUND A-MDIST-EURO                                 | 4, 349. 9303   | 42, 890   | 6, 929, 358  | 35. 8 |
| FF-EURO HIGH YIELD A-MDIST-EURO                                | 614. 02852     | 6, 011    | 971, 191     | 5. 0  |
| 合 計  | 15, 152. 12614 | －         | 18, 158, 634 | 93. 9 |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 比率欄は、純資産総額に対する評価額(邦貨換算金額)の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

(2023年11月10日現在)

| 項 目                     | 当 期 末         |          |
|-------------------------|---------------|----------|
|                         | 評 価 額         | 比 率      |
| 投 資 信 託 受 益 証 券         | 千円<br>953,313 | %<br>4.9 |
| 投 資 証 券                 | 18,158,634    | 93.7     |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 267,359       | 1.4      |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 19,379,307    | 100.0    |

(注1) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、11月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=151.43円、1イギリス・ポンド=185.08円、1ユーロ=161.56円です。

(注2) 当期末における外貨建資産(18,166,342千円)の投資信託財産総額(19,379,307千円)に対する比率は、93.7%です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年11月10日現在)

| 項 目                       | 当 期 末            |
|---------------------------|------------------|
| (A) 資 産                   | 19,379,307,228 円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等           | 259,672,877      |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 (評 価 額)   | 953,313,216      |
| 投 資 証 券 (評 価 額)           | 18,158,634,972   |
| そ の 他 未 収 取 益             | 7,686,163        |
| (B) 負 債                   | 37,693,715       |
| 未 払 解 約 金                 | 37,660,013       |
| そ の 他 未 払 費 用             | 33,702           |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B)     | 19,341,613,513   |
| 元 本                       | 9,273,445,402    |
| 次 期 繰 越 損 益 金             | 10,068,168,111   |
| (D) 受 益 権 総 口 数           | 9,273,445,402口   |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D) | 20,857円          |

(注1) 当ファンドの期首元本額、期中追加設定元本額、期中一部解約元本額は以下の通りです。

期首元本額 9,895,762,841円

期中追加設定元本額 21,856,624円

期中一部解約元本額 644,174,063円

(注2) 当ファンドの当期末元本の内訳は以下の通りです。

フィデリティ・世界3資産・ファンド(毎月決算型) 6,266,578,767円

フィデリティ・世界分散・ファンド(債券重視型) 2,193,778,654円

フィデリティ・世界分散・ファンド(株式重視型) 813,087,981円

(注3) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

## ■損益の状況

当 期 自2023年5月11日 至2023年11月10日

| 項 目                       | 当 期            |
|---------------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益             | 327,727,837 円  |
| 受 取 配 当 金                 | 292,064,884    |
| 受 取 利 息                   | 14,452         |
| そ の 他 収 益 金               | 35,648,501     |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | 1,307,922,988  |
| 売 買 損 益                   | 1,910,405,318  |
| 売 買 損                     | △602,482,330   |
| (C) 信 託 報 酬 等             | △176,061       |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 1,635,474,764  |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | 9,064,719,239  |
| (F) 解 約 差 損 益 金           | △654,832,260   |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金       | 22,806,368     |
| (H) 合 計 (D + E + F + G)   | 10,068,168,111 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H)         | 10,068,168,111 |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注4) (G)追加信託差損益金とあるのは、追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

ご参考として以下に、フィデリティ・ワールド債券・マザーファンドが組入れている各投資信託証券の直前の作成期における運用内容を掲載いたします。

<補足情報>

## フィデリティ・ファンズーヨーロピアン・ハイ・イールド・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|         |   |
|---------|---|
| 設 定 形 態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／ユーロ建て  |
| 投 資 目 的 | 主として、本店所在地が西ヨーロッパ、中央ヨーロッパ、東ヨーロッパ(ロシアを含む)にあるか、活動の大半がそれらの地域で営まれている発行体の高利回り事業債(ハイ・イールド債券)に投資を行い、高水準のインカムの確保と値上り益の追求を目指します。 |
| 決 算 日   | 4月30日   |

## 運用および純資産変動計算書

2023年4月30日に終了した年度

| 通貨                       | EUR                  |
|--------------------------|----------------------|
| <b>投資収益</b>              |                      |
| 受取配当金および受取利息             | 121,396,577          |
| スワップ取引に係る受取利息            | 9,765,188            |
| デリバティブ収益                 | —                    |
| <b>純利益</b>               | <b>131,161,765</b>   |
| <b>費用</b>                |                      |
| 運用報酬                     | 17,653,263           |
| 管理費                      | 4,315,543            |
| 国税                       | 757,878              |
| 保管費用                     | 244,138              |
| 販売手数料                    | 506,125              |
| 成功報酬                     | —                    |
| その他費用                    | 373,745              |
| <b>費用合計</b>              | <b>23,850,692</b>    |
| スワップ取引に係る支払利息            | 11,840,154           |
| デリバティブ費用                 | 219,763              |
| 差金決済取引に係る財務費用            | —                    |
| 還付ブローカー費用                | —                    |
| 管理費用の払戻                  | —                    |
| 払戻費用                     | —                    |
| 費用還付                     | —                    |
| <b>総費用</b>               | <b>35,910,609</b>    |
| <b>純投資収益(損失)</b>         | <b>95,251,156</b>    |
| 有価証券に係る実現純(損)益           | (113,594,642)        |
| 外貨取引に係る実現純(損)益           | (1,819,571)          |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益         | —                    |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益       | (27,319,858)         |
| オプション取引に係る実現純(損)益        | —                    |
| 先物取引に係る実現純(損)益           | 5,134,959            |
| スワップ取引に係る実現純(損)益         | (5,874,420)          |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額     | (54,326,215)         |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額     | (827,177)            |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額   | —                    |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 34,850,709           |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額  | —                    |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額     | (1,145,018)          |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額   | (2,809,520)          |
| <b>運用実績</b>              | <b>(72,479,597)</b>  |
| <b>受益者への分配金</b>          | <b>(37,429,062)</b>  |
| <b>設定解約</b>              |                      |
| 当期設定額                    | 585,403,572          |
| 当期解約額                    | (751,891,659)        |
| 調整勘定                     | 296,882              |
| 設定解約に伴う増加(減少)額           | (166,191,205)        |
| <b>純増加(減少)</b>           | <b>(276,099,864)</b> |
| <b>純資産額</b>              |                      |
| 期首                       | 2,448,364,753        |
| 期末                       | 2,172,264,889        |

投資資産明細表 2023年4月30日現在

|  | 国コード | 株数または額面 |                    | 時価 EUR        | % Net Assets |
|--|------|---------|--------------------|---------------|--------------|
|  |      | 通貨      | 価額                 |               |              |
| 公認の証券取引所で取引される証券                                 |      |         |                    |               |              |
| エネルギー  |      |         |                    |               |              |
| Harbour Energy 5.50% 15/10/2026 144A             | GB   | USD     | 22,096,181         | 18,359,745    | 0.85         |
| Koamos Energy 7.50% 01/03/2026 Reg S             | US   | USD     | 14,858,080         | 11,314,764    | 0.52         |
| EnQuest 11.625% 01/11/2027 Reg S                 | GB   | USD     | 12,918,848         | 11,079,111    | 0.51         |
| Tullow Oil 10.25% 15/05/2026 144A                | GB   | USD     | 12,186,698         | 8,631,527     | 0.40         |
| Wintershall Deo Fin. 2 BV 3.00% VRN (Perpetual)  | NL   | EUR     | 7,637,556          | 5,837,369     | 0.27         |
| Tullow Oil 10.25% 15/05/2026 Reg S               | GB   | USD     | 4,036,237          | 2,840,180     | 0.13         |
| CGG 7.75% 01/04/2027 Reg S                       | FR   | EUR     | 2,976,005          | 2,611,486     | 0.12         |
| BP Capital Markets 4.375% VRN (Perpetual)        | GB   | USD     | 2,282,482          | 1,988,954     | 0.09         |
| Nostrum Oil & Gas                                | NL   | GBP     | 2,527,908          | 289,505       | 0.01         |
|  |      |         | <b>62,972,641</b>  | <b>2,900</b>  |              |
| 公益事業   |      |         |                    |               |              |
| EDF 3.375% VRN (Perpetual)                       | FR   | EUR     | 40,031,223         | 29,880,105    | 1.38         |
| EDF 6.00% VRN (Perpetual) EMTN                   | FR   | GBP     | 15,450,647         | 15,736,850    | 0.72         |
| EDF 5.50% VRN (Perpetual) EMTN                   | FR   | EUR     | 15,275,072         | 14,942,238    | 0.69         |
| Teollisuuden Voima 1.125% 09/03/2026 EMTN        | FI   | EUR     | 9,600,470          | 8,865,679     | 0.41         |
| ContourGlobal Power 3.125% 01/01/2028 Reg S      | LU   | EUR     | 8,503,123          | 6,851,647     | 0.32         |
| Terna 2.375% VRN (Perpetual)                     | IT   | EUR     | 1,382,657          | 1,158,390     | 0.05         |
|  |      |         | <b>77,452,909</b>  | <b>3,571</b>  |              |
| 素材   |      |         |                    |               |              |
| INEOS Finance 6.625% 15/05/2028 Reg S            | GB   | EUR     | 11,304,431         | 11,248,101    | 0.52         |
| Huhtamaki 4.25% 09/04/2027                       | FI   | EUR     | 5,793,995          | 5,676,085     | 0.26         |
| INEOS Finance 2.875% 01/05/2026 Reg S            | GB   | EUR     | 3,709,033          | 3,438,660     | 0.16         |
| INEOS Quattro Finance 2.250% 15/01/2026 Reg S    | GB   | EUR     | 3,691,476          | 3,335,713     | 0.15         |
| Solvay Finance 5.869% VRN (Perpetual)            | FR   | EUR     | 3,072,572          | 3,066,679     | 0.14         |
| INEOS Quattro 3.375% 15/01/2026 Reg S            | GB   | USD     | 2,282,482          | 1,900,103     | 0.09         |
|  |      |         | <b>28,665,341</b>  | <b>1,322</b>  |              |
| 資本財・サービス   |      |         |                    |               |              |
| Healthstar Holding 7.125% 14/02/2024 EMTN        | GB   | GBP     | 11,902,266         | 13,687,689    | 0.63         |
| Paperc Holdings 5.50% 01/07/2028 Reg S           | FR   | EUR     | 13,670,511         | 12,234,792    | 0.56         |
| INF Continental Airlines 1.125% 18/05/2028       | ES   | EUR     | 11,324,622         | 9,193,328     | 0.42         |
| Loxam SAS 6.375% 15/05/2028 EMTN                 | FR   | EUR     | 8,778,777          | 8,756,610     | 0.40         |
| Intrum 5.50% 15/07/2026 Reg S                    | SE   | EUR     | 10,454,454         | 8,603,103     | 0.40         |
| Tk Elevator Holdco 6.625% 15/07/2028 Reg S       | DE   | EUR     | 10,053,894         | 8,433,961     | 0.39         |
| Rolls-Royce 4.625% 16/02/2026 Reg S              | GB   | EUR     | 5,998,948          | 5,311,215     | 0.24         |
| Healthstar Finance 5.75% 03/05/2025              | GB   | GBP     | 4,016,290          | 4,503,278     | 0.21         |
| Arena Luxembourg Finance 1.875% 01/01/2028 Reg S | LU   | EUR     | 1,580,180          | 1,255,737     | 0.06         |
| Healthstar Finance 4.75% 01/01/2024              | GB   | GBP     | 789,212            | 885,595       | 0.04         |
| Travis Perkins 3.75% 17/02/2026                  | GB   | GBP     | 592,547            | 612,782       | 0.03         |
|  |      |         | <b>73,478,090</b>  | <b>3,308</b>  |              |
| 情報技術   |      |         |                    |               |              |
| Orano 3.375% 23/04/2026 EMTN                     | FR   | EUR     | 26,599,694         | 25,959,572    | 1.20         |
| Orano 2.75% 08/03/2028 EMTN                      | FR   | EUR     | 15,362,860         | 14,281,107    | 0.66         |
| IHS Netherlands 10.00% 18/09/2027 Reg S          | NL   | USD     | 10,205,328         | 8,163,800     | 0.38         |
| osm CSRAM 2.125% 03/11/2027                      | AT   | EUR     | 5,091,691          | 5,462,350     | 0.16         |
|  |      |         | <b>51,866,829</b>  | <b>2,339</b>  |              |
| 一般消費財・サービス                                       |      |         |                    |               |              |
| Alice (France) Holding 8.00% 15/05/2027 Reg S    | LU   | EUR     | 41,172,464         | 29,612,142    | 1.36         |
| LHMC Finco 7.25% 02/10/2025 Reg S                | LU   | EUR     | 28,475,991         | 26,785,941    | 1.23         |
| Virgin Mid Securities 4.125% 15/08/2030 Reg S    | GB   | GBP     | 27,210,697         | 24,305,791    | 1.12         |
| GEMS Education Delaware 7.125% 31/07/2026 Reg S  | SU   | USD     | 25,217,037         | 22,269,665    | 1.03         |
| Versaire Holdings 3.875% 15/07/2025 Reg S        | SE   | EUR     | 20,012,100         | 18,496,443    | 0.85         |
| 888 Acquisitions 7.58% 15/07/2027 Reg S          | GI   | EUR     | 14,270,780         | 12,947,165    | 0.60         |
| Alwyn Entertainment Fin. 7.25% 30/04/2030 Reg S  | GB   | EUR     | 12,583,499         | 12,727,265    | 0.59         |
| Albion Financing 8.75% 15/04/2027 144A           | LU   | USD     | 13,451,529         | 10,628,630    | 0.49         |
| Alice Finance 5.75% 15/08/2029 144A              | LU   | USD     | 15,219,082         | 9,557,308     | 0.44         |
| Albion Finance 5.25% 15/10/2026 Reg S            | LU   | EUR     | 9,924,163          | 9,189,344     | 0.42         |
| Ford Motor 9.625% 22/04/2030                     | US   | USD     | 8,668,164          | 9,140,430     | 0.42         |
| Versaire Holding 3.25% 15/02/2027 Reg S          | SE   | EUR     | 9,557,454          | 8,423,510     | 0.39         |
| JLR Automotive 5.875% 15/01/2028 144A            | GB   | USD     | 10,501,173         | 8,242,022     | 0.38         |
| VZ Secured Financing 3.50% 15/01/2032 Reg S      | NL   | EUR     | 9,745,320          | 7,636,940     | 0.35         |
| Summer BC 5.75% 31/10/2026 Reg S                 | LU   | EUR     | 8,561,785          | 7,300,884     | 0.34         |
| United Group 5.25% 01/02/2030 Reg S              | NL   | EUR     | 9,704,938          | 7,297,764     | 0.34         |
| Latomatica 9.75% 30/09/2027 Reg S                | IT   | EUR     | 5,338,374          | 5,741,235     | 0.26         |
| CT Investment 5.50% 15/10/2026 Reg S             | DE   | EUR     | 5,083,790          | 4,518,726     | 0.21         |
| ZF Finance 3.00% 21/09/2025 EMTN                 | DE   | EUR     | 4,477,176          | 4,258,932     | 0.20         |
| ZF Finance 5.75% 03/08/2026 EMTN                 | DE   | EUR     | 3,862,662          | 3,896,128     | 0.18         |
| United Group 4.00% 15/11/2027 Reg S              | NL   | EUR     | 3,774,874          | 2,981,007     | 0.14         |
| United Group 3.125% 15/02/2026 Reg S             | NL   | EUR     | 2,255,512          | 1,969,017     | 0.09         |
|  |      |         | <b>247,926,289</b> | <b>11,411</b> |              |
| 生活必需品  |      |         |                    |               |              |
| Bellis Acquisition 3.25% 16/02/2026 Reg S        | GB   | GBP     | 24,066,139         | 22,587,323    | 1.04         |
| Sigma Holdco 5.75% 15/03/2026 Reg S              | NL   | EUR     | 8,299,456          | 6,628,360     | 0.31         |
| Bellis Acquisition 4.50% 16/02/2026 Reg S        | GB   | GBP     | 5,544,675          | 5,330,334     | 0.25         |
| Iceland Bondco 4.625% 15/03/2025 Reg S           | GB   | GBP     | 3,085,740          | 3,188,218     | 0.15         |
| Casino Guichard 4.048% 05/08/2026 EMTN           | FR   | EUR     | 8,339,858          | 1,656,242     | 0.08         |
|  |      |         | <b>39,390,477</b>  | <b>1,881</b>  |              |
| ヘルスケア  |      |         |                    |               |              |
| Organon Finance 2.875% 30/04/2028 Reg S          | US   | EUR     | 34,858,767         | 30,265,288    | 1.39         |

|   | 国コード | 株数または額面 |                    | 時価 EUR             | % Net Assets |
|---|------|---------|--------------------|--------------------|--------------|
|   |      | 通貨      | 価額                 |                    |              |
| Nidda Healthcare Holding 7.50% 21/08/2026 Reg S   | DE   | EUR     | 27,848,036         | 27,142,228         | 1.25         |
| Bayer 5.375% VRN 25/03/2082                       | DE   | EUR     | 15,538,435         | 14,288,834         | 0.66         |
| Bayer 3.125% VRN 12/11/2079                       | DE   | EUR     | 3,774,874          | 3,265,964          | 0.15         |
| Bayer 3.75% VRN 01/07/2074                        | DE   | EUR     | 3,292,041          | 3,201,830          | 0.15         |
|   |      |         | <b>78,162,144</b>  | <b>3,600</b>       |              |
| 金融  |      |         |                    |                    |              |
| Nemane Bondco 13.25% 15/12/2026 Reg S             | GB   | GBP     | 21,249,907         | 24,112,842         | 1.11         |
| Co-Operative Bank Finn. 6.00% VRN 06/04/2027      | GB   | GBP     | 16,083,597         | 17,186,136         | 0.79         |
| Gartnukelux Holdco 3.775% 01/11/2025 Reg S        | LU   | GBP     | 15,583,207         | 13,467,762         | 0.62         |
| Commerzbank 6.125% VRN (Perpetual)                | DE   | EUR     | 14,397,194         | 12,602,224         | 0.58         |
| Barclays Banco 3.75% VRN 15/06/2025               | ES   | EUR     | 12,378,075         | 12,177,229         | 0.56         |
| Co-Operative Bank Finn. 9.00% VRN 27/11/2025      | GB   | GBP     | 10,341,399         | 11,903,511         | 0.55         |
| Banco BPM 7.00% VRN (Perpetual)                   | IT   | EUR     | 12,965,376         | 11,400,001         | 0.52         |
| Societe Generale 9.375% VRN (Perpetual) 144A      | FR   | USD     | 12,340,327         | 10,640,178         | 0.49         |
| Ford Motor Credit 7.35% 04/11/2027                | US   | USD     | 11,163,971         | 10,384,100         | 0.48         |
| Piraeus Financial 5.50% VRN 19/02/2030 EMTN       | GR   | EUR     | 11,939,137         | 10,120,340         | 0.47         |
| Alpha services & Holdings 11.875% VRN (Perpetual) | GR   | EUR     | 10,975,227         | 9,922,812          | 0.46         |
| Gartnukelux Holdco 3.675% 01/11/2025 Reg S        | LU   | EUR     | 12,014,634         | 9,199,785          | 0.42         |
| Intesa Sanpaola 5.375% VRN (Perpetual) EMTN       | IT   | EUR     | 10,701,339         | 9,352,762          | 0.38         |
| International Personal Finance 9.75% 12/11/2025   | GB   | EUR     | 9,222,105          | 8,536,763          | 0.38         |
| Societe Generale 7.875% VRN (Perpetual) EMTN      | FR   | EUR     | 6,232,932          | 5,650,558          | 0.26         |
| Intesa Sanpaola 6.375% VRN (Perpetual)            | IT   | EUR     | 6,204,839          | 5,321,171          | 0.24         |
| Barclays 9.25% VRN (Perpetual)                    | GB   | GBP     | 4,449,962          | 4,586,331          | 0.21         |
| Agpa Bondco 6.00% 05/08/2025                      | GB   | EUR     | 10,095,593         | 4,283,056          | 0.20         |
| Piraeus Financial Hlgs 8.75% VRN (Perpetual)      | GR   | EUR     | 5,308,526          | 4,028,057          | 0.19         |
| Deutsche Bank 4.296% VRN 24/05/2028               | DE   | USD     | 3,840,715          | 3,465,352          | 0.16         |
| Nexi 1.75% 24/04/2027                             | IT   | EUR     | 3,687,086          | 3,188,115          | 0.15         |
| Barclays 8.00% VRN (Perpetual)                    | GB   | USD     | 3,928,503          | 3,225,722          | 0.15         |
| Eurobank Ergasias                                 | GR   | EUR     | 2,132,956          | 2,730,183          | 0.13         |
| OTP Bank 7.35% VRN 04/03/2026 EMTN                | HU   | EUR     | 1,918,163          | 1,932,503          | 0.09         |
| Alpha B 4.25% VRN 13/02/2030 EMTN                 | GR   | EUR     | 2,079,692          | 1,681,747          | 0.08         |
| Aliva 6.875% VRN (Perpetual)                      | GB   | GBP     | 1,638,998          | 1,640,293          | 0.08         |
|   |      |         | <b>211,487,353</b> | <b>9,733</b>       |              |
| 不動産   |      |         |                    |                    |              |
| Fastighets AB Balder 3.50% 23/02/2028             | SE   | EUR     | 10,007,806         | 9,071,777          | 0.42         |
| Alder Financing 12.50% VRN 30/06/2025             | LU   | EUR     | 2,872,416          | 2,902,705          | 0.13         |
| Aroundtown 3.375% VRN (Perpetual)                 | LU   | EUR     | 5,267,266          | 2,360,789          | 0.11         |
| ADLER Group                                       | LU   | EUR     | 74,134             | 40,922             | 0.00         |
|   |      |         | <b>14,376,193</b>  | <b>0.66</b>        |              |
| オープンエンド型ファンド                                      |      |         |                    |                    |              |
| Fidelity IIF - The Euro Fund - A-ACCUR            | IE   | EUR     | 14,829             | 204,179,021        | 9.40         |
|   |      |         |                    | <b>204,179,021</b> | <b>9.40</b>  |
| コミュニケーション・サービス                                    |      |         |                    |                    |              |
| Vodafone Group 6.25% VRN 03/10/2078               | GB   | USD     | 25,897,392         | 22,966,342         | 1.06         |
| Alice (France) 5.875% 01/02/2027 Reg S            | FR   | EUR     | 25,519,904         | 22,202,317         | 1.02         |
| Lorca Telecom 4.00% 18/09/2027 Reg S              | ES   | EUR     | 18,596,961         | 17,136,059         | 0.79         |
| Alice (France) 5.50% 15/10/2029 144A              | FR   | USD     | 21,676,556         | 14,718,356         | 0.68         |
| Celtnet Telecom 0.75% 20/11/2031                  | ES   | EUR     | 14,484,982         | 11,725,166         | 0.54         |
| Telecom Italia 6.875% 15/02/2028                  | IT   | EUR     | 11,337,790         | 11,416,021         | 0.53         |
| Iliad 5.025% 15/02/2030                           | FR   | EUR     | 10,797,896         | 10,360,235         | 0.48         |
| Pinewood Finance 3.25% 30/09/2025 Reg S           | GB   | GBP     | 8,910,459          | 9,545,593          | 0.44         |
| Iliad Holding 5.625% 15/10/2028 Reg S             | FR   | EUR     | 6,829,011          | 6,256,637          | 0.29         |
| Telecom Italia 5.875% 19/05/2023 EMTN             | IT   | GBP     | 3,862,662          | 4,401,707          | 0.20         |
| Iliad Holding 5.125% 15/10/2026 Reg S             | FR   | EUR     | 2,197,328          | 2,094,328          | 0.10         |
| Telefonica Europe 3.00% VRN (Perpetual)           | NL   | EUR     | 526,727            | 520,801            | 0.02         |
|   |      |         | <b>133,343,598</b> | <b>6.14</b>        |              |
| その他の市場で取引される証券                                    |      |         |                    |                    |              |
| Vallourec 8.50% 30/06/2026                        | FR   | EUR     | 13,885,510         | 13,879,747         | 0.64         |
| Vallourec 8.50% 30/06/2026 Reg S                  | FR   | EUR     | 13,212,059         | 13,206,576         | 0.61         |
| TechnipFMC 6.50% 01/02/2026 144A                  | GB   | USD     | 14,060,089         | 12,801,507         | 0.59         |
| DTEK Energy 7.00% 31/12/2027                      | NL   | USD     | 31,229,268         | 12,022,137         | 0.55         |
| Petrofac 9.75% 15/11/2026 144A                    | GB   | USD     | 15,420,116         | 8,516,706          | 0.39         |
| Petrofac 9.75% 15/11/2026 Reg S                   | GB   | USD     | 5,640,354          | 3,579,501          | 0.16         |
|   |      |         | <b>64,006,174</b>  | <b>2.95</b>        |              |
| 公益事業  |      |         |                    |                    |              |
| Public Power 4.375% 30/03/2026                    | GR   | EUR     | 15,274,194         | 14,576,774         | 0.67         |
| Energopro 8.50% 04/02/2027 Reg S                  | CZ   | USD     | 8,316,135          | 7,231,422          | 0.33         |
| Energopro AS 4.50% 04/05/2024                     | DE   | EUR     | 4,938,062          | 4,794,957          | 0.22         |
| Enel 5.375% VRN (Perpetual) EMTN                  | IT   | EUR     | 3,750,293          | 3,788,046          | 0.17         |
| Enel 6.625% VRN (Perpetual) EMTN                  | IT   | EUR     | 2,493,173          | 2,508,705          | 0.12         |
| SCC Power 8.00% 31/12/2028 Reg S                  | GB   | USD     | 7,019,359          | 2,209,445          | 0.10         |
| SCC Power 4.00% 17/05/2032 Reg S                  | GB   |         |                    |                    |              |



|   | 国コード | 通貨  | 株数または額面    |    | 時価 EUR            | % Net Assets |
|---|------|-----|------------|----|-------------------|--------------|
|   |      |     | 額面         | 価値 |                   |              |
| Trivium Packaging Finance 8.50% 15/08/2027 144A | NL   | USD | 2,041,066  |    | 1,786,154         | 0.08         |
|   |      |     |            |    | <b>51,141,696</b> | <b>2.35</b>  |
| <b>資本財・サービス</b>                                 |      |     |            |    |                   |              |
| AA Bond 6.50% 31/01/2026 Reg S                  | GB   | GBP | 20,415,924 |    | 19,824,568        | 0.91         |
| Neptune Brics US 9.29% 15/04/2029 144A          | US   | USD | 18,448,400 |    | 15,755,254        | 0.85         |
| Seche Environment 2.25% 15/11/2028              | FR   | EUR | 15,807,066 |    | 13,764,556        | 0.63         |
| Autostrade per l'Italia 1.625% 12/06/2023 MTN   | IT   | EUR | 7,310,965  |    | 7,297,798         | 0.34         |
| Benteler International 9.375% 15/05/2028 Reg S  | AT   | EUR | 6,870,271  |    | 6,967,897         | 0.32         |
| Aberatis Fin. Fr. B 3.248% VRN (Perpetual)      | FR   | EUR | 7,465,960  |    | 6,623,049         | 0.30         |
| Autostrade per l'Italia 2.20% 15/01/2030        | NL   | EUR | 6,597,251  |    | 5,529,163         | 0.25         |
| Autostrade per l'Italia 1.75% 24/06/2026 EMTN   | IT   | EUR | 5,341,008  |    | 4,965,874         | 0.23         |
| Aberatis Fin. France 2.625% VRN (Perpetual)     | NL   | EUR | 3,335,935  |    | 2,741,645         | 0.13         |
| Infli Consolidation Airlines 3.75% 25/03/2029   | ES   | EUR | 526,727    |    | 457,674           | 0.02         |
|   |      |     |            |    | <b>83,905,288</b> | <b>3.86</b>  |

|                                      | 国コード | 通貨  | 株数または額面   |    | 時価 EUR           | % Net Assets |
|--------------------------------------|------|-----|-----------|----|------------------|--------------|
|                                      |      |     | 額面        | 価値 |                  |              |
| Cellex Finance 1.00% 15/09/2027 EMTN | ES   | EUR | 2,282,482 |    | 1,995,172        | 0.09         |
|                                      |      |     |           |    | <b>1,995,172</b> | <b>0.09</b>  |

|  | 国コード | 通貨  | 株数または額面    |    | 時価 EUR             | % Net Assets |
|--|------|-----|------------|----|--------------------|--------------|
|  |      |     | 額面         | 価値 |                    |              |
| <b>一般消費財・サービス</b>                              |      |     |            |    |                    |              |
| Punch Finance 6.125% 30/06/2026 Reg S          | GB   | GBP | 22,543,899 |    | 22,170,151         | 1.02         |
| Faurecia 7.25% 15/06/2026                      | FR   | EUR | 20,857,496 |    | 21,621,506         | 1.00         |
| Faurecia 2.75% 15/02/2027                      | FR   | EUR | 19,268,537 |    | 17,158,922         | 0.79         |
| JLR Automotive 1.75% 15/10/2026 144A           | GB   | USD | 15,254,003 |    | 13,732,264         | 0.63         |
| Eggo Bond 3.375% 28/02/2030 Reg S              | NL   | EUR | 16,867,542 |    | 12,950,224         | 0.60         |
| Peugeot 8.75% 15/09/2026 Reg S                 | GB   | USD | 15,257,561 |    | 12,870,794         | 0.59         |
| UPC Broadband Fincov BV 4.875% 15/07/2031 144A | NL   | USD | 13,374,467 |    | 10,466,610         | 0.48         |
| CPUK Finance 4.875% 28/08/2025 Reg S           | GB   | GBP | 5,381,390  |    | 5,821,784          | 0.27         |
| Venisure Holding 7.125% 01/02/2028 Reg S       | SE   | EUR | 5,736,053  |    | 5,736,569          | 0.26         |
| Summer BC Brics US 5.00% 31/10/2026 Reg S      | US   | USD | 7,359,057  |    | 5,584,951          | 0.26         |
| Venisure Holding 9.25% 15/10/2027 Reg S        | SE   | EUR | 4,521,792  |    | 4,634,210          | 0.21         |
| ZF North America 8.875% 14/04/2028 144A        | US   | USD | 4,871,343  |    | 4,541,235          | 0.21         |
| Cirsa Finance Inf 6.25% 20/12/2023 Reg S       | LU   | EUR | 3,695,821  |    | 3,700,588          | 0.17         |
| Cirsa Finance 10.375% 30/11/2027 Reg S         | LU   | EUR | 3,278,873  |    | 3,308,302          | 0.16         |
| Jaguar Land Rover 4.50% 01/10/2027 Reg S       | GB   | USD | 1,420,406  |    | 1,078,748          | 0.05         |
| Edmondstone Park CLO 4.727% FRN 21/07/2035     | IE   | EUR | 202,320    |    | 202,829            | 0.01         |
| Cairo Mezz                                     | CY   | EUR | 177,747    |    | 23,107             | 0.00         |
|  |      |     |            |    | <b>145,802,794</b> | <b>6.71</b>  |

|                                   | 国コード | 通貨  | 株数または額面   |    | 時価 EUR           | % Net Assets |
|-----------------------------------|------|-----|-----------|----|------------------|--------------|
|                                   |      |     | 額面        | 価値 |                  |              |
| <b>生活必需品</b>                      |      |     |           |    |                  |              |
| Casino Guichard 6.625% 15/01/2026 | FR   | EUR | 4,104,078 |    | 1,055,774        | 0.05         |
|                                   |      |     |           |    | <b>1,055,774</b> | <b>0.05</b>  |

|   | 国コード | 通貨  | 株数または額面    |    | 時価 EUR     | % Net Assets |
|---|------|-----|------------|----|------------|--------------|
|   |      |     | 額面         | 価値 |            |              |
| <b>金庫</b>   |      |     |            |    |            |              |
| UniCredit 8.00% VRN (Perpetual)                   | IT   | USD | 29,562,531 |    | 25,988,196 | 1.20         |
| Jerrolid Finance 4.875% 01/02/2026 Reg S          | GB   | GBP | 15,137,405 |    | 13,545,087 | 0.61         |
| Banca Monta 7.677% VRN 18/01/2028 EMTN            | IT   | EUR | 13,517,405 |    | 11,535,087 | 0.52         |
| BCC 5.25% VRN 27/11/2031 EMTN                     | ES   | EUR | 10,406,043 |    | 11,136,138 | 0.51         |
| Jerrolid Finance 5.25% 15/01/2027 Reg S           | GB   | GBP | 11,091,107 |    | 10,840,581 | 0.50         |
| Banco de Sabadell SA 5.75% VRN (Perpetual)        | ES   | EUR | 12,992,590 |    | 10,457,034 | 0.48         |
| Banca Com Portogues 4.00% VRN 17/05/2032 DMTN     | PT   | EUR | 10,406,043 |    | 10,255,611 | 0.47         |
| Intesa Sanpaolo 6.184% VRN 20/02/2034 EMTN        | IT   | EUR | 9,870,857  |    | 9,804,285  | 0.45         |
| Banco de Sabadell 9.375% VRN (Perpetual)          | ES   | EUR | 10,534,532 |    | 9,795,092  | 0.45         |
| Intesa 4.95% VRN 01/06/2024                       | IT   | USD | 16,131,003 |    | 9,683,678  | 0.45         |
| Host Finance 3.375% 27/11/2024 EMTN               | SE   | EUR | 10,129,851 |    | 9,492,381  | 0.44         |
| Deutsche Bank 10.00% VRN (Perpetual)              | DE   | EUR | 9,481,079  |    | 8,909,958  | 0.41         |
| Lloyds Banking Group 8.50% VRN (Perpetual)        | GB   | GBP | 7,705,132  |    | 8,322,707  | 0.38         |
| Vivion Investments 3.00% 08/08/2024               | LU   | EUR | 10,797,896 |    | 7,908,886  | 0.36         |
| Yapi ve Kredi Bankasi 8.25% 15/10/2024 Reg S      | TR   | USD | 8,385,732  |    | 7,614,654  | 0.35         |
| TBC Bank 10.775% VRN (Perpetual) Reg S            | GE   | USD | 7,944,793  |    | 6,857,421  | 0.32         |
| doValue 3.375% 31/07/2026 Reg S                   | IT   | EUR | 7,519,900  |    | 6,774,859  | 0.31         |
| Intesa Sanpaolo 8.248% VRN 21/11/2033 Reg S       | IT   | EUR | 6,322,475  |    | 6,145,466  | 0.28         |
| Banco de Credito 6.00% VRN 22/09/2026             | ES   | USD | 5,793,995  |    | 5,871,887  | 0.27         |
| TBC Bank 8.94% VRN (Perpetual) Reg S              | GE   | USD | 7,023,022  |    | 5,711,612  | 0.26         |
| Deutsche Bank 7.50% VRN (Perpetual)               | DE   | USD | 7,374,173  |    | 5,505,782  | 0.25         |
| Permanent TSB Group Hlds 6.625% VRN 25/04/2028    | IE   | EUR | 5,195,280  |    | 5,269,783  | 0.24         |
| Castor 6.00% 15/02/2029 Reg S                     | IT   | EUR | 5,403,357  |    | 4,735,850  | 0.22         |
| Banco de Sabadell 6.00% VRN 16/04/2033 EMTN       | ES   | EUR | 5,179,478  |    | 4,692,470  | 0.22         |
| Alpha Bank 7.50% VRN 16/06/2027 EMTN              | GR   | EUR | 4,520,192  |    | 4,499,612  | 0.21         |
| Banca Monte 8.00% VRN 22/01/2030                  | IT   | EUR | 4,906,458  |    | 4,431,906  | 0.20         |
| AIB Group 5.25% VRN (Perpetual)                   | IE   | EUR | 4,215,813  |    | 3,864,568  | 0.18         |
| AIB Group 6.25% VRN (Perpetual)                   | IE   | EUR | 4,215,813  |    | 3,622,024  | 0.17         |
| Turkiye Hicrati 9.375% 31/01/2026 Reg S           | TR   | USD | 3,774,874  |    | 3,415,817  | 0.16         |
| Global Aircraft Leasing 6.50% VRN 15/09/2024 144A | KY   | USD | 4,259,956  |    | 3,413,146  | 0.16         |
| UniCredit 5.45% VRN 30/06/2035 144A               | IT   | USD | 4,082,131  |    | 3,149,545  | 0.14         |
| Lloyds Banking Group 7.50% VRN (Perpetual)        | GB   | EUR | 3,160,360  |    | 2,756,984  | 0.13         |
| Tinkoff Credit Fin. (Perpetual) Reg S             | IE   | USD | 5,991,515  |    | 2,537,234  | 0.11         |
| TBC Bank 5.75% 19/06/2024 Reg S                   | GE   | USD | 1,970,835  |    | 1,760,185  | 0.08         |
| Banco Commercial 1.75% VRN 07/04/2028 EMTN        | PT   | EUR | 1,229,029  |    | 1,004,378  | 0.05         |
| CIC Conatus Loan 0.520% FRN 20/05/2036            | IE   | EUR | 637,300    |    | 622,292    | 0.03         |
| Trinito Euro CLO IV 7.381% FRN 15/05/2036         | IE   | EUR | 536,147    |    | 436,732    | 0.02         |
| Bumper 5.578% FRN 20/03/2032                      | LU   | EUR | 526,031    |    | 526,582    | 0.02         |
| Banc Cap Euro CLO 2022 2.729% FRN 22/07/2036      | IE   | EUR | 505,799    |    | 500,550    | 0.02         |
| Avco CLO XXVIII 6.344% FRN 15/04/2037             | IE   | EUR | 485,367    |    | 485,742    | 0.02         |
| Tiehuu CLO IX 7.61% FRN 20/04/2036                | IE   | EUR | 465,335    |    | 467,499    | 0.02         |
| Henley CLO VI 6.411% FRN10/06/2034                | IE   | EUR | 505,799    |    | 461,116    | 0.02         |
| MFC Funding 7.897% FRN 15/10/2036                 | IE   | EUR | 460,277    |    | 460,787    | 0.02         |
| Julilee CLO 2013X 3.55% FRN 15/07/2034            | IE   | EUR | 505,799    |    | 459,848    | 0.02         |
| NDFI 2021 7.038% FRN 15/03/2029                   | GB   | GBP | 407,064    |    | 457,560    | 0.02         |
| Providus CLO IV 6.45% FRN 04/07/2034              | IE   | EUR | 505,799    |    | 457,586    | 0.02         |
| PSIET 2023 1.0575% FRN 15/11/2032                 | IE   | EUR | 429,229    |    | 427,219    | 0.02         |
| Providus CLO II 6.627% FRN 15/07/2031             | IE   | EUR | 455,219    |    | 424,900    | 0.02         |
| Income Cont Student Lns 4.7102% FRN 24/07/2058    | GB   | GBP | 355,459    |    | 405,246    | 0.02         |

|  | 国コード | 通貨  | 株数または額面 |    | 時価 EUR  | % Net Assets |
|--|------|-----|---------|----|---------|--------------|
|  |      |     | 額面      | 価値 |         |              |
| Aqueduct Euro CLO 2017 5.95% FRN 20/07/2030      | IE   | EUR | 422,747 |    | 397,101 | 0.02         |
| Tiehuu CLO 3.41% FRN 04/08/2034                  | IE   | EUR | 404,639 |    | 393,618 | 0.02         |
| Dryden 103 Euro Clo 2021 0.634% FRN 19/01/2036   | IE   | EUR | 391,394 |    | 389,063 | 0.02         |
| Income Cont. Student Lns 4.7103% FRN 24/07/2056  | GB   | GBP | 340,038 |    | 387,781 | 0.02         |
| CIFC Euro Funding CLO IV 6.275% FRN 18/08/2035   | IE   | EUR | 424,871 |    | 384,255 | 0.02         |
| Sound Front Euro CLO II 5.505% FRN 26/07/2036    | IE   | EUR | 404,639 |    | 373,332 | 0.02         |
| Dryden 103 Euro Clo 2021 0.389% FRN 19/01/2036   | IE   | EUR | 345,943 |    | 344,801 | 0.02         |
| ALME 20-X55.927% FRN 15/04/2032                  | IE   | EUR | 354,059 |    | 325,392 | 0.01         |
| Together Asset Backed 5.654% FRN 15/12/2061      | GB   | GBP | 282,146 |    | 322,219 | 0.01         |
| Bushy Park CLO 7.942% FRN 15/04/2036             | IE   | EUR | 316,654 |    | 318,040 | 0.01         |
| Trinito Euro CLO III 8.001% FRN 25/01/2037       | IE   | EUR | 303,480 |    | 304,480 | 0.01         |
| Adagio 9.211% FRN 20/07/2036                     | IE   | EUR | 305,480 |    | 301,696 | 0.01         |
| Last Mile Logistics 4.582% FRN 17/08/2035        | IE   | EUR | 327,771 |    | 300,513 | 0.01         |
| ICG Euro CLO 2025 1.947481% FRN 19/04/2036       | IE   | EUR | 305,480 |    | 300,417 | 0.01         |
| Barrings Euro CLO 2025 1.945% FRN 20/01/2037     | IE   | EUR | 285,248 |    | 285,598 | 0.01         |
| Harvest CLO XXIII 6.20% FRN 20/10/2032           | IE   | EUR | 316,650 |    | 282,006 | 0.01         |
| Contego CLO 8.308% FRN 15/11/2036                | IE   | EUR | 273,132 |    | 271,189 | 0.01         |
| Highways 2021 0.240% FRN 18/12/2031              | GB   | GBP | 252,900 |    | 268,328 | 0.01         |
| Bridgpoint CLO IV 9.421% FRN 20/01/2037          | IE   | EUR | 263,014 |    | 259,742 | 0.01         |
| Aurium CLO III 6.277% FRN 16/04/2030             | IE   | EUR | 273,132 |    | 257,724 | 0.01         |
| DPF 18-1 0.63% FRN 28/04/2051                    | NL   | EUR | 254,302 |    | 254,412 | 0.01         |
| Tiehuu CLO VIII 7.315% FRN 25/10/2034            | IE   | EUR | 252,900 |    | 253,883 | 0.01         |
| Arbour CLO XI 8.821% FRN 15/01/2036              | IE   | EUR | 252,900 |    | 253,678 | 0.01         |
| Barrings Euro CLO 2023 1.040% FRN 30/04/2036     | IE   | EUR | 252,900 |    | 252,900 | 0.01         |
| CIFC Euro Funding CLO V 6.327% FRN 23/11/2034    | IE   | EUR | 268,074 |    | 239,642 | 0.01         |
| CIFC Euro Funding CLO I 6.377% FRN 15/07/2032    | IE   | EUR | 252,900 |    | 231,809 | 0.01         |
| PCL Funding V 4.9358% FRN 15/10/2025             | GB   | GBP | 202,320 |    | 230,751 | 0.01         |
| Barrings Euro CLO 2025 1.025% FRN 02/02/2031     | IE   | EUR | 235,578 |    | 230,049 | 0.01         |
| OHECP VII 6.675% FRN 18/04/2035                  | IE   | EUR | 249,258 |    | 227,500 | 0.01         |
| CGMSE CLO 22.5 0.630% FRN 25/10/2035             | IE   | EUR | 125,562 |    | 220,158 | 0.01         |
| Mortimer BTL 2022 1.1 6.579% FRN 23/03/2035      | GB   | GBP | 192,204 |    | 212,811 | 0.01         |
| FORIA 2023 1.742% FRN 15/10/2037                 | IE   | EUR | 202,320 |    | 203,320 | 0.01         |
| FORIA 2023 1.3748% FRN 18/09/2037                | IE   | EUR | 202,320 |    | 202,591 | 0.01         |
| CGMSE CLO 2021 2.330% FRN 15/10/2035             | IE   | EUR | 227,610 |    | 202,347 | 0.01         |
| Bain Cap. Euro CLO 2022 2.0485% FRN 22/07/2036   | IE   | EUR | 202,320 |    | 201,575 | 0.01         |
| Julilee CLO 2022-XXVI 0.667% FRN 15/10/2036      | IE   | EUR | 202,320 |    | 198,292 | 0.01         |
| Carat 2019 1.035% FRN 18/08/2029                 | IE   | EUR | 193,981 |    | 193,981 | 0.01         |
| Madison Pk Euro Funding XX 9.267% FRN 15/10/2036 | IE   | EUR | 192,204 |    | 189,635 | 0.01         |
| Julilee CLO 2019-XXII 0.40                       |      |     |         |    |         |              |



|   | 契約額等 EUR   | Unrealised gain/(loss) EUR | % Net Assets       |               |
|---|------------|----------------------------|--------------------|---------------|
| Bought EUR Sold CZK at 0.042545 09/05/2023          | 117,976    | 84                         | 0.00               |               |
| Bought CZK Sold EUR at 23.474988 09/05/2023         | 3,770      | (7)                        | (0.00)             |               |
| Bought CZK Sold EUR at 23.418573 09/05/2023         | 1,858      | (8)                        | (0.00)             |               |
| Bought CZK Sold EUR at 23.575310 07/06/2023         | 117,704    | (107)                      | (0.00)             |               |
|   |            | <b>414</b>                 | <b>0.00</b>        |               |
| <b>Y-ACC Shares (SEK) (hedged)</b>                  |            |                            |                    |               |
| Bought SEK Sold EUR at 11.574254 07/06/2023         | 46,139     | 250                        | 0.00               |               |
| Bought SEK Sold EUR at 11.531272 09/05/2023         | 19,971     | 36                         | 0.00               |               |
| Bought EUR Sold SEK at 0.088371 09/05/2023          | 306,454    | (135)                      | (0.00)             |               |
| Bought EUR Sold SEK at 0.087932 09/05/2023          | 46,389     | (251)                      | (0.00)             |               |
| Bought SEK Sold EUR at 11.263515 09/05/2023         | 334,244    | (1,409)                    | (0.00)             |               |
|   |            | <b>(1,509)</b>             | <b>(0.00)</b>      |               |
| <b>Y-ACC Shares (USD) (hedged)</b>                  |            |                            |                    |               |
| Bought EUR Sold USD at 0.909907 09/05/2023          | 45,067,063 | 224,394                    | 0.01               |               |
| Bought USD Sold EUR at 1.104072 09/05/2023          | 739,354    | (277)                      | (0.00)             |               |
| Bought USD Sold EUR at 1.100805 07/06/2023          | 45,870,704 | (233,201)                  | (0.01)             |               |
| Bought USD Sold EUR at 1.090678 09/05/2023          | 44,889,142 | (561,156)                  | (0.03)             |               |
|   |            | <b>(570,240)</b>           | <b>(0.03)</b>      |               |
| <b>Y-MDIST Shares (USD) (hedged)</b>                |            |                            |                    |               |
| Bought EUR Sold USD at 0.909907 09/05/2023          | 1,059,498  | 5,275                      | 0.00               |               |
| Bought USD Sold EUR at 1.100805 07/06/2023          | 1,071,579  | (5,448)                    | (0.00)             |               |
| Bought USD Sold EUR at 1.090678 09/05/2023          | 1,072,911  | (13,412)                   | (0.00)             |               |
|   |            | <b>(13,585)</b>            | <b>(0.00)</b>      |               |
| <b>Y-MINCOME (G) Shares (USD) (hedged)</b>          |            |                            |                    |               |
| Bought EUR Sold USD at 0.909907 09/05/2023          | 41,015     | 204                        | 0.00               |               |
| Bought USD Sold EUR at 1.100805 07/06/2023          | 41,515     | (211)                      | (0.00)             |               |
| Bought USD Sold EUR at 1.090678 09/05/2023          | 41,534     | (519)                      | (0.00)             |               |
|   |            | <b>(526)</b>               | <b>(0.00)</b>      |               |
|   | 契約額等       | Unrealised gain/(loss) EUR | % Net Assets       |               |
| Ccy   |            |                            |                    |               |
| <b>先物取引</b>   |            |                            |                    |               |
| US 5 Year Bond Future 30/06/2023                    | USD        | 59,668,554                 | 1,292,104          | 0.06          |
| Euro-Bobl Bond Future 08/06/2023                    | EUR        | 23,405,290                 | 539,649            | 0.02          |
| US 10 Year Ultra Bond Future 21/06/2023             | USD        | 12,912,758                 | 458,178            | 0.02          |
| US Long Bond Future 21/06/2023                      | USD        | 6,565,848                  | 281,025            | 0.01          |
| US Ultra Bond Future 21/06/2023                     | USD        | 2,983,248                  | 139,256            | 0.01          |
| Long Gilt Bond Future 08/06/2023                    | GBP        | (6,234,863)                | (55,496)           | (0.00)        |
| US 10 Year Note Bond Future 21/06/2023              | USD        | (14,678,389)               | (437,387)          | (0.02)        |
| Euro-Bond Future 08/06/2023                         | EUR        | (72,831,121)               | (2,460,656)        | (0.11)        |
|   |            |                            | <b>(243,325)</b>   | <b>(0.01)</b> |
|   | 契約額等       | Unrealised gain/(loss) EUR | % Net Assets       |               |
| Ccy   |            |                            |                    |               |
| <b>翌日物金利スワップ</b>                                    |            |                            |                    |               |
| Receive fixed 1.93% pay float. (1d SOFR) 21/05/2027 | USD        | 146,605,574                | (7,208,227)        | (0.33)        |
|   |            |                            | <b>(7,208,227)</b> | <b>(0.33)</b> |
| その他資産 (負債控除後)                                       |            | 149,850,897                | 6.90               |               |
| <b>Net Assets</b>                                   |            | <b>2,172,264,889</b>       | <b>100.00</b>      |               |

<補足情報>

## フィデリティ・ファンズーUSドル・ボンド・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|      |                       |
|------|-----------------------|
| 設定形態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／米ドル建て  |
| 投資目的 | 主として米ドル建ての債券に投資を行います。 |
| 決算日  | 4月30日                 |

## 運用および純資産変動計算書

2023年4月30日に終了した年度

| 通貨                       | USD           |
|--------------------------|---------------|
| <b>投資収益</b>              |               |
| 受取配当金および受取利息             | 84,165,011    |
| スワップ取引に係る受取利息            | 650,889       |
| デリバティブ収益                 | 149,933       |
| 純利益                      | 84,965,833    |
| <b>費用</b>                |               |
| 運用報酬                     | 12,431,094    |
| 管理費                      | 3,784,950     |
| 国税                       | 970,532       |
| 保管費用                     | 120,368       |
| 販売手数料                    | 4,332         |
| 成功報酬                     | —             |
| その他費用                    | 425,122       |
| 費用合計                     | 17,736,398    |
| スワップ取引に係る支払利息            | 1,768,837     |
| デリバティブ費用                 | —             |
| 差金決済取引に係る財務費用            | —             |
| 還付ブローカー費用                | —             |
| 管理費用の払戻                  | —             |
| 払戻費用                     | —             |
| 費用還付                     | —             |
| 総費用                      | 19,505,235    |
| <b>純投資収益(損失)</b>         | 65,460,598    |
| 有価証券に係る実現純(損)益           | (187,549,121) |
| 外貨取引に係る実現純(損)益           | 5,073,692     |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益         | —             |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益       | 9,759,695     |
| オプション取引に係る実現純(損)益        | —             |
| 先物取引に係る実現純(損)益           | 9,737,623     |
| スワップ取引に係る実現純(損)益         | (638,347)     |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額     | 111,316,419   |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額     | 263,204       |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額   | —             |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (4,767,417)   |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額  | —             |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額     | 3,941,672     |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額   | 593,303       |
| <b>運用実績</b>              | 13,191,321    |
| <b>受益者への分配金</b>          | (7,983,124)   |
| 設定解約                     |               |
| 当期設定額                    | 1,573,610,105 |
| 当期解約額                    | (943,467,147) |
| 調整勘定                     | 3,358,694     |
| 設定解約に伴う増加(減少)額           | 633,501,652   |
| 純増加(減少)                  | 638,709,849   |
| <b>純資産額</b>              |               |
| 期首                       | 2,107,454,574 |
| 期末                       | 2,746,164,423 |

投資資産明細表 2023年 4 月 30日現在

| 国コード  | 株数または額面<br>通貨 | 価値<br>価値 | 時価 (米ドル<br>)      | % Net<br>Assets |
|---|---------------|----------|-------------------|-----------------|
| <b>公認の証券取引所で取引される証券</b>                           |               |          |                   |                 |
| <b>エネルギー</b>                                      |               |          |                   |                 |
| DCP Midstream Operating 5.125% 15/05/2029         | US            | USD      | 10,155,604        | 10,074,061 0.37 |
| ONEOK 6.10% 15/11/2032                            | US            | USD      | 7,621,466         | 7,966,069 0.29  |
| DCP Midstream Operating 8.125% 16/08/2030         | US            | USD      | 6,560,876         | 7,216,083 0.26  |
| Energy Transfer 6.25% 15/04/2049                  | US            | USD      | 6,516,354         | 6,470,023 0.24  |
| Enbridge 5.70% 08/03/2033                         | CA            | USD      | 5,335,026         | 5,540,903 0.20  |
| Equinor 3.70% 06/04/2050                          | NO            | USD      | 5,716,100         | 4,832,255 0.18  |
| Energy Transfer 6.00% 15/06/2048                  | US            | USD      | 4,687,202         | 4,498,610 0.16  |
| Energy Transfer 4.95% 15/05/2028                  | US            | USD      | 3,810,733         | 3,774,371 0.14  |
| Energy Transfer 5.55% 15/02/2028                  | US            | USD      | 3,070,689         | 3,137,289 0.11  |
|   |               |          | <b>53,499,644</b> | <b>1.95</b>     |
| <b>公益事業</b>                                       |               |          |                   |                 |
| PacificCorp 5.35% 01/21/2053                      | US            | USD      | 11,432,199        | 11,927,984 0.43 |
| Abu Dhabi National Energy 4.696% 24/04/2035 Reg S | AE            | EUR      | 5,177,262         | 5,282,050 0.19  |
| EDF 4.625% 25/01/2045 EMTN                        | FR            | EUR      | 4,877,738         | 5,102,703 0.19  |
| EDF 4.25% 25/01/2032 EMTN                         | FR            | EUR      | 4,649,094         | 5,087,793 0.19  |
| Nextera Energy Capital 2.25% 01/06/2030           | US            | USD      | 5,207,748         | 4,416,508 0.16  |
| Nextera Energy 1.875% 15/01/2027                  | US            | USD      | 3,537,885         | 3,213,209 0.12  |
| PG&E 4.70% 01/04/2053                             | US            | USD      | 5,048,587         | 3,115,641 0.11  |
| Terra 2.375% VRN (Perpetual)                      | IT            | EUR      | 3,141,568         | 2,905,755 0.11  |
| Nextera Energy 2.44% 15/01/2032                   | US            | USD      | 1,905,367         | 1,582,807 0.06  |
|   |               |          | <b>42,632,430</b> | <b>1.55</b>     |
| <b>素材</b>   |               |          |                   |                 |
| Ashland 8.875% 15/05/2043                         | US            | USD      | 8,856,906         | 8,901,503 0.32  |
| Nutrien 5.90% 07/11/2024                          | CA            | USD      | 5,335,026         | 5,403,623 0.20  |
|   |               |          | <b>14,305,126</b> | <b>0.52</b>     |
| <b>資本財・サービス</b>                                   |               |          |                   |                 |
| Air Lease 5.85% 15/02/2027                        | US            | USD      | 7,585,359         | 7,670,260 0.28  |
| Ashland Capital 5.55% 30/05/2033 144A             | US            | USD      | 7,049,094         | 7,002,061 0.25  |
| Air Lease 1.875% 15/08/2026                       | US            | USD      | 7,501,047         | 6,668,509 0.24  |
| Honeywell International 4.125% 02/11/2054         | US            | EUR      | 4,156,170         | 4,674,709 0.17  |
| Air Lease Capital 5.50% 11/08/2032 144A           | US            | USD      | 3,972,308         | 3,928,390 0.14  |
| Air Lease 3.125% 01/12/2030                       | US            | USD      | 4,344,236         | 3,703,518 0.13  |
| Republic Services 5.00% 01/04/2034                | US            | USD      | 2,271,959         | 2,321,637 0.08  |
|   |               |          | <b>35,968,684</b> | <b>1.31</b>     |
| <b>情報技術</b>                                       |               |          |                   |                 |
| Oracle 4.90% 06/02/2033                           | US            | USD      | 4,524,102         | 4,456,296 0.16  |
| HP 4.20% 15/04/2032                               | US            | USD      | 4,424,261         | 3,966,276 0.14  |
| Oracle 5.55% 06/02/2053                           | US            | USD      | 4,059,955         | 3,919,656 0.14  |
| Oracle 3.65% 25/05/2041                           | US            | USD      | 3,181,962         | 2,471,715 0.09  |
| Tencent Holdings 3.925% 19/01/2038 Reg S          | KY            | USD      | 1,524,293         | 1,300,470 0.05  |
|   |               |          | <b>16,114,393</b> | <b>0.59</b>     |
| <b>一般消費財・サービス</b>                                 |               |          |                   |                 |
| Lowes Cos 5.80% 15/09/2042                        | US            | USD      | 11,432,199        | 11,523,652 0.42 |
| Virgin Med Securities 4.125% 15/08/2030 Reg S     | GB            | GBP      | 8,421,720         | 8,305,007 0.30  |
| Toil Brothers Finance 3.80% 01/11/2029            | US            | USD      | 7,206,096         | 6,568,911 0.24  |
| Volkswagen Int'l Finance 4.375% VRN (Perpetual)   | NL            | EUR      | 6,630,676         | 6,057,293 0.22  |
| Lowes Cos 5.85% 01/04/2043                        | US            | USD      | 5,819,035         | 5,846,251 0.21  |
| WVF 3.748% VRN (Perpetual)                        | NL            | EUR      | 3,124,801         | 2,999,153 0.11  |
| General Motor Financial 5.85% 06/04/2030          | US            | USD      | 2,816,894         | 2,815,503 0.10  |
| Marriott International 4.90% 15/04/2029           | US            | USD      | 1,524,293         | 1,515,727 0.06  |
|   |               |          | <b>45,631,497</b> | <b>1.59</b>     |
| <b>生活必需品</b>                                      |               |          |                   |                 |
| Walmart 4.10% 15/04/2033                          | US            | USD      | 6,478,246         | 6,459,719 0.24  |
| Antheuser Busc 5.80% 23/01/2059                   | US            | USD      | 4,562,210         | 5,079,451 0.18  |
| Brown-Forman 4.75% 15/04/2033                     | US            | USD      | 4,572,880         | 4,660,841 0.17  |
| General Mills 5.241% 18/11/2025                   | US            | USD      | 3,932,677         | 3,935,542 0.14  |
|   |               |          | <b>20,135,533</b> | <b>0.73</b>     |
| <b>ヘルスケア</b>                                      |               |          |                   |                 |
| UnitedHealth Group 3.875% 15/12/2028              | US            | USD      | 7,926,325         | 7,770,291 0.28  |
| HCA 5.375% 01/02/2025                             | US            | USD      | 6,611,622         | 6,615,759 0.24  |
| UnitedHealth Group 5.35% 15/02/2033               | US            | USD      | 5,335,026         | 5,687,331 0.21  |
| AbbVie 4.875% 14/11/2048                          | US            | USD      | 4,416,640         | 4,250,979 0.15  |
| Eli Lilly 4.95% 27/02/2065                        | US            | USD      | 3,810,733         | 3,976,154 0.14  |
| Bayer 5.375% VRN 25/03/2082                       | DE            | EUR      | 3,810,733         | 3,868,718 0.14  |
| UnitedHealth Group 6.05% 15/02/2063               | US            | USD      | 3,042,489         | 3,507,175 0.13  |
| UnitedHealth Group 5.20% 15/04/2063               | US            | USD      | 3,410,600         | 3,482,927 0.13  |
| HCA 5.875% 15/02/2026                             | US            | USD      | 2,926,643         | 2,972,066 0.11  |
| HCA 5.625% 01/09/2028                             | US            | USD      | 2,667,515         | 2,718,726 0.10  |
|   |               |          | <b>44,850,126</b> | <b>1.63</b>     |
| <b>金融</b>   |               |          |                   |                 |
| Barclays 3.75% VRN 02/11/2038                     | GB            | USD      | 15,242,933        | 16,289,269 0.59 |
| ANZ Banking Group 5.101% VRN 03/05/2033 EMTN      | AU            | EUR      | 11,641,790        | 12,701,557 0.46 |
| Barclays 7.437% VRN 02/11/2033                    | GB            | USD      | 10,555,731        | 11,628,868 0.42 |
| AerCap Ireland Capital DAC 3.50% 30/01/2032       | IE            | USD      | 15,275,832        | 10,884,865 0.40 |
| Nationwide Building 6.0155% FRN 16/02/2028 144A   | GB            | USD      | 10,936,804        | 10,527,567 0.38 |
| HSBC Holdings 1.75% VRN 24/07/2027                | GB            | GBP      | 8,818,036         | 9,768,464 0.36  |

| 国コード  | 株数または額面<br>通貨 | 価値<br>価値 | 時価 (米ドル<br>)         | % Net<br>Assets        |
|---|---------------|----------|----------------------|------------------------|
| Westpac Banking 3.799% 17/01/2030 EMTN            | AU            | EUR      | 7,623,533            | 8,378,184 0.31         |
| BFCM Paris 5.125% 15/01/2033 EMTN                 | FR            | EUR      | 7,621,466            | 8,311,750 0.30         |
| HSBC Holdings 6.364% VRN 16/11/2032               | GB            | EUR      | 7,300,986            | 8,290,263 0.30         |
| Marsh & McLennan 5.75% 01/11/2032                 | US            | USD      | 7,421,466            | 8,211,466 0.30         |
| HSBC Holdings 4.787% VRN 10/05/2032 EMTN          | GB            | EUR      | 7,246,940            | 8,136,615 0.30         |
| AerCap Ireland Capital DAC 2.45% 29/10/2026       | IE            | USD      | 8,974,277            | 8,050,556 0.29         |
| ABN AMRO Bank 4.25% 21/02/2030 EMTN               | NL            | EUR      | 6,630,676            | 7,351,524 0.27         |
| Aon 3.75% 02/05/2029                              | US            | USD      | 7,421,466            | 7,305,176 0.27         |
| BNP Paribas 0.875% VRN 11/07/2030 EMTN            | FR            | EUR      | 7,926,325            | 7,140,865 0.26         |
| ING Groep 5.25% VRN 14/11/2033                    | NL            | EUR      | 5,944,744            | 6,939,569 0.25         |
| Morgan Stanley 2.95% VRN 07/05/2032               | US            | EUR      | 6,841,790            | 6,857,417 0.25         |
| HSBC Holdings 8.201% VRN 16/11/2034               | GB            | GBP      | 5,059,129            | 6,775,674 0.25         |
| Credit Suisse Group 2.125% VRN 13/10/2026         | CH            | EUR      | 6,671,832            | 6,765,802 0.25         |
| ANZ Banking Group 6.742% 08/12/2032 Reg S         | AU            | USD      | 6,333,458            | 6,702,647 0.24         |
| BPCE 4.50% 15/01/2033 EMTN                        | FR            | EUR      | 5,944,744            | 6,605,427 0.24         |
| Morgan Stanley 4.656% VRN 02/05/2029              | US            | EUR      | 5,095,426            | 5,730,494 0.21         |
| BP Capital Markets 4.812% 13/02/2033              | US            | USD      | 5,540,870            | 6,421,848 0.17         |
| HSBC Holdings 8.113% VRN 03/11/2033               | GB            | USD      | 4,578,977            | 5,169,115 0.19         |
| UBS Group 4.625% VRN 17/03/2028 EMTN              | CH            | EUR      | 6,621,657            | 5,101,274 0.19         |
| HSBC Holdings 5.402% VRN 11/08/2033               | GB            | USD      | 5,043,886            | 4,998,221 0.18         |
| ANZ Banking Group 4.812% 13/02/2033               | CA            | EUR      | 5,540,870            | 6,421,848 0.17         |
| ABN AMRO Bank 4.50% 21/11/2034                    | NL            | EUR      | 3,886,948            | 4,517,830 0.16         |
| UBS Group 4.75% VRN 17/03/2032 EMTN               | CH            | EUR      | 3,750,694            | 4,144,213 0.15         |
| HSBC Holding 6.332% VRN 09/03/2044                | GB            | USD      | 3,788,631            | 3,995,432 0.15         |
| HSBC Holdings 6.161% VRN 09/03/2029               | GB            | USD      | 3,788,631            | 3,995,432 0.15         |
| Nationwide Bldg So. 4.302% VRN 08/03/2029 144A    | GB            | USD      | 3,810,733            | 3,585,953 0.13         |
| BPCE 5.125% VRN 25/01/2033 EMTN                   | FR            | EUR      | 3,277,230            | 3,521,330 0.13         |
| Ford Motor Credit 7.35% 06/03/2030                | US            | USD      | 3,368,688            | 3,445,019 0.13         |
| AN Group 6.0% VRN 05/11/2043 EMTN                 | GB            | USD      | 3,095,840            | 3,426,351 0.13         |
| Barclays 1.007% VRN 10/12/2024                    | GB            | USD      | 3,429,640            | 3,516,949 0.12         |
| Morgan Stanley 0.406% VRN 29/10/2027              | US            | EUR      | 3,258,177            | 3,154,909 0.11         |
| Bank of America 2.824% VRN 27/04/2033 EMTN        | US            | EUR      | 3,029,533            | 2,960,323 0.11         |
| Goldman Sachs Group 6.23% 01/02/2041              | US            | USD      | 2,629,406            | 2,921,167 0.11         |
| Barclays 2.064% VRN 20/05/2027                    | GB            | AUD      | 4,933,953            | 2,915,659 0.11         |
| Morgan Stanley 1.102% VRN 29/04/2033 GMTN         | US            | EUR      | 3,535,445            | 2,807,814 0.10         |
| AerCap Ireland Capital 1.65% 29/10/2024           | IE            | USD      | 2,944,172            | 2,755,104 0.10         |
| Barclays 3.564% VRN 23/09/2035                    | GB            | USD      | 3,086,694            | 2,464,119 0.09         |
| Marsh & McLennan 6.25% 01/11/2032                 | US            | USD      | 2,111,908            | 2,428,125 0.09         |
| UBS Group 5.711% VRN 12/02/2027 144A              | CH            | USD      | 2,342,655            | 2,353,561 0.09         |
| Barclays 3.33% VRN 24/11/2042                     | GB            | USD      | 3,102,699            | 2,251,976 0.08         |
| Aon 3.90% 28/02/2052                              | US            | USD      | 2,682,756            | 2,166,197 0.08         |
| AerCap Ireland Capital DAC 3.85% 29/10/2041       | IE            | EUR      | 2,577,245            | 1,937,861 0.07         |
| Barclays 3.582% VRN 10/05/2032                    | GB            | AUD      | 3,810,733            | 1,935,600 0.07         |
| Aon 2.60% 02/12/2031                              | US            | USD      | 1,829,152            | 1,546,591 0.06         |
| Ford Motor Credit 7.35% 04/11/2027                | US            | USD      | 1,200,381            | 1,232,646 0.04         |
| Allianz SE 3.875% (Perpetual)                     | DE            | USD      | 1,676,723            | 1,169,788 0.04         |
|   |               |          | <b>285,107,993</b>   | <b>10.58</b>           |
| <b>国債</b>   |               |          |                      |                        |
| US Treasury 4.00% 29/02/2028**                    | US            | USD      | 343,347,055          | 350,468,825 12.76      |
| US Treasury 4.00% 28/02/2030                      | US            | USD      | 204,615,505          | 210,687,968 7.67       |
| US Treasury 4.50% 30/11/2024                      | US            | USD      | 184,195,597          | 184,620,110 6.72       |
| US Treasury 4.00% 15/11/2052                      | US            | USD      | 83,481,121           | 88,685,647 3.23        |
| US Treasury 1.875% 15/11/2051                     | US            | USD      | 76,550,007           | 52,197,357 1.90        |
| US Treasury 3.50% 15/02/2033                      | US            | USD      | 46,353,758           | 46,381,905 1.70        |
| US Treasury 3.00% 15/08/2052                      | US            | USD      | 44,097,804           | 38,764,726 1.41        |
| US Treasury 3.375% 15/08/2042                     | US            | USD      | 38,526,512           | 36,302,208 1.32        |
| US Treasury 3.875% 15/02/2043                     | US            | USD      | 20,711,355           | 20,936,247 0.76        |
| US Treasury 3.625% 15/02/2035                     | US            | USD      | 20,261,668           | 20,101,791 0.73        |
| US Treasury 3.625% 31/03/2030                     | US            | USD      | 15,974,593           | 16,105,635 0.59        |
| Germany 1.70% 15/08/2032                          | DE            | EUR      | 14,130,198           | 14,851,201 0.54        |
| Mexico 5.75% 05/03/2026                           | MX            | MXN      | 279,612,543          | 14,082,793 0.51        |
| New Zealand 5.0% 15/05/2024                       | NZ            | NZD      | 16,165,150           | 9,529,640 0.35         |
| Australia 1.25% 21/05/2032                        | AU            | AUD      | 16,348,045           | 9,074,523 0.33         |
| Saudi 4.875% 18/07/2033 Reg S                     | SA            | USD      | 6,954,588            | 7,163,017 0.26         |
| Australia 1.75% 21/06/2051                        | AU            | AUD      | 16,360,239           | 6,932,480 0.25         |
| Germany 2.34% 15/08/2052                          | DE            | EUR      | 10,176,468           | 5,705,835 0.21         |
| Mexico 7.75% 29/03/2031                           | MX            | MXN      | 101,174,965          | 5,278,629 0.19         |
| Australia 3.75% 21/05/2034                        | AU            | AUD      | 6,998,221            | 4,371,776 0.16         |
| Australia 3.00% 21/03/2047                        | AU            | AUD      | 2,686,567            | 1,541,652 0.06         |
| Germany 2.25% 15/02/2032                          | DE            | EUR      | 541,124              | 491,040 0.02           |
|   |               |          | <b>1,144,475,185</b> | <b>41.68</b>           |
| <b>オープンエンド型ファンド</b>                               |               |          |                      |                        |
| Fidelity IIF - The US Dollar Fund - A-ACC-USD     | IE            | USD      | 2,552                | 47,418,049 1.73        |
|   |               |          |                      | <b>47,418,049 1.73</b> |
| <b>コミュニケーション・サービス</b>                             |               |          |                      |                        |
| liad 5.625% 15/02/2030                            | FR            | EUR      | 8,459,828            | 8,961,095 0.33         |
| Orange 5.375% VRN (Perpetual) EMTN                | FR            | EUR      | 7,647,513            | 2,932,080 0.11         |
| Celinux Telecom 0.75% 20/11/2031                  | ES            | EUR      | 2,438,689            | 2,179,509 0.08         |
|   |               |          |                      | <b>14,027,684 0.51</b> |
| <b>その他の市場で取引される証券</b>                             |               |          |                      |                        |
| <b>エネルギー</b>                                      |               |          |                      |                        |
| Targa Resources Partners Finance 5.50% 01/03/2030 | US            | USD      | 3,810,733            | 3,715,770 0.14         |



|  | 契約額等 USD | 未実現 (損<br>益) (米ドル) | % Net<br>Assets |
|--|----------|--------------------|-----------------|
|--|----------|--------------------|-----------------|

#### 外国為替先物取引

|   |                    |               |        |
|---|--------------------|---------------|--------|
| Bought MXN Sold USD at 18.888600 16/05/2023   | 49,565,274         | 2,280,169     | 0.08   |
| Bought USD Sold AUD at 0.700840 16/05/2023    | 26,429,084         | 1,546,908     | 0.06   |
| Bought EUR Sold USD at 0.954815 16/05/2023    | 27,724,052         | 915,272       | 0.03   |
| Bought SEK Sold USD at 10.491119 16/05/2023   | 26,620,997         | 641,044       | 0.02   |
| Bought EUR Sold USD at 0.941863 16/05/2023    | 16,085,906         | 655,202       | 0.02   |
| Bought GBP Sold USD at 0.828766 16/05/2023    | 6,789,525          | 291,767       | 0.01   |
| Bought USD Sold SGD at 0.757878 16/05/2023    | 26,545,188         | 265,619       | 0.01   |
| Bought EUR Sold USD at 1.934540 16/05/2023    | 7,905,825          | 236,296       | 0.01   |
| Bought EUR Sold USD at 0.933146 16/05/2023    | 8,115,227          | 252,580       | 0.01   |
| Bought USD Sold NZD at 0.654479 16/05/2023    | 6,725,807          | 175,164       | 0.01   |
| Bought USD Sold JPY at 0.007750 16/05/2023    | 26,489,695         | 54,921        | 0.00   |
| Bought USD Sold ZAR at 0.056580 16/05/2023    | 511                | 26            | 0.00   |
| Bought USD Sold MYR at 0.224391 16/05/2023    | 208                | 8             | 0.00   |
| Bought PLN Sold USD at 0.224391 16/05/2023    | 26,149,654         | (31,426)      | (0.00) |
| Bought USD Sold EUR at 1.091776 16/05/2023    | 6,929,213          | (82,750)      | (0.00) |
| Bought USD Sold EUR at 1.082140 16/05/2023    | 10,454,455         | (216,016)     | (0.01) |
| Bought USD Sold EUR at 1.064293 16/05/2023    | 7,254,283          | (247,040)     | (0.01) |
| Bought USD Sold EUR at 1.062758 16/05/2023    | 9,267,023          | (354,031)     | (0.01) |
| Bought USD Sold MXN at 0.054659 16/05/2023    | 29,902,578         | (388,054)     | (0.01) |
| Bought JPY Sold USD at 155.915290 16/05/2023  | 54,658,808         | (716,764)     | (0.03) |
| Bought KRW Sold USD at 1254.204470 16/05/2023 | 15,190,910         | (817,111)     | (0.03) |
| Bought USD Sold SEK at 0.094756 16/05/2023    | 27,282,041         | (818,147)     | (0.03) |
| Bought MYR Sold USD at 4.274500 16/05/2023    | 27,230,271         | (1,080,637)   | (0.04) |
| Bought USD Sold MXN at 0.053048 16/05/2023    | 26,487,245         | (1,114,405)   | (0.04) |
| Bought USD Sold USD at 0.052051 16/05/2023    | 18,119,792         | (1,156,531)   | (0.04) |
| Bought USD Sold GBP at 1.212756 16/05/2023    | 36,564,655         | (1,320,805)   | (0.05) |
| Bought USD Sold EUR at 1.081362 16/05/2023    | 304,494,628        | (6,506,047)   | (0.24) |
|   | <b>(7,499,628)</b> | <b>(0.27)</b> |        |

#### A-ACC Shares (PLN) (hedged)

|  |                  |             |        |
|--|------------------|-------------|--------|
| Bought PLN Sold USD at 4.300723 09/05/2023 | 40,934,403       | 2,135,885   | 0.08   |
| Bought PLN Sold USD at 4.171616 07/04/2023 | 47,097,326       | 149,079     | 0.01   |
| Bought PLN Sold USD at 4.306024 09/05/2023 | 1,075,682        | 38,990      | 0.00   |
| Bought PLN Sold USD at 4.284103 09/05/2023 | 1,253,051        | 38,893      | 0.00   |
| Bought PLN Sold USD at 4.170959 09/05/2023 | 1,076,275        | 4,099       | 0.00   |
| Bought USD Sold PLN at 0.240122 09/05/2023 | 66,555,279       | (150,366)   | (0.01) |
|  | <b>2,216,580</b> | <b>0.08</b> |        |

#### A-MCDIST (G) Shares (SGD) (USD hedged)

|  |           |             |        |
|--|-----------|-------------|--------|
| Bought SGD Sold USD at 1.335025 07/06/2023 | 49,812    | 133         | 0.00   |
| Bought SGD Sold USD at 1.335167 09/05/2023 | 50,031    | 84          | 0.00   |
| Bought USD Sold SGD at 0.748223 09/05/2023 | 50,115    | (134)       | (0.00) |
|  | <b>83</b> | <b>0.00</b> |        |

#### A-MINCOME (G) Shares (AUD) (hedged)

|  |              |               |        |
|--|--------------|---------------|--------|
| Bought AUD Sold USD at 1.513752 07/06/2023 | 49,083       | 159           | 0.00   |
| Bought USD Sold AUD at 0.674085 09/05/2023 | 860          | 16            | 0.00   |
| Bought AUD Sold USD at 1.492647 09/05/2023 | 804          | (10)          | (0.00) |
| Bought USD Sold AUD at 0.659774 09/05/2023 | 48,981       | (158)         | (0.00) |
| Bought AUD Sold USD at 1.495410 09/05/2023 | 49,552       | (505)         | (0.00) |
|  | <b>(498)</b> | <b>(0.00)</b> |        |

#### A-MINCOME (G) Shares (SGD) (hedged)

|  |              |               |        |
|--|--------------|---------------|--------|
| Bought SGD Sold USD at 1.335025 07/06/2023 | 51,235       | 137           | 0.00   |
| Bought USD Sold SGD at 0.751042 09/05/2023 | 900          | 1             | 0.00   |
| Bought SGD Sold USD at 1.327909 09/05/2023 | 828          | (3)           | (0.00) |
| Bought USD Sold SGD at 0.748223 09/05/2023 | 51,090       | (136)         | (0.00) |
| Bought SGD Sold USD at 1.328619 09/05/2023 | 51,352       | (166)         | (0.00) |
|  | <b>(167)</b> | <b>(0.00)</b> |        |

#### I-ACC Shares (CHF) (hedged)

|  |              |             |        |
|--|--------------|-------------|--------|
| Bought CHF Sold USD at 0.911390 09/05/2023 | 280,560      | 6,625       | 0.00   |
| Bought CHF Sold USD at 0.888910 07/06/2023 | 288,893      | 549         | 0.00   |
| Bought CHF Sold USD at 0.902215 09/05/2023 | 4,544        | 60          | 0.00   |
| Bought USD Sold CHF at 1.118200 09/05/2023 | 4,942        | (22)        | (0.00) |
| Bought USD Sold CHF at 1.121248 09/05/2023 | 286,848      | (481)       | (0.00) |
|  | <b>6,731</b> | <b>0.00</b> |        |

#### I-ACC Shares (EUR) (hedged)

|  |                  |             |        |
|--|------------------|-------------|--------|
| Bought EUR Sold USD at 0.917944 09/05/2023 | 149,835,967      | 2,076,127   | 0.08   |
| Bought EUR Sold USD at 0.906460 07/06/2023 | 119,615,549      | 380,922     | 0.01   |
| Bought EUR Sold USD at 0.911973 09/05/2023 | 2,574,742        | 17,245      | 0.00   |
| Bought USD Sold EUR at 1.104340 09/05/2023 | 6,338,092        | (836)       | (0.00) |
| Bought USD Sold EUR at 1.098454 09/05/2023 | 2,547,828        | (13,914)    | (0.00) |
| Bought USD Sold EUR at 1.097574 09/05/2023 | 24,868,050       | (155,623)   | (0.01) |
| Bought USD Sold EUR at 1.101125 09/05/2023 | 120,548,109      | (366,853)   | (0.01) |
|  | <b>1,937,064</b> | <b>0.07</b> |        |

#### Y-ACC Shares (CHF) (hedged)

|  |                |             |        |
|--|----------------|-------------|--------|
| Bought CHF Sold USD at 0.911390 09/05/2023 | 5,621,743      | 132,744     | 0.00   |
| Bought CHF Sold USD at 0.888910 07/06/2023 | 5,899,245      | 11,204      | 0.00   |
| Bought CHF Sold USD at 0.902215 09/05/2023 | 107,513        | 1,431       | 0.00   |
| Bought USD Sold CHF at 1.121248 09/05/2023 | 5,865,431      | (9,842)     | (0.00) |
|  | <b>135,537</b> | <b>0.00</b> |        |

#### Y-ACC Shares (EUR) (hedged)

|  |            |           |        |
|--|------------|-----------|--------|
| Bought EUR Sold USD at 0.916085 09/05/2023 | 92,718,491 | 1,094,524 | 0.04   |
| Bought EUR Sold USD at 0.906460 07/06/2023 | 97,286,931 | 278,987   | 0.01   |
| Bought EUR Sold USD at 0.905518 09/05/2023 | 1,719,679  | 227       | 0.00   |
| Bought EUR Sold USD at 0.904909 09/05/2023 | 1,741,612  | (943)     | (0.00) |

|  | 契約額等 USD | 未実現 (損<br>益) (米ドル) | % Net<br>Assets |
|--|----------|--------------------|-----------------|
|--|----------|--------------------|-----------------|

Bought USD Sold EUR at 1.101475 09/05/2023

97,273,390 (265,183) (0.01)  
**1,107,412 0.04**

|  | 契約額等 | 未実現 (損<br>益) (米ドル) | % Net<br>Assets |
|--|------|--------------------|-----------------|
|--|------|--------------------|-----------------|

#### 先物取引

|  |     |                  |             |        |
|--|-----|------------------|-------------|--------|
| US 10 Year Note Bond Future 21/04/2023   | USD | 179,549,122      | 5,765,524   | 0.21   |
| US 10 Year Ultra Bond Future 21/06/2023  | USD | 35,669,653       | 1,501,326   | 0.05   |
| US 5 Year Bond Future 30/06/2023         | USD | 48,622,302       | 1,162,404   | 0.04   |
| US Long Bond Future 21/06/2023           | USD | 9,445,521        | 460,346     | 0.02   |
| Long Gilt Bond Future 28/06/2023         | GBP | 18,713,230       | 170,457     | 0.01   |
| US Ultra Bond Future 21/06/2023          | USD | 431,661          | 22,245      | 0.00   |
| Euro-Buxl 30 Year Bond Future 08/06/2023 | EUR | (14,246,807)     | (827,577)   | (0.03) |
| Euro-Bobl Bond Future 08/06/2023         | EUR | (42,347,816)     | (1,084,284) | (0.04) |
| Euro-Bond Future 08/06/2023              | EUR | (65,849,657)     | (2,381,560) | (0.09) |
|  |     | <b>4,788,881</b> | <b>0.17</b> |        |

|  | 契約額等 | 未実現 (損<br>益) (米ドル) | % Net<br>Assets |
|--|------|--------------------|-----------------|
|--|------|--------------------|-----------------|

#### インフレーション スワップ

|  |     |                    |               |        |
|--|-----|--------------------|---------------|--------|
| Receive fixed 2.059% pay float. (Euro HICP) 15/01/2027 | EUR | 6,097,173          | (716,080)     | (0.03) |
| Receive fixed 2.076% pay float. (Euro HICP) 15/1/2026  | EUR | 11,432,199         | (1,445,169)   | (0.05) |
|  |     | <b>(2,161,249)</b> | <b>(0.08)</b> |        |

#### その他資産 (負債控除後)

|                   |  |                      |               |
|-------------------|--|----------------------|---------------|
|                   |  | 48,426,599           | 1.77          |
| <b>Net Assets</b> |  | <b>2,746,164,423</b> | <b>100.00</b> |



<補足情報>

## フィデリティ・ファンズーエマージング・マーケット・デット・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|         |   |
|---------|---|
| 設 定 形 態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／米ドル建て                    |
| 投 資 目 的 | 主としてエマージング債券に投資し、インカムの確保と値上り益の追求を目指します。 |
| 決 算 日   | 4月30日                                   |

## 運用および純資産変動計算書

2023年4月30日に終了した年度

| 通貨                       | USD                  |
|--------------------------|----------------------|
| <b>投資収益</b>              |                      |
| 受取配当金および受取利息             | 82,521,807           |
| スワップ取引に係る受取利息            | 8,395,671            |
| デリバティブ収益                 | 550,425              |
| <b>純利益</b>               | <b>91,467,903</b>    |
| <b>費用</b>                |                      |
| 運用報酬                     | 12,500,341           |
| 管理費                      | 3,235,988            |
| 国税                       | 592,460              |
| 保管費用                     | 369,748              |
| 販売手数料                    | 399,853              |
| 成功報酬                     | —                    |
| その他費用                    | 225,122              |
| <b>費用合計</b>              | <b>17,323,512</b>    |
| スワップ取引に係る支払利息            | 17,597,169           |
| デリバティブ費用                 | —                    |
| 差金決済取引に係る財務費用            | —                    |
| 還付ブローカー費用                | —                    |
| 管理費用の払戻                  | —                    |
| 払戻費用                     | —                    |
| 費用還付                     | —                    |
| <b>総費用</b>               | <b>34,920,681</b>    |
| <b>純投資収益(損失)</b>         | <b>56,547,222</b>    |
| 有価証券に係る実現純(損)益           | (375,397,018)        |
| 外貨取引に係る実現純(損)益           | 170,640              |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益         | —                    |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益       | (9,231,161)          |
| オプション取引に係る実現純(損)益        | —                    |
| 先物取引に係る実現純(損)益           | (63,191,412)         |
| スワップ取引に係る実現純(損)益         | (15,206,331)         |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額     | 196,922,895          |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額     | (668,381)            |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額   | —                    |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (7,481,533)          |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額  | —                    |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額     | 33,965,270           |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額   | 11,618,915           |
| <b>運用実績</b>              | <b>(171,950,894)</b> |
| <b>受益者への分配金</b>          | <b>(20,428,166)</b>  |
| <b>設定解約</b>              |                      |
| 当期設定額                    | 277,602,714          |
| 当期解約額                    | (607,745,546)        |
| 調整勘定                     | (6,346,856)          |
| 設定解約に伴う増加(減少)額           | (336,489,688)        |
| <b>純増加(減少)</b>           | <b>(528,868,748)</b> |
| <b>純資産額</b>              |                      |
| 期首                       | 1,690,405,669        |
| 期末                       | 1,161,536,921        |



|  | 国コード | 株数または額面<br>通貨 | 時価 (米ドル<br>価値)    | % Net<br>Assets |             | 国コード | 株数または額面<br>通貨 | 時価 (米ドル<br>価値) | % Net<br>Assets |
|--|------|---------------|-------------------|-----------------|-------------|------|---------------|----------------|-----------------|
|  |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| Light SEGA 4.375% 18/06/2026 Reg S (Defaulted)     | BR   | USD           | 7,505,330         | 2,816,000       | 0.24        |      |               |                |                 |
| EGE Haina 5.625% 08/11/2028 Reg S                  | DO   | USD           | 3,058,598         | 2,754,115       | 0.24        |      |               |                |                 |
| SCC Power 8.00% 31/12/2028 Reg S                   | GB   | USD           | 5,813,063         | 2,020,039       | 0.17        |      |               |                |                 |
| Eskom Holdings SOC 8.45% 10/08/2028 Reg S          | ZA   | USD           | 1,552,827         | 1,492,577       | 0.13        |      |               |                |                 |
| SCC Power 4.00% 17/05/2032 Reg S                   | GB   | USD           | 6,297,486         | 670,682         | 0.06        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>25,859,497</b> | <b>2.23</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>素材</b>  |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| Newcastle Coal Infrast. 4.70% 12/05/2031 Reg S     | AU   | USD           | 5,064,098         | 4,167,969       | 0.36        |      |               |                |                 |
| Endeavour Mining 5.00% 14/10/2024 Reg S            | GB   | USD           | 4,151,441         | 3,999,744       | 0.21        |      |               |                |                 |
| SABIC Capital II BV 4.50% 10/10/2028 Reg S         | NL   | USD           | 2,552,768         | 2,349,582       | 0.20        |      |               |                |                 |
| Braskem Idesa 6.99% 20/02/2032 Reg S               | MX   | USD           | 1,952,797         | 1,402,109       | 0.12        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>11,519,422</b> | <b>0.99</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>資本財・サービス</b>                                    |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| Acu Petroleo Luxembourg 7.50% 13/01/2032 Reg S     | LU   | USD           | 13,656,075        | 11,887,624      | 1.02        |      |               |                |                 |
| EPE 3.83% 14/09/2061 Reg S                         | CL   | USD           | 15,504,888        | 9,569,069       | 0.81        |      |               |                |                 |
| Alfa Desarrollo 4.53% 17/09/2051 Reg S             | CL   | USD           | 3,547,872         | 2,448,967       | 0.21        |      |               |                |                 |
| Hydriwos Intl Fin. 4.95% 08/02/2031 Reg S          | LU   | USD           | 3,187,530         | 2,402,710       | 0.21        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>26,108,370</b> | <b>2.25</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>一般消費財・サービス</b>                                  |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| MercadoLibre 3.12% 14/01/2031                      | US   | USD           | 1,482,244         | 1,149,594       | 0.10        |      |               |                |                 |
| LCPR Senior Secured Fin. 6.75% 15/10/2027 144A     | IE   | USD           | 820,645           | 777,141         | 0.07        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>1,926,735</b>  | <b>0.17</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>ヘルスケア</b>                                       |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| Teva Pharm. Fin. Netherland II 7.875% 15/09/2031   | NL   | EUR           | 1,585,766         | 1,804,233       | 0.16        |      |               |                |                 |
| Teva Pharm. Fin. III BV 8.125% 15/09/2031          | NL   | USD           | 885,582           | 933,143         | 0.08        |      |               |                |                 |
| Teva Pharmaceutical Finance 7.875% 15/09/2029      | NL   | USD           | 483,729           | 507,660         | 0.04        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>3,245,036</b>  | <b>0.28</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>金融</b>  |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| TBC Bank 10.775% VRN (Perpetual) Reg S             | GE   | USD           | 8,234,688         | 7,846,834       | 0.68        |      |               |                |                 |
| StoneCo 3.95% 16/06/2028 Reg S                     | KY   | USD           | 9,716,932         | 7,361,638       | 0.63        |      |               |                |                 |
| Magyar Export-Import Bank 6.125% 04/12/2027 Reg S  | HU   | USD           | 5,407,602         | 5,444,509       | 0.47        |      |               |                |                 |
| Banco Nacional de Panama 2.50% 11/08/2030 Reg S    | PA   | USD           | 5,764,282         | 4,601,338       | 0.40        |      |               |                |                 |
| Banco CMB Sudamerica 7.50% VRN 16/04/2031 Reg S    | CO   | USD           | 5,529,005         | 4,119,109       | 0.35        |      |               |                |                 |
| JSC Georgia Capital 6.125% 09/03/2024 Reg S        | GE   | USD           | 4,093,816         | 4,017,057       | 0.35        |      |               |                |                 |
| Inversiones Atlantida 7.50% 19/05/2026 Reg S       | HN   | USD           | 3,679,729         | 3,401,008       | 0.29        |      |               |                |                 |
| Itau Unibanco Hld. 4.625% VRN (Perpetual) Reg S    | BR   | USD           | 2,682,156         | 2,099,801       | 0.18        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>38,891,294</b> | <b>3.35</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>不動産</b>   |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| CPI Property Group 1.50% 27/01/2031 EMTN           | LU   | EUR           | 4,329,093         | 2,568,406       | 0.22        |      |               |                |                 |
| China SCE Group 5.95% 29/09/2024                   | KY   | USD           | 476,200           | 209,528         | 0.02        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>2,777,934</b>  | <b>0.24</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>国債</b>  |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| Romania 7.125% 17/01/2033 Reg S                    | RO   | USD           | 15,486,066        | 14,461,041      | 1.24        |      |               |                |                 |
| Paraguay 3.849% 28/04/2033 Reg S                   | PY   | USD           | 12,101,698        | 10,632,636      | 0.92        |      |               |                |                 |
| Ghana 19.25% 18/01/2027                            | GH   | GHS           | 207,867,055       | 9,949,151       | 0.86        |      |               |                |                 |
| South Africa 5.875% 20/04/2032                     | ZA   | USD           | 10,587,456        | 9,633,463       | 0.83        |      |               |                |                 |
| Peru 2.78% 01/12/2060                              | PE   | USD           | 9,411,072         | 5,788,892       | 0.50        |      |               |                |                 |
| Peru 2.783% 23/01/2031                             | PE   | USD           | 6,587,750         | 5,713,442       | 0.49        |      |               |                |                 |
| Ivory Coast 6.875% 17/10/2040 Reg S                | CI   | EUR           | 5,152,562         | 4,140,093       | 0.36        |      |               |                |                 |
| Dominican Republic 6.00% 22/02/2033 Reg S          | DO   | USD           | 4,345,092         | 4,057,424       | 0.35        |      |               |                |                 |
| Saudi Arabia 4.375% 16/04/2029 Reg S               | SA   | USD           | 3,764,429         | 3,796,679       | 0.33        |      |               |                |                 |
| Armenia 3.60% 02/03/2031 Reg S                     | AM   | USD           | 4,287,684         | 3,377,083       | 0.29        |      |               |                |                 |
| Paraguay 2.739% 29/01/2033 Reg S                   | PY   | USD           | 2,552,768         | 1,908,363       | 0.16        |      |               |                |                 |
| Argentina 3.00% 09/01/2038                         | AR   | EUR           | 3,561,418         | 895,524         | 0.08        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>74,353,793</b> | <b>6.40</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>非上場</b>   |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| <b>エネルギー</b>                                       |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| Nostrum Oil & Gas Finance 5.00% 30/06/2026 Reg S   | NL   | USD           | 3,438,806         | 2,571,333       | 0.22        |      |               |                |                 |
| Nostrum Oil & Gas Finance 14.00% 30/06/2026 Reg S  | NL   | USD           | 4,749,259         | 1,590,764       | 0.14        |      |               |                |                 |
| Lebanon 7.00% 22/04/2031 (Defaulted)               | LB   | USD           | 164,694           | 10,129          | 0.00        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>4,172,226</b>  | <b>0.36</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>公益事業</b>  |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| NPC Ukrenegro 6.875% 09/11/2028 Reg S (Defaulted)  | UA   | USD           | 8,893,463         | 1,534,122       | 0.13        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>1,534,122</b>  | <b>0.13</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>素材</b>  |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| Pearl Hldg II 6.00% (Perpetual) Reg S (Defaulted)  | KY   | USD           | 583,755           | 20,431          | 0.00        |      |               |                |                 |
| Sino-Forest 6.25% 21/10/2017 144A (Defaulted)*     | CA   | USD           | 6,785,383         | 68              | 0.00        |      |               |                |                 |
| Sino Forest 10.25% 28/07/2014 (Defaulted)*         | CA   | USD           | 621,151           | 6               | 0.00        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>20,505</b>     | <b>0.00</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>資本財・サービス</b>                                    |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| Ukraine Railways 7.875% 15/07/2028 (Defaulted)     | GB   | USD           | 5,033,982         | 1,038,259       | 0.09        |      |               |                |                 |
| Blue Skyview 15.758% (Perpetual) (Defaulted)       | VG   | USD           | 941,107           | 42,350          | 0.00        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>1,080,609</b>  | <b>0.09</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>一般消費財・サービス</b>                                  |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| JCC Ventures 3.00% 30/06/2025 (Defaulted)          | SG   | USD           | 3,034,901         | 1,051,760       | 0.09        |      |               |                |                 |
| Food Retail 5.60% 22/01/2025 Reg S (Defaulted)     | IN   | USD           | 1,830,454         | 52,717          | 0.00        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>1,830,454</b>  | <b>52,717</b>   | <b>0.00</b> |      |               |                |                 |
| <b>金融</b>  |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| Tianjin State-OCI. & Management. -1.60% 17/12/2039 | CN   | USD           | 6,063,554         | 1,348,156       | 0.12        |      |               |                |                 |
| Yihou Overseas Inv. 8.50% 23/10/2020 (Defaulted)   | VG   | USD           | 1,435,188         | 79,208          | 0.01        |      |               |                |                 |
| Pearl Holding II 9.00% 22/10/2025 Reg S            | KY   | USD           | 464,907           | 4,649           | 0.00        |      |               |                |                 |
| Sowcombank 7.60% (Perpetual) Reg S (Defaulted)*    | IE   | USD           | 16,654,070        | 166             | 0.00        |      |               |                |                 |
| GTLC Europe Capital 4.349% 27/02/2029 (Defaulted)* | IE   | USD           | 8,055,878         | 81              | 0.00        |      |               |                |                 |
| Alfa Bank 5.50% 26/10/2031 Reg S (Defaulted)*      | IE   | USD           | 8,117,050         | 81              | 0.00        |      |               |                |                 |
| Bulgaria Steel Fin. 12.00% 04/05/2013 (Defaulted)* | NL   | EUR           | 282,332           | 3               | 0.00        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>1,452,344</b>  | <b>0.12</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>不動産</b>   |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| Easy Tactic 7.50% VRN 11/07/2028 (Defaulted)       | VG   | USD           | 8,854,488         | 1,293,668       | 0.11        |      |               |                |                 |
| Suncor China Holdings 5.95% 26/04/2024 (Defaulted) | KY   | USD           | 3,540,951         | 691,527         | 0.06        |      |               |                |                 |
| Kaisa Group Holdings 9.375% 30/06/2024 (Defaulted) | KY   | USD           | 9,728,225         | 982,281         | 0.08        |      |               |                |                 |
| Shimao Group 5.20% 16/01/2027 (Defaulted)          | KY   | USD           | 7,058,304         | 926,016         | 0.08        |      |               |                |                 |
| Easy Tactic 7.50% VRN 11/07/2025 (Defaulted)       | VG   | USD           | 3,482,333         | 712,783         | 0.06        |      |               |                |                 |
| Redsun Prop. Grp. 7.30% 15/01/2025 (Defaulted)     | KY   | USD           | 5,340,951         | 547,609         | 0.05        |      |               |                |                 |
| China Aoyuan Grp 8.50% 23/01/2022 (Defaulted)      | KY   | USD           | 4,705,536         | 329,593         | 0.03        |      |               |                |                 |
| Yuzhou Grp Hlgs 7.375% 13/01/2026 (Defaulted)      | KY   | USD           | 4,493,787         | 320,766         | 0.03        |      |               |                |                 |
| Redsun Prop. Grp. 9.50% 20/09/2023 (Defaulted)     | KY   | USD           | 2,705,683         | 290,861         | 0.03        |      |               |                |                 |
| China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted)    | KY   | USD           | 3,503,742         | 243,103         | 0.02        |      |               |                |                 |
|  |      |               | <b>8,604,469</b>  | <b>0.74</b>     |             |      |               |                |                 |
| <b>国債</b>  |      |               |                   |                 |             |      |               |                |                 |
| SL Lanka 7.85% 14/03/2029 Reg S (Defaulted)        | LK   | USD           | 17,068,861        | 5,766,473       | 0.50        |      |               |                |                 |
| Ukraine 0.00% FRN 01/08/2041 Reg S (Defaulted)     | UA   | USD           | 17,575,177        | 4,351,971       | 0.39        |      |               |                |                 |
| Ghana 6.375% 11/02/2027 Reg S (Defaulted)          | GH   | USD           | 11,801,484        | 4,477,873       | 0.39        |      |               |                |                 |
| Zambia 8.97% 30/07/2027 Reg S (Defaulted)          | ZM   | USD           | 9,301,904         | 4,365,058       | 0.38        |      |               |                |                 |
| Sri Lanka 7.55% 28/05/2030 Reg S (Defaulted)       | LK   | USD           | 12,140,283        | 4,070,813       | 0.35        |      |               |                |                 |
| Ukraine 7.375% 25/09/2034 Reg S (Defaulted)        | UA   | USD           | 23,104,182        | 3,857,659       | 0.33        |      |               |                |                 |
| Ghana 7.625% 16/05/2029 Reg S (Defaulted)          | GH   | USD           | 5,740,754         | 2,145,739       | 0.18        |      |               |                |                 |
| Zambia 5.375% 20/09/2022 Reg S (Defaulted)         | ZM   | USD           | 4,386,501         | 1,923,783       | 0.17        |      |               |                |                 |
| Lebanon 6.85% 25/05/2029 EMTN (Defaulted)          | LB   | USD           | 28,018,644        | 1,740,518       | 0.15        |      |               |                |                 |
| Ghana 8.125% 26/03/2032 Reg S (Defaulted)          | GH   | USD           | 4,580,369         | 1,718,463       | 0.15        |      |               |                |                 |
| Lebanon 8.20% 17/05/2033 (Defaulted)               | LB   | USD           | 24,468,787        | 1,496,266       | 0.13        |      |               |                |                 |
| Ukraine 8.994% 01/02/2026 Reg S (Defaulted)        | UA   | USD           | 8,039,879         | 1,438,037       | 0.12        |      |               |                |                 |
| Ukraine 7.75% 01/09/2025 Reg S (Defaulted)         | UA   | USD           | 7,058,304         | 1,365,260       | 0.12        |      |               |                |                 |
| Ghana 7.57% 07/04/2029 Reg S (Defaulted)           | GH   | USD           | 5,074,597         | 1,153,655       | 0.10        |      |               |                |                 |
| Peru 2.78% 01/12/2060                              | PE   | USD           | 11,293,287        | 1,016,396       | 0.09        |      |               |                |                 |
| Lebanon 6.75% 29/11/2027 (Defaulted)               | LB   | USD           | 16,170,104        | 977,321         | 0.08        |      |               |                |                 |
| Lebanon 6.65% 26/02/2030 GMTN (Defaulted)          | LB   | USD           | 12,303,095        | 765,622         | 0.07        |      |               |                |                 |
| Lebanon 6.20% 26/02/2025 GMTN (Defaulted)          | LB   | USD           | 11,952,062        | 735,049         | 0.06        |      |               |                |                 |
| Lebanon 6.85% 23/03/2027 (Defaulted)               | LB   | USD           | 9,811,043         | 598,670         | 0.05        |      |               |                |                 |
| Lebanon 7.05% 02/11/2035 GMTN (Defaulted)          | LB   | USD           | 9,411,072         | 574,264         | 0.05        |      |               |                |                 |
| Lebanon 8.25% 17/05/2034 (Defaulted)               | LB   | USD           | 9,411,072         | 564,382         | 0.05        |      |               |                |                 |
| Ghana 7.875% 26/03/2027 Reg S (Defaulted)          | GH   | USD           | 1,411,661         | 532,312         | 0.05        |      |               |                |                 |
| Lebanon 6.375% 09/03/2020 GMTN (Defaulted)         | LB   | USD           | 7,105,359         | 440,332         | 0.04        |      |               |                |                 |
| Lebanon 7.15% 20/11/2031 GMTN (Defaulted)          | LB   | USD           | 7,058,304         | 433,592         | 0.04        |      |               |                |                 |
| Lebanon 6.25% 12/06/2025 (Defaulted)               | LB   | USD           | 6,281,891         | 390,482         | 0.03        |      |               |                |                 |
| Lebanon 7.25% 23/03/2037 (Defaulted)               | LB   | USD           | 3,035,071         | 185,200         | 0.02        |      |               |                |                 |
| Lebanon 6.40% 26/05/2023 GMTN (Defaulted)          | LB   | USD           | 1,964,091         | 124,366         | 0.01        |      |               |                |                 |
| Lebanon 6.15% 19/06/2020 GMTN (Defaulted)          | LB   | USD           | 1,646,938         | 102,110         | 0.01        |      |               |                |                 |
| Lebanon 6.65% 22/04/2024 (Defaulted)               | LB   | USD           | 1,635,644         | 100,592         |             |      |               |                |                 |

|  | 契約額等 USD | 未実現 (損 % Net Assets) | (益 (米ドル)) |
|--|----------|----------------------|-----------|
|--|----------|----------------------|-----------|

外国為替先物取引

|   |            |                    |               |
|---|------------|--------------------|---------------|
| Bought USD Sold ILS at 0.289282 16/05/2023    | 13,810,923 | 688,056            | 0.06          |
| Bought HUF Sold USD at 371.740000 16/05/2023  | 6,611,641  | 629,821            | 0.05          |
| Bought USD Sold KRW at 0.000799 16/05/2023    | 15,508,985 | 548,005            | 0.05          |
| Bought CLP Sold USD at 833.885000 16/05/2023  | 13,685,788 | 471,939            | 0.04          |
| Bought BRL Sold USD at 5.301660 16/05/2023    | 6,831,544  | 379,953            | 0.03          |
| Bought USD Sold ILS at 0.287561 16/05/2023    | 7,035,513  | 306,569            | 0.03          |
| Bought EUR Sold USD at 0.935995 16/05/2023    | 7,712,302  | 247,068            | 0.02          |
| Bought USD Sold TRY at 0.041293 22/06/2023    | 5,035,496  | 200,230            | 0.02          |
| Bought COP Sold USD at 4842.349998 16/05/2023 | 6,956,914  | 202,555            | 0.02          |
| Bought USD Sold TRY at 0.047095 22/06/2023    | 5,053,560  | 187,750            | 0.02          |
| Bought EUR Sold USD at 0.941689 16/05/2023    | 4,323,329  | 175,264            | 0.02          |
| Bought PLN Sold USD at 4.199080 16/05/2023    | 12,545,352 | 129,420            | 0.01          |
| Bought INR Sold USD at 83.850000 16/05/2023   | 7,240,259  | 104,538            | 0.01          |
| Bought EUR Sold USD at 0.929094 16/05/2023    | 3,465,232  | 92,254             | 0.01          |
| Bought USD Sold KRW at 0.000760 16/05/2023    | 5,683,353  | 89,551             | 0.01          |
| Bought USD Sold KRW at 0.000759 16/05/2023    | 6,083,485  | 86,809             | 0.01          |
| Bought PHP Sold USD at 53.618400 16/05/2023   | 21,076,944 | 84,985             | 0.01          |
| Bought EUR Sold USD at 0.940042 16/05/2023    | 2,147,584  | 83,195             | 0.01          |
| Bought EUR Sold USD at 0.938821 16/05/2023    | 2,087,069  | 77,996             | 0.01          |
| Bought THB Sold USD at 34.455500 16/05/2023   | 7,033,005  | 74,382             | 0.01          |
| Bought USD Sold ILS at 0.278677 16/05/2023    | 5,156,988  | 58,713             | 0.01          |
| Bought USD Sold PHP at 0.018197 16/05/2023    | 7,150,342  | 57,093             | 0.01          |
| Bought USD Sold PHP at 0.018169 16/05/2023    | 7,346,850  | 47,390             | 0.00          |
| Bought ILS Sold USD at 0.365620 16/05/2023    | 5,836,769  | 42,410             | 0.00          |
| Bought HUF Sold USD at 341.283000 16/05/2023  | 5,776,182  | 31,907             | 0.00          |
| Bought USD Sold TWD at 0.032741 16/05/2023    | 5,791,954  | 29,880             | 0.00          |
| Bought USD Sold CNY at 0.145370 16/05/2023    | 5,719,676  | 29,453             | 0.00          |
| Bought USD Sold ZAR at 0.054804 16/05/2023    | 5,757,817  | 23,197             | 0.00          |
| Bought MXN Sold USD at 18.248800 16/05/2023   | 2,115,788  | 22,380             | 0.00          |
| Bought USD Sold ILS at 0.276106 16/05/2023    | 5,879,179  | 17,771             | 0.00          |
| Bought EUR Sold USD at 0.906795 16/05/2023    | 4,100,500  | 8,132              | 0.00          |
| Bought USD Sold TWD at 0.032615 16/05/2023    | 6,173,701  | 7,947              | 0.00          |
| Bought USD Sold ZAR at 0.054611 16/05/2023    | 5,057,391  | 1,533              | 0.00          |
| Bought IDR Sold USD at 15.11049225 16/05/2023 | 1,586      | 47                 | 0.00          |
| Bought USD Sold HUF at 0.020680 16/05/2023    | 5          | 0                  | 0.00          |
| Bought USD Sold MXN at 0.052050 16/05/2023    | 52         | (3)                | (0.00)        |
| Bought USD Sold ILS at 0.275247 16/05/2023    | 5,820,830  | (6,487)            | (0.00)        |
| Bought USD Sold PHP at 0.018035 16/05/2023    | 6,683,831  | (8,191)            | (0.00)        |
| Bought CNY Sold USD at 6.750450 16/05/2023    | 359,549    | (8,526)            | (0.00)        |
| Bought USD Sold CLP at 0.001238 16/05/2023    | 6,946,995  | (16,756)           | (0.00)        |
| Bought THB Sold USD at 35.995000 16/05/2023   | 5,879,768  | (17,229)           | (0.00)        |
| Bought USD Sold CNY at 0.144038 16/05/2023    | 6,750,008  | (27,353)           | (0.00)        |
| Bought USD Sold INR at 0.021168 16/05/2023    | 7,544,597  | (27,956)           | (0.00)        |
| Bought USD Sold TRY at 0.045159 22/06/2023    | 5,282,013  | (28,891)           | (0.00)        |
| Bought USD Sold THB at 0.029174 16/05/2023    | 7,107,387  | (37,819)           | (0.00)        |
| Bought CNY Sold USD at 6.867090 16/05/2023    | 5,802,802  | (59,707)           | (0.00)        |
| Bought ZAR Sold USD at 0.054400 16/05/2023    | 5,808,546  | (59,149)           | (0.00)        |
| Bought USD Sold ZAR at 0.053604 16/05/2023    | 2,857,102  | (51,266)           | (0.00)        |
| Bought ILS Sold USD at 0.361670 16/05/2023    | 17,995,370 | (61,240)           | (0.00)        |
| Bought ZAR Sold USD at 0.053604 16/05/2023    | 5,977,188  | (62,495)           | (0.01)        |
| Bought USD Sold EUR at 1.082347 16/05/2023    | 3,376,545  | (69,135)           | (0.01)        |
| Bought USD Sold ILS at 0.272650 16/05/2023    | 6,974,312  | (73,492)           | (0.01)        |
| Bought CLP Sold USD at 798.740000 16/05/2023  | 11,723,005 | (106,763)          | (0.01)        |
| Bought USD Sold CLP at 0.001222 16/05/2023    | 7,208,202  | (108,675)          | (0.01)        |
| Bought CNY Sold USD at 6.850390 16/05/2023    | 12,036,357 | (111,434)          | (0.01)        |
| Bought USD Sold EUR at 1.068127 16/05/2023    | 3,543,268  | (111,479)          | (0.01)        |
| Bought TWD Sold USD at 30.365000 16/05/2023   | 12,097,652 | (131,997)          | (0.01)        |
| Bought KRW Sold USD at 1318.770000 16/05/2023 | 11,930,312 | (163,475)          | (0.01)        |
| Bought USD Sold COP at 0.000203 16/05/2023    | 7,159,468  | (217,822)          | (0.02)        |
| Bought USD Sold PLN at 0.223274 16/05/2023    | 3,584,746  | (250,920)          | (0.02)        |
| Bought USD Sold HUF at 0.002734 16/05/2023    | 3,504,361  | (252,920)          | (0.02)        |
| Bought USD Sold ZAR at 0.053487 16/05/2023    | 13,627,781 | (273,733)          | (0.02)        |
| Bought USD Sold PLN at 0.221149 16/05/2023    | 5,799,143  | (306,594)          | (0.03)        |
| Bought USD Sold HUF at 0.002676 16/05/2023    | 3,757,101  | (342,544)          | (0.03)        |
| Bought USD Sold MXN at 0.052713 16/05/2023    | 7,226,322  | (347,640)          | (0.03)        |
| Bought USD Sold MXN at 0.052733 16/05/2023    | 7,403,153  | (353,546)          | (0.03)        |
| Bought USD Sold PLN at 0.223035 16/05/2023    | 5,290,863  | (385,502)          | (0.03)        |
| Bought KRW Sold USD at 1297.220000 16/05/2023 | 13,924,198 | (411,513)          | (0.04)        |
| Bought ZAR Sold USD at 0.053983 16/05/2023    | 14,126,206 | (498,477)          | (0.04)        |
| Bought USD Sold EUR at 1.079536 16/05/2023    | 24,890,968 | (572,969)          | (0.05)        |
| Bought ILS Sold USD at 0.352240 16/05/2023    | 21,477,625 | (631,189)          | (0.05)        |
| Bought USD Sold BRL at 0.190345 16/05/2023    | 24,977,832 | (651,282)          | (0.05)        |
| Bought USD Sold EUR at 1.081562 16/05/2023    | 74,482,604 | (1,521,448)        | (0.14)        |
|   |            | <b>(5,627,420)</b> | <b>(0.31)</b> |

A Shares (EUR) (hedged)

|  |           |               |             |
|--|-----------|---------------|-------------|
| Bought EUR Sold USD at 0.917730 09/05/2023 | 4,595,687 | 62,593        | 0.01        |
| Bought EUR Sold USD at 0.906125 07/06/2023 | 4,418,152 | 11,532        | 0.00        |
| Bought EUR Sold EUR at 1.096499 09/05/2023 | 105,478   | (87)          | (0.00)      |
| Bought USD Sold EUR at 1.092452 09/05/2023 | 75,878    | (827)         | (0.00)      |
| Bought USD Sold EUR at 1.101805 09/05/2023 | 4,476,923 | (10,866)      | (0.00)      |
|  |           | <b>61,512</b> | <b>0.01</b> |

A-ACC Shares (EUR) (hedged)

|  |            |                |             |
|--|------------|----------------|-------------|
| Bought EUR Sold USD at 0.917722 09/05/2023 | 42,610,196 | 579,948        | 0.05        |
| Bought EUR Sold USD at 0.906129 07/06/2023 | 45,500,637 | 111,752        | 0.01        |
| Bought EUR Sold USD at 0.911973 09/05/2023 | 700,130    | 5,084          | 0.00        |
| Bought USD Sold EUR at 1.099107 09/05/2023 | 708,638    | (3,451)        | (0.00)      |
| Bought USD Sold EUR at 1.101805 09/05/2023 | 45,186,720 | (164,919)      | (0.01)      |
|  |            | <b>588,514</b> | <b>0.05</b> |

A-ACC Shares (HUF) (hedged)

|  |           |         |      |
|--|-----------|---------|------|
| Bought HUF Sold USD at 354.187500 09/05/2023 | 3,188,420 | 147,009 | 0.01 |
| Bought HUF Sold USD at 343.760600 07/06/2023 | 3,385,238 | 18,796  | 0.00 |

|  | 契約額等 USD | 未実現 (損 % Net Assets) | (益 (米ドル)) |
|--|----------|----------------------|-----------|
|--|----------|----------------------|-----------|

|  |           |                |             |
|--|-----------|----------------|-------------|
| Bought HUF Sold USD at 347.364514 09/05/2023 | 59,683    | 1,549          | 0.00        |
| Bought USD Sold HUF at 0.002935 09/05/2023   | 3,396,661 | (20,808)       | (0.00)      |
|  |           | <b>146,546</b> | <b>0.01</b> |

A-ACC Shares (SEK) (hedged)

|   |           |               |             |
|---|-----------|---------------|-------------|
| Bought SEK Sold USD at 10.351912 07/06/2023 | 1,716,523 | 18,007        | 0.00        |
| Bought SEK Sold USD at 10.328631 09/05/2023 | 1,727,025 | 14,785        | 0.00        |
| Bought SEK Sold USD at 10.364918 09/05/2023 | 33,254    | 337           | 0.00        |
| Bought USD Sold SEK at 0.096790 09/05/2023  | 35,807    | (314)         | (0.00)      |
| Bought USD Sold SEK at 0.096644 09/05/2023  | 1,739,574 | (17,865)      | (0.00)      |
|   |           | <b>14,950</b> | <b>0.00</b> |

A-HMDSIT (G) Shares (PLN) (hedged)

|  |           |                |             |
|--|-----------|----------------|-------------|
| Bought PLN Sold USD at 4.300779 09/05/2023 | 8,447,028 | 296,087        | 0.03        |
| Bought USD Sold PLN at 4.171616 07/06/2023 | 8,795,254 | 19,337         | 0.00        |
| Bought USD Sold PLN at 0.240122 09/05/2023 | 8,743,115 | (19,753)       | (0.00)      |
|  |           | <b>295,871</b> | <b>0.03</b> |

A-MDSIT Shares (AUD) (hedged)

|  |           |                 |               |
|--|-----------|-----------------|---------------|
| Bought AUD Sold USD at 1.513572 07/06/2023 | 2,005,962 | 6,487           | 0.00          |
| Bought USD Sold AUD at 0.659774 09/05/2023 | 2,007,817 | (6,458)         | (0.00)        |
| Bought AUD Sold USD at 1.495410 09/05/2023 | 2,028,474 | (20,657)        | (0.00)        |
|  |           | <b>(20,628)</b> | <b>(0.00)</b> |

E-ACC Shares (EUR) (hedged)

|  |         |              |             |
|--|---------|--------------|-------------|
| Bought EUR Sold USD at 0.917722 09/05/2023 | 598,547 | 8,147        | 0.00        |
| Bought EUR Sold USD at 0.906598 07/06/2023 | 588,685 | 1,817        | 0.00        |
| Bought EUR Sold USD at 0.913320 09/05/2023 | 11,497  | 101          | 0.00        |
| Bought USD Sold EUR at 1.103983 09/05/2023 | 22,311  | (10)         | (0.00)      |
| Bought USD Sold EUR at 1.101236 09/05/2023 | 595,981 | (1,754)      | (0.00)      |
|  |         | <b>8,301</b> | <b>0.00</b> |

E-MDSIT Shares (EUR) (hedged)

|  |            |                |             |
|--|------------|----------------|-------------|
| Bought EUR Sold USD at 0.916051 09/05/2023 | 28,949,691 | 540,610        | 0.03        |
| Bought EUR Sold USD at 0.906567 07/06/2023 | 28,211,650 | 79,886         | 0.01        |
| Bought USD Sold EUR at 1.098454 09/05/2023 | 448,200    | (2,448)        | (0.00)      |
| Bought USD Sold EUR at 1.096524 09/05/2023 | 448,642    | (3,254)        | (0.00)      |
| Bought USD Sold EUR at 1.101515 09/05/2023 | 28,395,458 | (76,584)       | (0.01)      |
|  |            | <b>358,450</b> | <b>0.03</b> |

I-ACC Shares (EUR) (hedged)

|  |            |                |             |
|--|------------|----------------|-------------|
| Bought EUR Sold USD at 0.916029 09/05/2023 | 33,323,633 | 391,238        | 0.03        |
| Bought EUR Sold USD at 0.906746 07/06/2023 | 33,879,729 | 110,145        | 0.01        |
| Bought EUR Sold USD at 0.911973 09/05/2023 | 548,701    | 5,984          | 0.00        |
| Bought USD Sold EUR at 1.096949 09/05/2023 | 629,115    | (4,293)        | (0.00)      |
| Bought USD Sold EUR at 1.101033 09/05/2023 | 33,658,440 | (104,550)      | (0.01)      |
|  |            | <b>396,524</b> | <b>0.03</b> |

Y-ACC Shares (EUR) (hedged)

|  |            |                |             |
|--|------------|----------------|-------------|
| Bought EUR Sold USD at 0.917751 09/05/2023 | 27,340,200 | 373,005        | 0.03        |
| Bought EUR Sold USD at 0.906598 07/06/2023 | 27,937,091 | 86,246         | 0.01        |
| Bought EUR Sold USD at 0.911973 09/05/2023 | 455,825    | 3,510          | 0.00        |
| Bought USD Sold EUR at 1.101236 09/05/2023 | 28,172,340 | (82,906)       | (0.01)      |
|  |            | <b>379,653</b> | <b>0.03</b> |

Y-ODISIT Shares (EUR) (hedged)

|  |            |                  |             |
|--|------------|------------------|-------------|
| Bought EUR Sold USD at 0.917751 09/05/2023 | 84,819,726 | 1,157,205        | 0.10        |
| Bought EUR Sold USD at 0.906598 07/06/2023 | 86,178,146 | 266,045          | 0.02        |
| Bought EUR Sold USD at 0.911973 09/05/2023 | 1,397,500  | 10,146           | 0.00        |
| Bought USD Sold EUR at 1.096949 09/05/2023 | 1,356,977  | (9,253)          | (0.00)      |
| Bought USD Sold EUR at 1.101236 09/05/2023 | 86,028,399 | (253,166)        | (0.02)      |
|  |            | <b>1,170,977</b> | <b>0.10</b> |

| 契約額等 USD | 未実現 (損 % Net Assets) | (益 (米ドル)) |
|----------|----------------------|-----------|
|----------|----------------------|-----------|

Ccy

先物取引

|   |     |              |                  |             |
|---|-----|--------------|------------------|-------------|
| US Ultra Bond Future 21/06/2023         | USD | 123,527,291  | 5,963,913        | 0.51        |
| US Long Bond Future 21/06/2023          | USD | 29,282,668   | 431,027          | 0.04        |
| US 10 Year Ultra Bond Future 21/06/2023 | USD | (720)        | 41,299,608       | 0.02        |
| US 5 Year Bond Future 30/06/2023        | USD | 45,401,950   | 158,844          | 0.01        |
| US 2 Year Bond Future 30/06/2023        | USD | 45,421,904   | 90,778           | 0.01        |
| Euro-Bobl Bond Future 08/06/2023        | EUR | 1,332,269    | 7,117            | 0.00        |
| US 10 Year Note Bond Future 21/06/2023  | USD | 27,890,006   | (10,514)         | (0.00)      |
| Euro-Schatts Bond Future 08/06/2023     | EUR | (3,480,803)  | (36,546)         | (0.00)      |
| Euro-Bond Future 08/06/2023             | EUR | (58,940,340) | (2,038,421)      | (0.18)      |
|   |     |              | <b>4,793,979</b> | <b>0.41</b> |

その他資産 (負債控除後)

|  |  |  |            |      |
|--|--|--|------------|------|
|  |  |  | 18,518,868 | 1.58 |
|--|--|--|------------|------|

Net Assets

|  |                      |               |
|--|----------------------|---------------|
|  | <b>1,161,536,921</b> | <b>100.00</b> |
|--|----------------------|---------------|

## フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド (適格機関投資家専用)の運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|             |  |
|-------------|--|
| 設 定 形 態     | 国内証券投資信託   |
| 運 用 方 針     | マザーファンド受益証券への投資を通じて、米ドル建ての高利回り社債(ハイ・イールド債券)を主要な投資対象とし、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的に積極的な運用を行うことを基本とします。  |
| 主 な 投 資 対 象 | フィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。  |
| 主 な 投 資 制 限 | <ul style="list-style-type: none"> <li>●公社債の実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>●株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以内とします。</li> <li>●新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以内とします。</li> <li>●外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</li> <li>●同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。</li> <li>●同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。</li> <li>●同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。</li> <li>●マザーファンド受益証券以外への投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。</li> </ul> |
| 決 算 日       | 毎月22日  |
| 分 配 方 針     | <ul style="list-style-type: none"> <li>●分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</li> <li>●収益分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。</li> <li>●留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</li> </ul>   |

## ■ 損益の状況

第200期 自2022年11月23日 至2022年12月22日 第203期 自2023年2月23日 至2023年3月22日  
 第201期 自2022年12月23日 至2023年1月23日 第204期 自2023年3月23日 至2023年4月24日  
 第202期 自2023年1月24日 至2023年2月22日 第205期 自2023年4月25日 至2023年5月22日

| 項 目                      | 第200期                         | 第201期                         | 第202期                          | 第203期                          | 第204期                          | 第205期                          |
|--------------------------|-------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| (A) 有価証券売買損益             | △879,629,471円                 | △1,474,814円                   | 364,635,671円                   | △224,866,697円                  | 486,326,772円                   | 314,257,504円                   |
| 売 益                      | 111,127                       | 1,457,126                     | 364,635,671                    | 3,272,601                      | 486,400,142                    | 318,349,807                    |
| 売 損                      | △879,740,598                  | △2,931,940                    | —                              | △228,139,298                   | △73,370                        | △4,092,303                     |
| (B) 信託報酬                 | △11,467,336                   | △11,729,073                   | △11,231,663                    | △10,677,687                    | △12,345,700                    | △9,515,980                     |
| (C) 当期損益金(A+B)           | △891,096,807                  | △13,203,887                   | 353,404,008                    | △235,544,384                   | 473,981,072                    | 304,741,524                    |
| (D) 前期繰越損益金              | 1,134,437,804                 | 167,363,565                   | 84,059,628                     | 365,894,716                    | 22,030,421                     | 374,934,451                    |
| (E) 追加信託差損益金<br>(配当等相当額) | △4,494,430,360<br>(3,936,169) | △4,490,854,682<br>(3,933,037) | △4,571,663,262<br>(33,600,069) | △4,572,215,911<br>(35,110,016) | △4,566,406,865<br>(35,079,947) | △4,481,204,043<br>(34,425,404) |
| (売買損益相当額)                | (△4,498,366,529)              | (△4,494,787,719)              | (△4,605,263,331)               | (△4,607,325,927)               | (△4,601,486,812)               | (△4,515,629,447)               |
| (F) 合 計(C+D+E)           | △4,251,089,363                | △4,336,695,004                | △4,134,199,626                 | △4,441,865,579                 | △4,070,395,372                 | △3,801,528,068                 |
| (G) 収益分配金                | △75,844,175                   | △70,100,050                   | △71,538,894                    | △108,291,885                   | △113,948,272                   | △108,031,584                   |
| 次期繰越損益金(F+G)             | △4,326,933,538                | △4,406,795,054                | △4,205,738,520                 | △4,550,157,464                 | △4,184,343,644                 | △3,909,559,652                 |
| 追加信託差損益金<br>(配当等相当額)     | △4,494,430,360<br>(3,936,169) | △4,490,854,682<br>(3,933,037) | △4,571,663,262<br>(34,762,049) | △4,572,215,911<br>(35,124,573) | △4,566,406,865<br>(35,079,947) | △4,481,204,043<br>(34,425,404) |
| (売買損益相当額)                | (△4,498,366,529)              | (△4,494,787,719)              | (△4,606,425,311)               | (△4,607,340,484)               | (△4,601,486,812)               | (△4,515,629,447)               |
| 分配準備積立金                  | 1,445,224,885                 | 1,441,515,305                 | 1,443,932,803                  | 1,412,744,285                  | 1,381,683,042                  | 1,321,704,346                  |
| 繰越損益金                    | △1,277,728,063                | △1,357,455,677                | △1,078,008,061                 | △1,390,685,838                 | △999,619,821                   | △750,059,955                   |

(注1) (A) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (B) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (E) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 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、純資産総額に対して年0.33%以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程は以下の通りです。

|                                  | 第200期          | 第201期          | 第202期          | 第203期          | 第204期          | 第205期          |
|----------------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (a) 費用控除後の配当等収益                  | 61,977,219円    | 67,540,262円    | 73,956,392円    | 77,221,853円    | 84,681,935円    | 73,833,178円    |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の<br>有価証券売買等損益 | 0円             | 0円             | 0円             | 0円             | 0円             | 0円             |
| (c) 収益調整金                        | 3,936,169円     | 3,933,037円     | 34,762,049円    | 35,124,573円    | 35,079,947円    | 34,425,404円    |
| (d) 分配準備積立金                      | 1,459,091,841円 | 1,444,075,093円 | 1,441,515,305円 | 1,443,814,317円 | 1,410,949,379円 | 1,355,902,752円 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d)               | 1,525,005,229円 | 1,515,548,392円 | 1,550,233,746円 | 1,556,160,743円 | 1,530,711,261円 | 1,464,161,334円 |
| 1万口当たり分配可能額                      | 804.28円        | 799.93円        | 801.78円        | 804.72円        | 792.57円        | 772.53円        |
| (f) 分配金額                         | 75,844,175円    | 70,100,050円    | 71,538,894円    | 108,291,885円   | 113,948,272円   | 108,031,584円   |
| 1万口当たり分配金額(税引前)                  | 40円            | 37円            | 37円            | 56円            | 59円            | 57円            |

## ■ 組入資産の明細 (2023年5月22日現在)

### ● 親投資信託残高

|                          | 第 199 期 末 | 第 205 期 末 | 評 価 額      |
|--------------------------|-----------|-----------|------------|
|                          | 口 数       | 口 数       |            |
| フィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンド | 3,274,930 | 3,139,406 | 15,020,490 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

### <フィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンド>

ご参考として、フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド(適格機関投資家専用)の主たる投資対象であるフィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンドの情報を掲載いたします。

## ■組入資産の明細 (2023年5月22日現在)

### (1) 外国株式

上場、登録株式

| 銘柄                             | 期首(前期末)     |            | 当 期 末      |           | 業 種 等            |  |
|--------------------------------|-------------|------------|------------|-----------|------------------|--|
|                                | 株 数         | 株 数        | 評 価 額      |           |                  |  |
|                                |             |            | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |                  |  |
| (アメリカ・・・NASDAQ)                | 百株          | 百株         | 千アメリカ・ドル   | 千円        |                  |  |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC A   | 111.85      | —          | —          | —         | メディア・娯楽          |  |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP         | 2,013.32    | 1,652.45   | 13,421     | 1,848,367 | エネルギー            |  |
| FRONTIER COMMS PARENT INC      | 1,629.41    | 1,629.41   | 2,737      | 376,995   | 電気通信サービス         |  |
| NORTHEAST GROCERY INC PP       | 15,955.32   | 15,955.32  | 8,169      | 1,125,051 | 生活必需品流通・小売り      |  |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC      | 2,069.98    | 2,069.98   | 9,064      | 1,248,355 | 消費者サービス          |  |
| (アメリカ・・・ニューヨーク証券取引所)           |             |            |            |           |                  |  |
| SFL CORP LTD                   | 742.6       | —          | —          | —         | エネルギー            |  |
| VISTRA CORP                    | 4,869.3     | 3,812.3    | 9,343      | 1,286,848 | 公益事業             |  |
| DENBURY INC                    | 2,024.68    | 2,024.68   | 18,438     | 2,539,386 | エネルギー            |  |
| CALIFORNIA RES CORP            | 4,812.29    | 4,812.29   | 18,883     | 2,600,625 | エネルギー            |  |
| VALARIS LTD                    | 846.83      | —          | —          | —         | エネルギー            |  |
| SOUTHEASTERN GROCERS INC       | 10,482.76   | 10,482.76  | 25,745     | 3,545,692 | 一般消費財・サービス流通・小売り |  |
| PG&E CORP 5.5% PC 08/16/23     | 1,416       | 1,416      | 20,411     | 2,811,110 | エネルギー            |  |
| NOBLE CORP PLC                 | 214.96      | —          | —          | —         | エネルギー            |  |
| (アメリカ・・・OTC)                   |             |            |            |           |                  |  |
| MESQUITE ENERGY INC            | 1,867.42    | 1,867.42   | 10,121     | 1,393,921 | エネルギー            |  |
| EP ENERGY CORP                 | 5,665.55    | 5,665.55   | 3,308      | 455,671   | エネルギー            |  |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP PIPE    | 70.13       | —          | —          | —         | エネルギー            |  |
| SUPERIOR ENERGY SERVICES INC A | 906.42      | 906.42     | 6,160      | 848,484   | エネルギー            |  |
| INTELSAT SA/LUXEMBOURG         | 1,961.59    | 1,961.59   | 9,270      | 1,276,729 | 電気通信サービス         |  |
| NEW COTAI LLC / CAP P/P        | 49,669.43   | 49,669.43  | 4,370      | 601,961   | 金融サービス           |  |
| JONAH EGY LLC / JONAH EGY FIN  | 3,365.6     | 3,365.6    | 15,145     | 2,085,796 | エネルギー            |  |
| PURE WEST ENERGY               | 77.89       | 77.89      | 75         | 10,458    | エネルギー            |  |
| INTELSAT JACKSON CVR SER A RT  | 205.42      | 205.42     | 178        | 24,640    | 電気通信サービス         |  |
| INTELSAT JACKSON CVR SER B RT  | 205.42      | 205.42     | 659        | 90,840    | 電気通信サービス         |  |
| PURE WEST ENERGY CVR           | 46.94       | 46.94      | 0          | 0         | エネルギー            |  |
| 小 計                            | 株 数 、 金 額   | 111,231.11 | 107,826.87 | 175,507   | 24,170,938       |  |
|                                | 銘 柄 数 <比 率> | 24銘柄       | 19銘柄       | —         | <3.7%>           |  |
| 合 計                            | 株 数 、 金 額   | 111,231.11 | 107,826.87 | —         | 24,170,938       |  |
|                                | 銘 柄 数 <比 率> | 24銘柄       | 19銘柄       | —         | <3.7%>           |  |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。



## (2) 外国新株予約権証券

| 銘柄                             | 期首(前期末)  |         | 当 期 末     |             |           |
|--------------------------------|----------|---------|-----------|-------------|-----------|
|                                | 証 券 数    | 証 券 数   | 評 価 額     |             |           |
|                                |          |         | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |           |
| (アメリカ)                         | 証券       | 証券      | 千アメリカ・ドル  | 千円          |           |
| NOBLE CORP PLC TR 1 WT 2/04/28 | 72,804   | 72,804  | 1,649     | 227,101     |           |
| NOBLE CORP PLC TR2 WT 2/04/28  | 72,804   | 72,804  | 1,576     | 217,175     |           |
| DENBURY INC WT 09/18/25        | 313,027  | 313,027 | 19,251    | 2,651,356   |           |
| CALIFORNIA RES CRP WT 10/27/24 | 46,818   | 46,818  | 378       | 52,162      |           |
| 小 計                            | 証券数、金額   | 505,453 | 505,453   | 22,856      | 3,147,795 |
|                                | 銘柄数 <比率> | 4       | 4         | —           | <0.5%>    |
| 合 計                            | 証券数、金額   | 505,453 | 505,453   | —           | 3,147,795 |
|                                | 銘柄数 <比率> | 4       | 4         | —           | <0.5%>    |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する各国別評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (3) 公社債

### (A) 債券種類別開示

#### 外国(外貨建)公社債

| 区 分     | 当 期 末                 |                       |                   |           |                 |           |           |          |
|---------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|----------|
|         | 額面金額                  | 評 価 額                 |                   | 組入比率      | うちBB格<br>以下組入比率 | 残存期間別組入比率 |           |          |
|         |                       | 外貨建金額                 | 邦貨換算金額            |           |                 | 5年以上      | 2年以上      | 2年未満     |
| ア メ リ カ | 千アメリカ・ドル<br>4,418,093 | 千アメリカ・ドル<br>3,867,786 | 千円<br>532,671,595 | %<br>81.7 | %<br>72.3       | %<br>46.3 | %<br>31.4 | %<br>3.9 |
| 合 計     | —                     | —                     | 532,671,595       | 81.7      | 72.3            | 46.3      | 31.4      | 3.9      |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価については証券会社、価格情報会社等よりデータを入手しています。

### (B) 個別銘柄開示

#### 外国(外貨建)公社債

| 銘柄                                   | 当 期 末    |         |          |           |             |            |  |
|--------------------------------------|----------|---------|----------|-----------|-------------|------------|--|
|                                      | 種 類      | 利 率     | 額 面 金 額  | 評 価 額     |             | 償 還 年 月 日  |  |
|                                      |          |         |          | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |  |
| (アメリカ)                               |          | %       | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円          |            |  |
| MESQUITE 15% PIK CONV 7/23 PP        | 新株予約権付社債 | 15.0000 | 1,469    | 8,517     | 1,173,066   | 2023/07/31 |  |
| MESQUITE 15% PIK CONV 7/23 PP        | 新株予約権付社債 | 15.0000 | 2,536    | 14,701    | 2,024,751   | 2023/07/15 |  |
| DISH NETWK CV 2.375% 3/15/24         | 新株予約権付社債 | 2.3750  | 41,113   | 35,007    | 4,821,263   | 2024/03/15 |  |
| DISH NETWORK CO CV 0% 12/15/25       | 新株予約権付社債 | 0.0000  | 7,197    | 3,310     | 455,938     | 2025/12/15 |  |
| DISH NETWK CV 3.375% 8/26 144A       | 新株予約権付社債 | 3.3750  | 51,366   | 22,986    | 3,165,671   | 2026/08/15 |  |
| NEW COTAI LLC CONV 5% 2/24/27        | 新株予約権付社債 | 5.0000  | 5,950    | 13,890    | 1,913,035   | 2027/02/24 |  |
| ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18 Escrow | 社債券      | 0.0000  | 6,605    | 0         | 0           | 2024/04/15 |  |
| WP ROCKET MRGR 10.125 7/19 144       | 社債券      | 0.0000  | 6,530    | 0         | 0           | 2023/07/15 |  |
| RURAL/METRO C 10.125 7/19 144A       | 社債券      | 0.0000  | 4,985    | 0         | 0           | 2023/07/15 |  |
| WALTER ENERGY 9.5% 10/19 144A        | 社債券      | 0.0000  | 13,820   | 0         | 0           | 2049/12/31 |  |

| 銘柄                                  | 当期末 |         |          |          |           |            |
|-------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
|                                     | 種類  | 利率      | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                                     |     |         |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                              |     | %       | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| CSC HLDGS LLC 4.625% 12/01/30 144A  | 社債券 | 4.6250  | 12,335   | 5,494    | 756,668   | 2030/12/01 |
| TOPS MARKETS CORP ESCROW            | 社債券 | 0.0000  | 20,640   | 0        | 0         | 2049/12/31 |
| HERTZ CORP 6.25% 10/15/22           | 社債券 | 0.0000  | 5,980    | 7        | 1,029     | 2049/12/31 |
| INTELSAT J H SA 5.5% 08/01/23       | 社債券 | 0.0000  | 17,015   | 0        | 0         | 2023/08/01 |
| AVOLON HLDGS 3.95% 7/24 144A        | 社債券 | 3.9500  | 25       | 24       | 3,330     | 2024/07/01 |
| CITGO HLDG INC 9.25% 08/01/24 144A  | 社債券 | 9.2500  | 6,335    | 6,342    | 873,546   | 2024/08/01 |
| OCCIDENTAL PETE 6.95% 07/01/24      | 社債券 | 6.9500  | 2,847    | 2,882    | 396,989   | 2024/07/01 |
| NEXTERA ENERGY 4.25% 9/24 144A      | 社債券 | 4.2500  | 601      | 576      | 79,458    | 2024/09/15 |
| INTELSAT JACKS 8.5% 10/24 144A      | 社債券 | 0.0000  | 3,835    | 0        | 0         | 2024/10/15 |
| HERTZ 5.5% 10/15/24 144A            | 社債券 | 0.0000  | 6,520    | 146      | 20,203    | 2024/10/15 |
| CARLYLE AVIAT 7% 10/15/24 144A      | 社債券 | 7.0000  | 9,835    | 8,550    | 1,177,540 | 2024/10/15 |
| WOLVERINE 8.5% 11/24 144A           | 社債券 | 8.5000  | 3,747    | 168      | 23,221    | 2024/11/15 |
| NABORS IND 5.75% 02/01/25           | 社債券 | 5.7500  | 8,875    | 8,455    | 1,164,451 | 2025/02/01 |
| EG GLOBAL FINANCE PLC 6.75% 02      | 社債券 | 6.7500  | 22,823   | 21,530   | 2,965,247 | 2025/02/07 |
| CVR ENERGY 5.25% 2/15/25 144A       | 社債券 | 5.2500  | 11,525   | 10,922   | 1,504,227 | 2025/02/15 |
| SPRINGLEAF FIN 6.875% 3/15/25       | 社債券 | 6.8750  | 6,965    | 6,725    | 926,241   | 2025/03/15 |
| SYMANTEC CORP 5% 04/25 144A         | 社債券 | 5.0000  | 6,265    | 6,139    | 845,524   | 2025/04/15 |
| CHOBANI 7.5% 04/15/25 144A          | 社債券 | 7.5000  | 2,345    | 2,310    | 318,183   | 2025/04/15 |
| CRESTWOOD MID P/F 5.75% 4/1/25      | 社債券 | 5.7500  | 8,145    | 8,002    | 1,102,076 | 2025/04/01 |
| SABRE GLBL 9.25% 04/15/25 144A      | 社債券 | 9.2500  | 4,215    | 3,626    | 499,418   | 2025/04/15 |
| USIS MERGER 6.875% 05/25 144A       | 社債券 | 6.8750  | 11,205   | 11,044   | 1,521,100 | 2025/05/01 |
| SUGARHOUSE 5.875% 5/15/25 144A      | 社債券 | 5.8750  | 5,585    | 5,371    | 739,814   | 2025/05/15 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL 6.75      | 社債券 | 6.7500  | 7,465    | 7,511    | 1,034,495 | 2025/05/01 |
| VIKING CRUIS 13% 05/15/25 144A      | 社債券 | 13.0000 | 4,665    | 4,898    | 674,638   | 2025/05/15 |
| UBER TECH 7.5% 05/15/25 144A        | 社債券 | 7.5000  | 10,860   | 10,994   | 1,514,095 | 2025/05/15 |
| ROYAL CARI 11.5% 06/01/25 144A      | 社債券 | 11.5000 | 2,795    | 2,952    | 406,579   | 2025/06/01 |
| PBF HLDG / FIN 7.25% 06/15/25       | 社債券 | 7.2500  | 29,085   | 28,913   | 3,981,913 | 2025/06/15 |
| CITGO PETE COR 7% 6/15/25 144A      | 社債券 | 7.0000  | 12,675   | 12,527   | 1,725,229 | 2025/06/15 |
| FORD MTR CR 5.125% 6/16/25          | 社債券 | 5.1250  | 16,150   | 15,656   | 2,156,207 | 2025/06/16 |
| VICI PPTY LP 4.625% 06/25 RGS       | 社債券 | 4.6250  | 10,630   | 10,289   | 1,417,102 | 2025/06/15 |
| BRAND ENERGY 8.5% 7/25 144A         | 社債券 | 8.5000  | 27,100   | 24,933   | 3,433,784 | 2025/07/15 |
| SP FINCO LLC 6.75% 7/1/25 144A      | 社債券 | 6.7500  | 1,367    | 1,360    | 187,393   | 2025/07/01 |
| NAVIOS LOG/FI 10.75% 7/25 144A      | 社債券 | 10.7500 | 10,515   | 10,350   | 1,425,491 | 2025/07/01 |
| DPL INC 4.125% 07/01/25             | 社債券 | 4.1250  | 17,145   | 16,244   | 2,237,245 | 2025/07/01 |
| WESTERN GLO 10.375% 8/25 144A       | 社債券 | 10.3750 | 5,625    | 548      | 75,530    | 2025/08/15 |
| SPIRIT LOYALT 8% 09/20/25 144A      | 社債券 | 8.0000  | 3,763    | 3,801    | 523,604   | 2025/09/20 |
| OCCIDENTAL PETE 5.875% 9/01/25      | 社債券 | 5.8750  | 3,520    | 3,524    | 485,380   | 2025/09/01 |
| NEW FORTRESS EN 6.75% 09/15/25      | 社債券 | 6.7500  | 14,790   | 13,733   | 1,891,384 | 2025/09/15 |
| SABRE GLBL INC 7.375% 09/01/25 144A | 社債券 | 7.3750  | 5,275    | 4,299    | 592,090   | 2025/09/01 |
| SPIRIT LOYALT 8% 09/20/25 144A      | 社債券 | 8.0000  | 18,260   | 18,416   | 2,536,268 | 2025/09/20 |
| EG GLOBAL 8.5% 10/30/25 144A        | 社債券 | 8.5000  | 11,282   | 10,655   | 1,467,492 | 2025/10/30 |
| NEW HOME CO 7.25% 10/15/25 144A     | 社債券 | 7.2500  | 3,440    | 3,182    | 438,225   | 2025/10/15 |
| CANPACK SA 3.125% 11/01/25 144A     | 社債券 | 3.1250  | 3,435    | 3,052    | 420,439   | 2025/11/01 |
| ACRISURE LLC 7% 11/15/25 144A       | 社債券 | 7.0000  | 25,675   | 24,335   | 3,351,454 | 2025/11/15 |
| KLX ENERGY 11.5% 11/1/25 144A       | 社債券 | 11.5000 | 8,250    | 7,815    | 1,076,415 | 2025/11/01 |
| ICAHN LP/FN COR 6.375% 12/15/2      | 社債券 | 6.3750  | 13,815   | 12,606   | 1,736,124 | 2025/12/15 |
| RP ESCROW ISS 5.25% 12/15/25 144A   | 社債券 | 5.2500  | 4,700    | 3,151    | 434,029   | 2025/12/15 |
| ENVIVA PT LP 6.5% 1/15/26 144A      | 社債券 | 6.5000  | 14,850   | 11,434   | 1,574,759 | 2026/01/15 |

| 銘柄                                  | 当期末 |         |          |          |           |            |
|-------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
|                                     | 種類  | 利率      | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                                     |     |         |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                              |     | %       | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| LEGENDS HOSPITAL 5% 02/01/26 144A   | 社債券 | 5.0000  | 2,985    | 2,664    | 366,901   | 2026/02/01 |
| NGL ENERGY OP 7.5% 02/01/26 144A    | 社債券 | 7.5000  | 9,740    | 9,312    | 1,282,505 | 2026/02/01 |
| CALIFORNIA 7.125% 02/01/26 144A     | 社債券 | 7.1250  | 8,730    | 8,904    | 1,226,341 | 2026/02/01 |
| FIRST QUANTUM 6.875% 3/26 144A      | 社債券 | 6.8750  | 27,200   | 26,264   | 3,617,197 | 2026/03/01 |
| SPRINGLEAF FIN CRP 7.125% 3/26      | 社債券 | 7.1250  | 9,765    | 9,333    | 1,285,367 | 2026/03/15 |
| CHS/CMNTY HEALTH 8% 3/26 144A       | 社債券 | 8.0000  | 14,330   | 13,679   | 1,883,949 | 2026/03/15 |
| OCCIDENTAL PETE 5.55% 03/15/26      | 社債券 | 5.5500  | 6,554    | 6,529    | 899,277   | 2026/03/15 |
| NCL CORP LTD 5.875 03/15/26 144A    | 社債券 | 5.8750  | 1,680    | 1,496    | 206,124   | 2026/03/15 |
| MATTEL INC 3.375% 04/01/26 144A     | 社債券 | 3.3750  | 1,685    | 1,562    | 215,194   | 2026/04/01 |
| FERRELLGAS/FG 5.375% 04/01/26 144A  | 社債券 | 5.3750  | 3,980    | 3,660    | 504,133   | 2026/04/01 |
| FORD MTR CR LLC 6.95% 03/06/26      | 社債券 | 6.9500  | 49,800   | 49,999   | 6,885,889 | 2026/03/06 |
| FORD MTR CR LLC 7.27403% 03/06/26   | 社債券 | 7.5260  | 5,860    | 5,862    | 807,426   | 2026/03/06 |
| USA COMPRESSIO 6.875% 04/01/26      | 社債券 | 6.8750  | 2,960    | 2,827    | 389,408   | 2026/04/01 |
| CORECIVIC INC 0% 04/30/26           | 社債券 | 8.2500  | 8,245    | 8,279    | 1,140,293 | 2026/04/15 |
| WASH MULT 5.75% 4/15/26 144A        | 社債券 | 5.7500  | 3,610    | 3,276    | 451,235   | 2026/04/15 |
| CEC ENT CO LLC 6.75% 5/26 144A      | 社債券 | 6.7500  | 6,950    | 6,633    | 913,507   | 2026/05/01 |
| TULLOW OI 10.25% 05/15/26 144A      | 社債券 | 10.2500 | 11,551   | 8,665    | 1,193,389 | 2026/05/15 |
| HUB INTEL LTD 7% 5/01/26 144A       | 社債券 | 7.0000  | 7,640    | 7,514    | 1,034,882 | 2026/05/01 |
| AVOLON HLD 4.375% 5/01/26 144A      | 社債券 | 4.3750  | 18       | 16       | 2,302     | 2026/05/01 |
| ICAHN LP/FN COR 6.25% 05/15/26      | 社債券 | 6.2500  | 9,980    | 8,900    | 1,225,813 | 2026/05/15 |
| BLOCK INC 2.75% 06/01/26            | 社債券 | 2.7500  | 5,755    | 5,146    | 708,810   | 2026/06/01 |
| CITGO PETROL 6.375% 06/26 144A      | 社債券 | 6.3750  | 6,045    | 5,901    | 812,745   | 2026/06/15 |
| BOBOMBARDIER 7.125% 06/26 144A      | 社債券 | 7.1250  | 7,380    | 7,273    | 1,001,768 | 2026/06/15 |
| ROYAL CARIBBEAN 4.25% 07/01/26 144A | 社債券 | 4.2500  | 9,705    | 8,949    | 1,232,547 | 2026/07/01 |
| BERRY GBL ES 4.875% 7/26 144A       | 社債券 | 4.8750  | 3,655    | 3,547    | 488,628   | 2026/07/15 |
| GEMS MENAS 7.125% 7/31/26 144A      | 社債券 | 7.1250  | 21,875   | 21,287   | 2,931,766 | 2026/07/31 |
| AIR CANADA 3.875% 08/15/26 144A     | 社債券 | 3.8750  | 4,620    | 4,276    | 588,966   | 2026/08/15 |
| TRIVIUM PACKING 5.5% 8/26 144A      | 社債券 | 5.5000  | 3,670    | 3,483    | 479,801   | 2026/08/15 |
| HERTZ CORP 7.125% 08/01/2026 1      | 社債券 | 0.0000  | 8,230    | 658      | 90,674    | 2026/08/01 |
| ACRISURE 10.125% 08/01/26 144A      | 社債券 | 10.1250 | 5,055    | 5,115    | 704,514   | 2026/08/01 |
| ROYAL CARIBBEAN 5.5% 08/31/26       | 社債券 | 5.5000  | 9,590    | 9,043    | 1,245,466 | 2026/08/31 |
| DIAMOND SPORT 5.375% 08/15/26       | 社債券 | 0.0000  | 6,430    | 349      | 48,146    | 2026/08/15 |
| STRATHCONA RE 6.875% 8/26 144A      | 社債券 | 6.8750  | 4,835    | 4,013    | 552,723   | 2026/08/01 |
| SM ENERGY CO 6.75% 09/15/26         | 社債券 | 6.7500  | 3,640    | 3,537    | 487,134   | 2026/09/15 |
| RADIATE HOLDC 4.5% 9/15/26 144A     | 社債券 | 4.5000  | 14,100   | 11,167   | 1,537,927 | 2026/09/15 |
| SBP LLC/C 6.375% 09/30/26 144A      | 社債券 | 6.3750  | 2,480    | 2,200    | 303,060   | 2026/09/30 |
| IMS HEALTH 5% 10/15/26 144A         | 社債券 | 5.0000  | 5,060    | 4,931    | 679,204   | 2026/10/15 |
| KEHE DISTRS LLC / KEHE FIN COR      | 社債券 | 8.6250  | 4,048    | 4,058    | 558,884   | 2026/10/15 |
| GANNETT HOLDING 6% 11/01/26 144A    | 社債券 | 6.0000  | 2,870    | 2,410    | 332,015   | 2026/11/01 |
| CAMELOT FIN SA 4.5% 11/26 144A      | 社債券 | 4.5000  | 5,440    | 5,102    | 702,769   | 2026/11/01 |
| KOBE US MID PIK VAR 11/26 144A      | 社債券 | 9.2500  | 12,375   | 8,476    | 1,167,435 | 2026/11/01 |
| HERTZ 4.625% 12/01/26 144A          | 社債券 | 4.6250  | 3,580    | 3,201    | 440,879   | 2026/12/01 |
| KRONOS ACQ K 5% 12/31/26 144A       | 社債券 | 5.0000  | 1,170    | 1,070    | 147,436   | 2026/12/31 |
| ZIGGO BOND 6% 1/15/27 144A          | 社債券 | 6.0000  | 5,985    | 5,587    | 769,540   | 2027/01/15 |
| SM ENERGY CO 6.625% 1/15/27         | 社債券 | 6.6250  | 5,695    | 5,481    | 754,903   | 2027/01/15 |
| ALBERTSONS 4.625% 1/15/27 144A      | 社債券 | 4.6250  | 10,543   | 9,994    | 1,376,420 | 2027/01/15 |
| VISTRA OP CO 5.625% 02/27 144A      | 社債券 | 5.6250  | 5,626    | 5,425    | 747,237   | 2027/02/15 |
| TENET HEALTHCARE 6.25% 2/1/27       | 社債券 | 6.2500  | 13,060   | 12,838   | 1,768,118 | 2027/02/01 |

| 銘柄                                    | 当期末 |         |          |          |           |            |
|---------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
|                                       | 種類  | 利率      | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                                       |     |         |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                                |     | %       | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| CENTURYLINK INC 4% 02/27 144A         | 社債券 | 4.0000  | 9,745    | 6,504    | 895,839   | 2027/02/15 |
| VICI PROPERT 3.75% 02/27 144A         | 社債券 | 3.7500  | 4,530    | 4,181    | 575,870   | 2027/02/15 |
| SBA COMMUNICATI 3.875% 02/27          | 社債券 | 3.8750  | 10,425   | 9,667    | 1,331,382 | 2027/02/15 |
| LINDBLAD E 6.75% 02/15/27 144A        | 社債券 | 6.7500  | 4,725    | 4,417    | 608,429   | 2027/02/15 |
| STUDIO CITY CO 7% 02/27 144A          | 社債券 | 7.0000  | 5,135    | 4,752    | 654,506   | 2027/02/15 |
| NCL CORP 5.875% 02/15/27 144A         | 社債券 | 5.8750  | 6,415    | 6,089    | 838,699   | 2027/02/15 |
| VICI PPTY LP 5.75% 02/01/27 RE        | 社債券 | 5.7500  | 6,005    | 5,889    | 811,072   | 2027/02/01 |
| TRANSDIGM INC 7.5% 03/15/27           | 社債券 | 7.5000  | 16,800   | 16,798   | 2,313,441 | 2027/03/15 |
| FRONT RANGE BID 4% 3/1/27 144A        | 社債券 | 4.0000  | 9,450    | 6,829    | 940,521   | 2027/03/01 |
| CHS/CMNTY HLT 5.625% 03/15/27 144A    | 社債券 | 5.6250  | 5,130    | 4,394    | 605,190   | 2027/03/15 |
| CARNIVAL COR 5.75% 3/1/27 144A        | 社債券 | 5.7500  | 11,865   | 10,098   | 1,390,770 | 2027/03/01 |
| BOMBARDIER 7.875% 04/27 144A          | 社債券 | 7.8750  | 13,585   | 13,511   | 1,860,767 | 2027/04/15 |
| SURGERY CTR 10% 04/15/27 144A         | 社債券 | 10.0000 | 3,269    | 3,345    | 460,691   | 2027/04/15 |
| SUNOCO LP /CORP 6% 04/15/27           | 社債券 | 6.0000  | 9,955    | 9,787    | 1,347,928 | 2027/04/15 |
| NORTHWEST FIN 4.75% 04/30/27 144A     | 社債券 | 4.7500  | 3,525    | 3,040    | 418,702   | 2027/04/30 |
| CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144         | 社債券 | 5.1250  | 19,140   | 17,874   | 2,461,723 | 2027/05/01 |
| CHEMOURS CO 5.375% 05/15/2027         | 社債券 | 5.3750  | 15,235   | 14,145   | 1,948,082 | 2027/05/15 |
| ALTICE FR 10.5% 5/15/27 144A          | 社債券 | 10.5000 | 12,170   | 8,318    | 1,145,665 | 2027/05/15 |
| ICAHN LP/FN COR 5.25% 05/15/27        | 社債券 | 5.2500  | 13,520   | 11,424   | 1,573,368 | 2027/05/15 |
| FORD MTR CR LLC 4.95% 05/28/27        | 社債券 | 4.9500  | 11,750   | 10,993   | 1,513,964 | 2027/05/28 |
| KFC CO/PIZZA 4.75% 6/1/27 144A        | 社債券 | 4.7500  | 7,630    | 7,413    | 1,021,055 | 2027/06/01 |
| ARD FIN SA 6.5% 06/30/27 144A         | 社債券 | 7.2500  | 5,830    | 4,592    | 632,450   | 2027/06/30 |
| UNIVISION 6.625% 06/01/27 144A        | 社債券 | 6.6250  | 10,585   | 10,042   | 1,383,055 | 2027/06/01 |
| WR GRACE 4.875% 06/15/27 144A         | 社債券 | 4.8750  | 6,725    | 6,304    | 868,281   | 2027/06/15 |
| BERRY GBL ES 5.625% 7/27 144A         | 社債券 | 5.6250  | 3,000    | 2,963    | 408,107   | 2027/07/15 |
| NEXSTAR 5.625% 7/15/27 144A           | 社債券 | 5.6250  | 6,745    | 6,272    | 863,896   | 2027/07/15 |
| SCRIPPS ESCRO 5.875% 7/27 144A        | 社債券 | 5.8750  | 4,310    | 3,266    | 449,869   | 2027/07/15 |
| CAESARS E 8.125% 07/01/27             | 社債券 | 8.1250  | 12,020   | 12,235   | 1,685,125 | 2027/07/01 |
| ROYAL CARI 5.375% 7/15/27 144A        | 社債券 | 5.3750  | 4,325    | 3,986    | 548,994   | 2027/07/15 |
| SIRIUS XM RADIO 5% 8/1/27 144A        | 社債券 | 5.0000  | 8,735    | 8,041    | 1,107,419 | 2027/08/01 |
| CARNIVAL CORP 9.875% 08/01/27 144A    | 社債券 | 9.8750  | 19,185   | 19,778   | 2,723,906 | 2027/08/01 |
| ALLEGIAN T 7.25% 8/15/27 144A         | 社債券 | 7.2500  | 3,405    | 3,385    | 466,296   | 2027/08/15 |
| ROYAL CARIBBEAN 11.625% 08/15/27 144A | 社債券 | 11.6250 | 17,750   | 19,174   | 2,640,679 | 2027/08/15 |
| OLYMPUS WATER 7.125% 10/01/27 144A    | 社債券 | 7.1250  | 3,440    | 3,308    | 455,668   | 2027/10/01 |
| C&W SR FIN 6.875% 9/15/27 144A        | 社債券 | 6.8750  | 20,380   | 17,501   | 2,410,282 | 2027/09/15 |
| ADVANCED DRAIN 5% 9/30/27 144A        | 社債券 | 5.0000  | 1,210    | 1,143    | 157,520   | 2027/09/30 |
| CABLEVS LT LLC 3.875% 9/15/27 144A    | 社債券 | 3.8750  | 2,645    | 2,207    | 303,990   | 2027/09/15 |
| FRONTIER COM 5.875% 10/15/27 144A     | 社債券 | 5.8750  | 5,005    | 4,480    | 617,037   | 2027/10/15 |
| UBER TECH I 7.5% 09/15/27 144A        | 社債券 | 7.5000  | 5,815    | 5,990    | 824,963   | 2027/09/15 |
| MPT OPER PARTNER 5% 10/15/27          | 社債券 | 5.0000  | 11,630   | 9,316    | 1,283,108 | 2027/10/15 |
| PERFORMANCE 5.5% 10/15/27 144A        | 社債券 | 5.5000  | 13,405   | 12,902   | 1,776,961 | 2027/10/15 |
| LIVE NATIN 4.75% 10/15/27 144A        | 社債券 | 4.7500  | 7,085    | 6,624    | 912,322   | 2027/10/15 |
| ALLIANT HLDG 6.75% 10/27 144A         | 社債券 | 6.7500  | 22,620   | 21,016   | 2,894,388 | 2027/10/15 |
| LCPR SR 6.75% 10/15/27 144A           | 社債券 | 6.7500  | 5,264    | 4,928    | 678,742   | 2027/10/15 |
| FIRST QUANT 6.875% 10/27 144A         | 社債券 | 6.8750  | 19,090   | 18,195   | 2,505,823 | 2027/10/15 |
| MINERAL RES LT 8% 11/1/27 144A        | 社債券 | 8.0000  | 6,125    | 6,169    | 849,633   | 2027/11/01 |
| TRANSDIGM INC 5.5% 11/15/27           | 社債券 | 5.5000  | 27,775   | 26,177   | 3,605,225 | 2027/11/15 |
| AVOLON HLDGS 2.528% 11/27 144A        | 社債券 | 2.5280  | 9,509    | 7,891    | 1,086,754 | 2027/11/18 |

| 銘柄                                   | 当期末 |         |          |          |           |            |
|--------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
|                                      | 種類  | 利率      | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                                      |     |         |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                               |     | %       | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| FORD MTR CR LLC 7.35% 11/04/27       | 社債券 | 7.3500  | 30,000   | 30,344   | 4,178,989 | 2027/11/04 |
| DISH NETWORK CO 11.75% 11/27 144A    | 社債券 | 11.7500 | 16,355   | 15,608   | 2,149,610 | 2027/11/15 |
| GO DADDY OP 5.25% 12/1/27 144A       | 社債券 | 5.2500  | 5,050    | 4,865    | 670,024   | 2027/12/01 |
| ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 5.8       | 社債券 | 5.8750  | 5,860    | 5,612    | 772,933   | 2027/12/01 |
| MOOG INC 4.25% 12/15/2027 144A       | 社債券 | 4.2500  | 1,720    | 1,608    | 221,486   | 2027/12/15 |
| TERRIER M 8.875% 12/15/27 144A       | 社債券 | 8.8750  | 7,700    | 5,116    | 704,686   | 2027/12/15 |
| AFFINTY GME 6.875% 12/15/27 144A     | 社債券 | 6.8750  | 1,930    | 1,698    | 233,903   | 2027/12/15 |
| KRONOS ACQ 7% 12/31/27 144A          | 社債券 | 7.0000  | 1,485    | 1,299    | 178,976   | 2027/12/31 |
| OPEN TEXT CO 6.9% 12/1/27 144A       | 社債券 | 6.9000  | 3,970    | 4,090    | 563,364   | 2027/12/01 |
| 1375209 BC LTD 9% 1/30/28 144A       | 社債券 | 9.0000  | 2,267    | 2,257    | 310,853   | 2028/01/30 |
| POST HLDGS 5.625% 01/28 144A         | 社債券 | 5.6250  | 13,375   | 12,914   | 1,778,603 | 2028/01/15 |
| ENDEAVOR ENERGY 5.75 1/28 144A       | 社債券 | 5.7500  | 11,850   | 11,761   | 1,619,742 | 2028/01/30 |
| ANTERO MIDS 5.75% 1/15/28 144A       | 社債券 | 5.7500  | 5,390    | 5,155    | 710,035   | 2028/01/15 |
| TAYLOR MORRISON CMNTY/ MONARCH       | 社債券 | 5.7500  | 7,155    | 6,922    | 953,361   | 2028/01/15 |
| ALTICE FRANCE SA 5.5% 01/15/20       | 社債券 | 5.5000  | 11,490   | 8,904    | 1,226,362 | 2028/01/15 |
| HERTZ CORP 6% 01/15/2028 144A        | 社債券 | 0.0000  | 8,095    | 475      | 65,497    | 2028/01/15 |
| ALTICE FING 5% 01/15/28 144A         | 社債券 | 5.0000  | 5,480    | 4,367    | 601,470   | 2028/01/15 |
| ALLEN MEDIA 10.5% 02/28 144A         | 社債券 | 10.5000 | 16,865   | 8,646    | 1,190,728 | 2028/02/15 |
| STUDIO CITY 6.5% 1/15/28 144A        | 社債券 | 6.5000  | 10,530   | 8,613    | 1,186,256 | 2028/01/15 |
| UBER TECH INC 6.25% 01/15/28 144A    | 社債券 | 6.2500  | 4,435    | 4,445    | 612,302   | 2028/01/15 |
| ASHTON WO 6.625% 01/15/28 144A       | 社債券 | 6.6250  | 85       | 79       | 10,895    | 2028/01/15 |
| ENLINK MID 5.625% 01/15/28 144A      | 社債券 | 5.6250  | 2,255    | 2,174    | 299,515   | 2028/01/15 |
| SEALED AIR 6.125% 2/1/28 144A        | 社債券 | 6.1250  | 6,375    | 6,313    | 869,501   | 2028/02/01 |
| CSC HLDGS LLC 5.375% 2/28 144A       | 社債券 | 5.3750  | 2,325    | 1,866    | 257,010   | 2028/02/01 |
| CVR ENERGY 5.75% 02/15/28 144A       | 社債券 | 5.7500  | 8,810    | 7,533    | 1,037,552 | 2028/02/15 |
| ALTICE FR HLDS 6% 2/15/28 144A       | 社債券 | 6.0000  | 6,000    | 3,360    | 462,739   | 2028/02/15 |
| PBF HLD LLC/FIN 6% 02/15/28          | 社債券 | 6.0000  | 20,275   | 18,962   | 2,611,501 | 2028/02/15 |
| CLEAR CHAN 7.75% 04/15/28 144A       | 社債券 | 7.7500  | 3,180    | 2,298    | 316,536   | 2028/04/15 |
| NTH OIL & GAS 8.125% 03/01/28 144A   | 社債券 | 8.1250  | 7,995    | 7,795    | 1,073,544 | 2028/03/01 |
| NORTHWEST FIN 6% 02/15/28 144A       | 社債券 | 6.0000  | 1,825    | 1,351    | 186,166   | 2028/02/15 |
| FORD MTR CR LLC 2.9% 02/16/28        | 社債券 | 2.9000  | 4,625    | 3,912    | 538,838   | 2028/02/16 |
| ADTALEM GLOBA 5.5% 03/01/28 144A     | 社債券 | 5.5000  | 10,160   | 9,550    | 1,315,281 | 2028/03/01 |
| BOMBARDIER INC 6% 02/28 144A         | 社債券 | 6.0000  | 7,710    | 7,234    | 996,306   | 2028/02/15 |
| TRANSOCEAN 8.375% 02/28 144A         | 社債券 | 8.3750  | 3,636    | 3,658    | 503,879   | 2028/02/01 |
| UNITI/FIN/CSL 10.5% 2/28 144A        | 社債券 | 10.5000 | 10,730   | 10,395   | 1,431,689 | 2028/02/15 |
| AMER AIR 7.25% 02/15/28 144A         | 社債券 | 7.2500  | 3,550    | 3,476    | 478,805   | 2028/02/15 |
| CLEARWY ENR 4.75% 3/15/28 144A       | 社債券 | 4.7500  | 3,445    | 3,238    | 446,011   | 2028/03/15 |
| FRONT RANGE BIDCO INC 6.125% 0       | 社債券 | 6.1250  | 5,210    | 3,282    | 452,031   | 2028/03/01 |
| ASBURY AUTOMOTI 4.5% 03/01/28        | 社債券 | 4.5000  | 1,668    | 1,534    | 211,362   | 2028/03/01 |
| NCL FINANCE LTD 6.125% 03/15/28 144A | 社債券 | 6.1250  | 2,075    | 1,727    | 237,902   | 2028/03/15 |
| SPA HOLDINGS 4.875% 2/28 144A        | 社債券 | 4.8750  | 3,985    | 3,376    | 465,076   | 2028/02/04 |
| RITCHIE BR 6.75% 03/15/28 144A       | 社債券 | 6.7500  | 10,000   | 10,207   | 1,405,708 | 2028/03/15 |
| CSC HOLDINGS 7.5% 4/1/28 144A        | 社債券 | 7.5000  | 20,300   | 11,884   | 1,636,668 | 2028/04/01 |
| CDW LLC / CDW F 4.25% 04/01/28       | 社債券 | 4.2500  | 7,050    | 6,536    | 900,155   | 2028/04/01 |
| ARCHROCK PR 6.25% 4/1/28 144A        | 社債券 | 6.2500  | 5,800    | 5,377    | 740,625   | 2028/04/01 |
| UNITI/FIN 4.75% 04/15/28 144A        | 社債券 | 4.7500  | 4,490    | 3,637    | 500,948   | 2028/04/15 |
| MAGIC MERG 5.25% 05/1/28 144A        | 社債券 | 5.2500  | 5,220    | 4,076    | 561,481   | 2028/05/01 |
| ORGANON F 4.125% 04/30/28 144A       | 社債券 | 4.1250  | 6,615    | 5,923    | 815,725   | 2028/04/30 |

| 銘柄                                   | 当期末 |         |          |          |           |            |
|--------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
|                                      | 種類  | 利率      | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                                      |     |         |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                               |     | %       | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| SCIH SALT 4.875% 05/01/28 144A       | 社債券 | 4.8750  | 15,660   | 14,062   | 1,936,690 | 2028/05/01 |
| ATLAS LUX 4.625% 06/01/28 144A       | 社債券 | 4.6250  | 3,000    | 2,536    | 349,260   | 2028/06/01 |
| ALLIANT HLDG/CO 6.75% 04/15/28       | 社債券 | 6.7500  | 14,035   | 13,803   | 1,901,065 | 2028/04/15 |
| ADIANT GLOBAL 7% 04/15/28 144A       | 社債券 | 7.0000  | 9,280    | 9,362    | 1,289,339 | 2028/04/15 |
| MACQUARIE 8.375% 05/01/28 144A       | 社債券 | 8.3750  | 5,665    | 5,619    | 773,895   | 2028/05/01 |
| CLARIOS GLBL LP 6.75% 4/28 144A      | 社債券 | 6.7500  | 20,000   | 20,125   | 2,771,615 | 2028/05/15 |
| CHARLES RIV 4.25% 5/1/28 144A        | 社債券 | 4.2500  | 1,765    | 1,621    | 223,265   | 2028/05/01 |
| ASGN INC 4.625% 05/15/28 144A        | 社債券 | 4.6250  | 13,835   | 12,486   | 1,719,583 | 2028/05/15 |
| NORTHWEST FIN 10.75% 06/01/28 144A   | 社債券 | 10.7500 | 2,995    | 2,665    | 367,099   | 2028/06/01 |
| MOLINA HEA 4.375% 6/15/28 144A       | 社債券 | 4.3750  | 3,800    | 3,492    | 480,940   | 2028/06/15 |
| FRONTIER COMM 5% 05/01/28 144A       | 社債券 | 5.0000  | 5,150    | 4,374    | 602,394   | 2028/05/01 |
| ATLANTICA SUS 4.125% 6/28 144A       | 社債券 | 4.1250  | 2,790    | 2,506    | 345,154   | 2028/06/15 |
| SRS DISTRIBUTIO 4.625% 07/01/28 144A | 社債券 | 4.6250  | 4,110    | 3,628    | 499,684   | 2028/07/01 |
| DELEK LOGISTIC 7.125% 06/01/28 144A  | 社債券 | 7.1250  | 3,425    | 3,073    | 423,257   | 2028/06/01 |
| CARNIVAL 10.375% 05/28 144A          | 社債券 | 10.3750 | 11,435   | 12,343   | 1,699,979 | 2028/05/01 |
| CORELOGIC INC 4.5% 5/1/28 144A       | 社債券 | 4.5000  | 11,980   | 9,658    | 1,330,220 | 2028/05/01 |
| LINDBLAD EXPEDI 9% 05/15/28 144A     | 社債券 | 9.0000  | 18,610   | 18,546   | 2,554,280 | 2028/05/15 |
| CSC HLDGS LLC 11.25% 5/28 144A       | 社債券 | 11.2500 | 9,780    | 9,573    | 1,318,508 | 2028/05/15 |
| HESS MIDST 5.125% 6/15/28 144A       | 社債券 | 5.1250  | 6,815    | 6,396    | 880,934   | 2028/06/15 |
| TRI POINTE GROUP 5.7% 06/15/28       | 社債券 | 5.7000  | 1,630    | 1,569    | 216,157   | 2028/06/15 |
| DANA INC 5.625% 6/15/28              | 社債券 | 5.6250  | 5,070    | 4,677    | 644,161   | 2028/06/15 |
| CVR PART LP/FIN 6.125% 06/15/28 144A | 社債券 | 6.1250  | 6,680    | 5,911    | 814,173   | 2028/06/15 |
| MICROSTRATEGY 6.125% 06/15/28        | 社債券 | 6.1250  | 24,345   | 21,083   | 2,903,552 | 2028/06/15 |
| SM ENERGY CO 6.5% 07/15/28           | 社債券 | 6.5000  | 2,040    | 1,920    | 264,443   | 2028/07/15 |
| MADISON IAQ 4.125% 06/28 144A        | 社債券 | 4.1250  | 3,975    | 3,434    | 472,974   | 2028/06/30 |
| GEO GRP INC/THE 10.5% 06/30/28       | 社債券 | 10.5000 | 5,706    | 5,748    | 791,724   | 2028/06/30 |
| LEVEL 3 FINANCI 4.25% 07/01/28       | 社債券 | 4.2500  | 7,065    | 4,251    | 585,468   | 2028/07/01 |
| PG&E CORP 5% 07/01/28                | 社債券 | 5.0000  | 7,060    | 6,520    | 897,941   | 2028/07/01 |
| AVANTOR FUNDING 4.625% 07/15/28 144A | 社債券 | 4.6250  | 7,015    | 6,512    | 896,942   | 2028/07/15 |
| GPC MERGER SU 7.125% 8/15/28 144A    | 社債券 | 7.1250  | 3,040    | 2,615    | 360,147   | 2028/08/15 |
| CARNIVAL CORP 4% 08/01/28 144A       | 社債券 | 4.0000  | 10,645   | 9,293    | 1,279,902 | 2028/08/01 |
| EMERGENT BIO 3.875% 08/15/30 144A    | 社債券 | 3.8750  | 3,110    | 1,648    | 227,003   | 2028/08/15 |
| WINDSTREA 7.75% 08/15/28 144A        | 社債券 | 7.7500  | 22,330   | 18,489   | 2,546,399 | 2028/08/15 |
| ON SEMICONDUCT 3.875% 09/01/28 144A  | 社債券 | 3.8750  | 6,575    | 6,012    | 827,997   | 2028/09/01 |
| PIKE CORP 5.5% 9/01/28 144A          | 社債券 | 5.5000  | 18,495   | 16,512   | 2,274,053 | 2028/09/01 |
| TREEHOUSE FOODS 4% 09/01/28          | 社債券 | 4.0000  | 1,800    | 1,561    | 215,049   | 2028/09/01 |
| TRANSDIGM INC 6.75% 8/28 144A        | 社債券 | 6.7500  | 29,660   | 29,955   | 4,125,459 | 2028/08/15 |
| HCA INC 5.625% 09/01/28              | 社債券 | 5.6250  | 8,770    | 8,832    | 1,216,440 | 2028/09/01 |
| HARVEST MIDSTRE 7.5% 9/28 144A       | 社債券 | 7.5000  | 12,085   | 11,498   | 1,583,525 | 2028/09/01 |
| BOOZ ALLEN 3.875% 9/01/28 144A       | 社債券 | 3.8750  | 5,080    | 4,560    | 628,060   | 2028/09/01 |
| BLACK KNIGHT 3.625% 09/28 144A       | 社債券 | 3.6250  | 5,650    | 5,077    | 699,333   | 2028/09/01 |
| TENET HEALTH 6.125% 10/28            | 社債券 | 6.1250  | 15,635   | 14,877   | 2,048,948 | 2028/10/01 |
| WEEKLEY HOMES L 4.875% 09/15/28      | 社債券 | 4.8750  | 2,460    | 2,189    | 301,490   | 2028/09/15 |
| RADIATE HOLDC 6.5% 9/15/28 144A      | 社債券 | 6.5000  | 10,430   | 5,370    | 739,598   | 2028/09/15 |
| ALTICE FRANCE 5.125% 01/15/29 144A   | 社債券 | 5.1250  | 4,690    | 3,415    | 470,394   | 2029/01/15 |
| CABLEVS LHT 5.625% 09/15/28 144A     | 社債券 | 5.6250  | 2,090    | 1,519    | 209,224   | 2028/09/15 |
| COINBASE GLOBAL 3.375% 10/01/28 144A | 社債券 | 3.3750  | 20,330   | 12,746   | 1,755,504 | 2028/10/01 |
| GRIFOLS ES 4.75% 10/15/28 144A       | 社債券 | 4.7500  | 2,255    | 1,928    | 265,527   | 2028/10/15 |

| 銘柄                                   | 当期  |         |          |          |           |            | 期末 |  |
|--------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|----|--|
|                                      | 種類  | 利率      | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |    |  |
|                                      |     |         |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |    |  |
| (アメリカ)                               |     | %       | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |    |  |
| BAUSCH HEALTH 11% 9/30/28 144A       | 社債券 | 11.0000 | 4,029    | 3,132    | 431,414   | 2028/09/30 |    |  |
| SEG HLD LLC 5.625% 10/15/28 144A     | 社債券 | 5.6250  | 5,080    | 4,800    | 661,138   | 2028/10/15 |    |  |
| UNITED NATURA 6.75% 10/15/28 144A    | 社債券 | 6.7500  | 3,695    | 3,491    | 480,861   | 2028/10/15 |    |  |
| CONSLIDATED COM 5% 10/28 144A        | 社債券 | 5.0000  | 2,990    | 2,182    | 300,601   | 2028/10/01 |    |  |
| CHENIERE ENER 4.625% 10/15/28        | 社債券 | 4.6250  | 6,660    | 6,290    | 866,337   | 2028/10/15 |    |  |
| VERTIV GROUP 4.125% 11/15/28 144A    | 社債券 | 4.1250  | 6,290    | 5,597    | 770,927   | 2028/11/15 |    |  |
| LSB INDUS 6.25% 10/15/28 144A        | 社債券 | 6.2500  | 580      | 523      | 72,035    | 2028/10/15 |    |  |
| TRIDENT TPI HLD 12.75% 10/28 144A    | 社債券 | 12.7500 | 2,455    | 2,530    | 348,468   | 2028/12/31 |    |  |
| CHOBANI LLC/FIN 4.625% 11/15/28      | 社債券 | 4.6250  | 2,990    | 2,698    | 371,675   | 2028/11/15 |    |  |
| CHEMOURS CO 5.75% 11/15/28 144A      | 社債券 | 5.7500  | 7,290    | 6,438    | 886,683   | 2028/11/15 |    |  |
| C AND S GRP 5% 12/15/28 144A         | 社債券 | 5.0000  | 3,920    | 3,096    | 426,491   | 2028/12/15 |    |  |
| DISH DBS 5.75% 12/01/28 144A         | 社債券 | 5.7500  | 3,105    | 2,148    | 295,909   | 2028/12/01 |    |  |
| LABL INC 9.5% 11/01/28 144A          | 社債券 | 9.5000  | 10,000   | 10,150   | 1,397,858 | 2028/11/01 |    |  |
| GEO GRP IN 9.5% 12/31/28 144A        | 社債券 | 9.5000  | 13,485   | 13,080   | 1,801,439 | 2028/12/31 |    |  |
| HOLOGIC INC 3.25% 02/15/29 144A      | 社債券 | 3.2500  | 5,215    | 4,594    | 632,706   | 2029/02/15 |    |  |
| RACKSPACE INC 5.375% 12/01/28 144A   | 社債券 | 5.3750  | 2,980    | 607      | 83,702    | 2028/12/01 |    |  |
| H&E EQUIPMENT S 3.875% 12/15/28      | 社債券 | 3.8750  | 8,460    | 7,242    | 997,463   | 2028/12/15 |    |  |
| BIG RIV STL LLC 6.625% 01/31/2       | 社債券 | 6.6250  | 12,541   | 12,381   | 1,705,229 | 2029/01/31 |    |  |
| LAMAR MEDIA CRP 4.875% 01/15/2       | 社債券 | 4.8750  | 4,330    | 4,035    | 555,836   | 2029/01/15 |    |  |
| STERICYCL 3.875% 01/15/29 144A       | 社債券 | 3.8750  | 3,440    | 3,041    | 418,834   | 2029/01/15 |    |  |
| CNX RESOURCES C 6% 01/15/29 144A     | 社債券 | 6.0000  | 2,465    | 2,298    | 316,615   | 2029/01/15 |    |  |
| ASSUREDPARTNE 5.625% 01/15/29 144A   | 社債券 | 5.6250  | 2,965    | 2,558    | 352,417   | 2029/01/15 |    |  |
| CHS/CMNTY HEALT 6% 01/15/29 144A     | 社債券 | 6.0000  | 7,465    | 6,052    | 833,577   | 2029/01/15 |    |  |
| SCRIPPS ESC I 3.875% 01/15/29 144A   | 社債券 | 3.8750  | 4,720    | 3,681    | 507,029   | 2029/01/15 |    |  |
| CROWDSTRIKE HOL 3% 02/15/29          | 社債券 | 3.0000  | 6,125    | 5,324    | 733,225   | 2029/02/15 |    |  |
| CHS/CMNTY HEA 6.875% 04/15/29 144A   | 社債券 | 6.8750  | 6,570    | 3,817    | 525,736   | 2029/04/15 |    |  |
| UNITI/FIN/CSL 6.5% 02/15/29 144A     | 社債券 | 6.5000  | 7,695    | 4,870    | 670,719   | 2029/02/15 |    |  |
| US FOODS INC 4.75% 02/15/29 144A     | 社債券 | 4.7500  | 7,250    | 6,673    | 919,101   | 2029/02/15 |    |  |
| JAZZ SECU DAC 4.375% 01/15/29        | 社債券 | 4.3750  | 4,460    | 3,992    | 549,859   | 2029/01/15 |    |  |
| TRANSDIGM INC 4.625% 01/15/29        | 社債券 | 4.6250  | 20,310   | 18,114   | 2,494,783 | 2029/01/15 |    |  |
| FERTITTA ENTERT 4.625% 01/15/29 144A | 社債券 | 4.6250  | 6,405    | 5,535    | 762,360   | 2029/01/15 |    |  |
| BOMBARDIER 7.5% 2/1/29 144A          | 社債券 | 7.5000  | 5,000    | 4,913    | 676,659   | 2029/02/01 |    |  |
| MATCH GRP 5.625% 02/15/29 144A       | 社債券 | 5.6250  | 5,645    | 5,232    | 720,669   | 2029/02/15 |    |  |
| CRESTWOOD M P/F 6% 02/01/29 144A     | 社債券 | 6.0000  | 17,165   | 15,877   | 2,186,666 | 2029/02/01 |    |  |
| MEG ENERGY CRP 5.875% 02/01/29 144A  | 社債券 | 5.8750  | 7,390    | 6,925    | 953,713   | 2029/02/01 |    |  |
| CLEVELAND-CLIF 4.625% 3/1/29 144A    | 社債券 | 4.6250  | 3,385    | 3,034    | 417,871   | 2029/03/01 |    |  |
| AVIS BUDGET 5.375% 03/01/29 144A     | 社債券 | 5.3750  | 3,385    | 3,024    | 416,589   | 2029/03/01 |    |  |
| COMSTOCK RESO 6.75% 03/29 144A       | 社債券 | 6.7500  | 7,995    | 7,122    | 980,911   | 2029/03/01 |    |  |
| ICAHN LP/FN CO 4.375% 02/01/29       | 社債券 | 4.3750  | 5,925    | 4,616    | 635,738   | 2029/02/01 |    |  |
| MERCER INTL 5.125% 02/01/29          | 社債券 | 5.1250  | 5,195    | 4,202    | 578,824   | 2029/02/01 |    |  |
| SOUTHWESTERN EN 5.375% 02/29         | 社債券 | 5.3750  | 10,290   | 9,621    | 1,325,038 | 2029/02/01 |    |  |
| JACOBS ENT 6.75% 02/15/29 144A       | 社債券 | 6.7500  | 2,750    | 2,392    | 329,563   | 2029/02/15 |    |  |
| NCL CORP 7.75% 02/15/29 144A         | 社債券 | 7.7500  | 5,710    | 5,059    | 696,796   | 2029/02/15 |    |  |
| HUDBAY MINERAL 6.125% 4/01/29 144A   | 社債券 | 6.1250  | 9,850    | 9,037    | 1,244,627 | 2029/04/01 |    |  |
| ALBERTSONS 3.5% 03/15/29 144A        | 社債券 | 3.5000  | 3,395    | 2,959    | 407,632   | 2029/03/15 |    |  |
| KENNEDY-WILSON 4.75% 03/01/29        | 社債券 | 4.7500  | 5,095    | 3,974    | 547,362   | 2029/03/01 |    |  |
| TTM TECH INC 4% 03/01/29 144A        | 社債券 | 4.0000  | 5,085    | 4,341    | 597,886   | 2029/03/01 |    |  |
| TRONOX INC 4.625% 03/15/29 144A      | 社債券 | 4.6250  | 5,040    | 4,008    | 552,094   | 2029/03/15 |    |  |



| 銘柄                                   | 当期  |         |          |          |           |            | 期末 |  |
|--------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|----|--|
|                                      | 種類  | 利率      | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |    |  |
|                                      |     |         |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |    |  |
| (アメリカ)                               |     | %       | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |    |  |
| CHARLES RIVER L 3.75% 03/15/29 144A  | 社債券 | 3.7500  | 1,680    | 1,482    | 204,132   | 2029/03/15 |    |  |
| ALCOA NEDERLAND 4.125% 03/31/29 144A | 社債券 | 4.1250  | 6,035    | 5,452    | 750,885   | 2029/03/31 |    |  |
| CROCS INC 4.25% 03/15/29 144A        | 社債券 | 4.2500  | 15,370   | 13,302   | 1,832,052 | 2029/03/15 |    |  |
| MATTEL INC 3.75% 04/01/29 144A       | 社債券 | 3.7500  | 1,685    | 1,485    | 204,575   | 2029/04/01 |    |  |
| TRITON WAT 6.25% 04/01/29 144A       | 社債券 | 6.2500  | 14,355   | 11,996   | 1,652,114 | 2029/04/01 |    |  |
| NESCO HOLDING 5.5% 04/15/29 144A     | 社債券 | 5.5000  | 3,975    | 3,551    | 489,080   | 2029/04/15 |    |  |
| ARCOSA INC 0% 03/31/29 144A          | 社債券 | 4.3750  | 3,160    | 2,867    | 394,952   | 2029/04/15 |    |  |
| MOZART DEBT 3.875% 04/01/29 144A     | 社債券 | 3.8750  | 5,515    | 4,760    | 655,615   | 2029/04/01 |    |  |
| CLYDESDALE ACQU 6.625% 3/29 144A     | 社債券 | 6.6250  | 2,320    | 2,209    | 304,301   | 2029/04/15 |    |  |
| DPL INC 4.35% 04/15/29               | 社債券 | 4.3500  | 22,705   | 20,093   | 2,767,335 | 2029/04/15 |    |  |
| TEMPUR SEALY 4% 04/15/29 144A        | 社債券 | 4.0000  | 5,280    | 4,487    | 618,021   | 2029/04/15 |    |  |
| SENSATA TECHNOL 4% 04/15/29 14       | 社債券 | 4.0000  | 21,195   | 18,835   | 2,594,035 | 2029/04/15 |    |  |
| MAGIC MERG 7.875% 05/1/29 144A       | 社債券 | 7.8750  | 7,910    | 5,019    | 691,224   | 2029/05/01 |    |  |
| CROWNROCK LP / 5% 05/1/29 144A       | 社債券 | 5.0000  | 1,855    | 1,729    | 238,226   | 2029/05/01 |    |  |
| UNITED AIRLIN 4.625% 04/30/29 144A   | 社債券 | 4.6250  | 3,645    | 3,284    | 452,402   | 2029/04/15 |    |  |
| SCIH SALT 6.625% 05/01/29 144A       | 社債券 | 6.6250  | 3,900    | 3,308    | 455,693   | 2029/05/01 |    |  |
| HIGHTOWER 6.75% 04/15/29 144A        | 社債券 | 6.7500  | 2,160    | 1,857    | 255,795   | 2029/04/15 |    |  |
| LCM INVESTMENTS 4.875% 05/01/29 144A | 社債券 | 4.8750  | 5,860    | 4,970    | 684,522   | 2029/05/01 |    |  |
| NOVA CHEM CORP 4.25% 05/15/29 144A   | 社債券 | 4.2500  | 6,005    | 4,861    | 669,570   | 2029/05/15 |    |  |
| TKC HOLDIN 10.5% 05/15/29 144A       | 社債券 | 10.5000 | 4,280    | 2,776    | 382,441   | 2029/05/15 |    |  |
| ALLIED UNV 6% 06/01/29 144A          | 社債券 | 6.0000  | 2,375    | 1,845    | 254,141   | 2029/06/01 |    |  |
| VICTORS MERGER 6.375% 05/15/29 144A  | 社債券 | 6.3750  | 7,820    | 4,849    | 667,861   | 2029/05/15 |    |  |
| NEPTUNE BID US 9.29% 4/29 144A       | 社債券 | 9.2900  | 18,710   | 17,039   | 2,346,638 | 2029/04/15 |    |  |
| DCP MIDSTREAM 5.125% 05/15/29        | 社債券 | 5.1250  | 9,305    | 9,045    | 1,245,795 | 2029/05/15 |    |  |
| HILTON DOMESTIC 3.75% 05/01/29       | 社債券 | 3.7500  | 3,440    | 3,074    | 423,363   | 2029/05/01 |    |  |
| FRONTIER COMM 6.75% 05/01/29 144A    | 社債券 | 6.7500  | 5,810    | 4,425    | 609,460   | 2029/05/01 |    |  |
| GREAT LAKE 5.25% 06/01/29 144A       | 社債券 | 5.2500  | 3,140    | 2,469    | 340,144   | 2029/06/01 |    |  |
| CLEAR CHANNEL 7.5% 06/01/29 144A     | 社債券 | 7.5000  | 5,830    | 3,976    | 547,695   | 2029/06/01 |    |  |
| SRS DISTRIBUTIO 6.125% 07/01/29 144A | 社債券 | 6.1250  | 2,260    | 1,869    | 257,519   | 2029/07/01 |    |  |
| DT MIDSTREAM 4.125% 06/15/29 144A    | 社債券 | 4.1250  | 5,735    | 5,007    | 689,603   | 2029/06/15 |    |  |
| SUNOCO LP /CORP 4.5% 05/15/29        | 社債券 | 4.5000  | 4,765    | 4,228    | 582,409   | 2029/05/15 |    |  |
| TRANSDIGM INC 4.875% 05/01/29        | 社債券 | 4.8750  | 3,000    | 2,686    | 369,976   | 2029/05/01 |    |  |
| NRG ENERGY 5.25% 06/15/29 144A       | 社債券 | 5.2500  | 2,550    | 2,300    | 316,871   | 2029/06/15 |    |  |
| SERVICE CO INTL 5.125% 6/1/29        | 社債券 | 5.1250  | 3,060    | 2,899    | 399,298   | 2029/06/01 |    |  |
| SYNAPTICS INC 4% 06/15/29 144A       | 社債券 | 4.0000  | 2,730    | 2,279    | 313,939   | 2029/06/15 |    |  |
| TENET HEALTH 4.25% 6/1/29 144A       | 社債券 | 4.2500  | 14,290   | 12,878   | 1,773,617 | 2029/06/01 |    |  |
| MADISON IAQ 5.875% 6/29 144A         | 社債券 | 5.8750  | 6,155    | 4,714    | 649,244   | 2029/06/30 |    |  |
| AHP HEALTH PAR 5.75% 7/29 144A       | 社債券 | 5.7500  | 5,900    | 5,044    | 694,728   | 2029/07/15 |    |  |
| ELASTIC 4.125% 07/15/29 144A         | 社債券 | 4.1250  | 2,790    | 2,392    | 329,484   | 2029/07/15 |    |  |
| VICTORIA'S 4.625% 07/29 144A         | 社債券 | 4.6250  | 3,640    | 2,892    | 398,408   | 2029/07/15 |    |  |
| BALL CORP 6% 06/15/29                | 社債券 | 6.0000  | 10,000   | 10,062   | 1,385,807 | 2029/06/15 |    |  |
| LEVEL 3 FIN 3.75% 07/15/29 144A      | 社債券 | 3.7500  | 8,720    | 4,898    | 674,555   | 2029/07/15 |    |  |
| LCPR SENIOR 5.125% 7/29 144A         | 社債券 | 5.1250  | 5,635    | 4,730    | 651,550   | 2029/07/15 |    |  |
| ALTICE FRANCE 5.125% 7/29 144A       | 社債券 | 5.1250  | 9,920    | 7,182    | 989,116   | 2029/07/15 |    |  |
| COLGATE ENERGY 5.875% 07/01/29       | 社債券 | 5.8750  | 5,640    | 5,245    | 722,368   | 2029/07/01 |    |  |
| SEASPAN CORPORA 5.5% 08/01/29 144A   | 社債券 | 5.5000  | 8,005    | 6,241    | 859,579   | 2029/08/01 |    |  |
| PERFORMANCE FO 4.25% 08/01/29 144A   | 社債券 | 4.2500  | 2,925    | 2,605    | 358,769   | 2029/08/01 |    |  |
| AMWINS GROUP 4.875% 06/30/29 144A    | 社債券 | 4.8750  | 3,035    | 2,740    | 377,377   | 2029/06/30 |    |  |



| 銘柄                                   | 当期末 |        |          |          |           |            |
|--------------------------------------|-----|--------|----------|----------|-----------|------------|
|                                      | 種類  | 利率     | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                                      |     |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                               |     | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| VENTURE GLOBAL 3.875% 08/15/29 144   | 社債券 | 3.8750 | 4,765    | 4,141    | 570,301   | 2029/08/15 |
| MPT OPER PARTNERSHIP LP/CORP 4       | 社債券 | 4.6250 | 8,370    | 6,088    | 838,532   | 2029/08/01 |
| ASHTON WOODS US 4.625% 08/01/2       | 社債券 | 4.6250 | 2,985    | 2,485    | 342,235   | 2029/08/01 |
| ALTICE FING SA 5.75% 8/29 144A       | 社債券 | 5.7500 | 15,990   | 12,438   | 1,713,090 | 2029/08/15 |
| UBER TECH INC 4.5% 08/15/29 144A     | 社債券 | 4.5000 | 48,880   | 45,142   | 6,216,976 | 2029/08/15 |
| WR GRACE HLG 5.625% 08/29 144A       | 社債券 | 5.6250 | 5,070    | 4,197    | 578,045   | 2029/08/15 |
| CARVANA CO 4.875% 09/01/29 144A      | 社債券 | 4.8750 | 580      | 301      | 41,520    | 2029/09/01 |
| CCO HLDGS/CAP 6.375% 9/29 144A       | 社債券 | 6.3750 | 4,755    | 4,443    | 611,965   | 2029/09/01 |
| TEVA PH FIN NV 7.875% 08/31/29       | 社債券 | 7.8750 | 4,735    | 4,869    | 670,689   | 2029/09/15 |
| PAPA JOHNS IN 3.875% 09/15/29 144A   | 社債券 | 3.8750 | 1,830    | 1,571    | 216,428   | 2029/09/15 |
| ALLEGHENY TECH 4.875% 10/01/29       | 社債券 | 4.8750 | 2,540    | 2,289    | 315,328   | 2029/10/01 |
| CAESARS ENTERTA 4.625% 10/15/29 144A | 社債券 | 4.6250 | 6,000    | 5,200    | 716,155   | 2029/10/15 |
| ROLLER BEARING 4.375% 10/15/29 144A  | 社債券 | 4.3750 | 1,440    | 1,292    | 177,943   | 2029/10/15 |
| HEALTHEQUITY INC 4.5% 10/01/29 144A  | 社債券 | 4.5000 | 2,085    | 1,871    | 257,713   | 2029/10/01 |
| CLOUD SOFTWARE 9% 09/30/29 144A      | 社債券 | 9.0000 | 18,335   | 15,527   | 2,138,402 | 2029/09/30 |
| QORVO INC 4.375% 10/15/29            | 社債券 | 4.3750 | 3,915    | 3,533    | 486,658   | 2029/10/15 |
| ALLIANT HLDG 5.875% 11/01/29 144A    | 社債券 | 5.8750 | 6,220    | 5,351    | 736,974   | 2029/11/01 |
| MSCI INC 4% 11/15/29 144A            | 社債券 | 4.0000 | 13,690   | 12,325   | 1,697,413 | 2029/11/15 |
| FRONTIER 5.875% 11/01/29 144A        | 社債券 | 5.8750 | 1,284    | 924      | 127,358   | 2029/11/01 |
| CHEMOURS 4.625% 11/15/29 144A        | 社債券 | 4.6250 | 4,800    | 3,879    | 534,278   | 2029/11/15 |
| AVANTOR FUNDING 3.875% 11/01/29      | 社債券 | 3.8750 | 4,710    | 4,144    | 570,789   | 2029/11/01 |
| ASBURY AUTOMO 4.625% 11/15/29 144A   | 社債券 | 4.6250 | 3,075    | 2,721    | 374,855   | 2029/11/15 |
| PECF USS INTERM 8% 11/29 144A        | 社債券 | 8.0000 | 1,765    | 924      | 127,310   | 2029/11/15 |
| SRS DISTRIBUTIO 6% 12/01/29 144A     | 社債券 | 6.0000 | 3,575    | 2,927    | 403,159   | 2029/12/01 |
| OPEN TEXT CORP 3.875% 12/01/29 144A  | 社債券 | 3.8750 | 4,655    | 3,889    | 535,640   | 2029/12/01 |
| HERTZ 5% 12/01/29 144A               | 社債券 | 5.0000 | 4,675    | 3,760    | 517,925   | 2029/12/01 |
| SPIRIT AE 9.375% 11/30/29 144A       | 社債券 | 9.3750 | 12,000   | 12,807   | 1,763,846 | 2029/11/30 |
| TRANSALTA 7.75% 11/15/29 144A        | 社債券 | 7.7500 | 4,735    | 4,942    | 680,679   | 2029/11/15 |
| UNITED RENTAL 6% 12/29 144A          | 社債券 | 6.0000 | 13,860   | 13,888   | 1,912,712 | 2029/12/15 |
| CENTENE CORP 4.625% 12/15/29         | 社債券 | 4.6250 | 9,050    | 8,400    | 1,156,914 | 2029/12/15 |
| COMSTOCK 5.875% 01/15/30 144A        | 社債券 | 5.8750 | 3,545    | 2,996    | 412,612   | 2030/01/15 |
| UNITI GRP/UNI 6% 01/15/30 144A       | 社債券 | 6.0000 | 14,240   | 8,643    | 1,190,446 | 2030/01/15 |
| HUB INTE 5.625% 12/01/29 144A        | 社債券 | 5.6250 | 4,185    | 3,714    | 511,592   | 2029/12/01 |
| II-VI INC 5% 12/15/29 144A           | 社債券 | 5.0000 | 3,060    | 2,670    | 367,788   | 2029/12/15 |
| COVERT M 4.875% 12/01/29 144A        | 社債券 | 4.8750 | 2,965    | 2,578    | 355,149   | 2029/12/01 |
| CHART INDUS 7.5% 01/01/30 144A       | 社債券 | 7.5000 | 5,975    | 6,072    | 836,248   | 2030/01/01 |
| CSC HOLDINGS 5.75% 01/30 144A        | 社債券 | 5.7500 | 8,985    | 4,192    | 577,327   | 2030/01/15 |
| JBS USA/LUX/PI 5.5% 01/30 144A       | 社債券 | 5.5000 | 10,595   | 9,906    | 1,364,299 | 2030/01/15 |
| ZIGGO BV 4.875% 01/15/2030 144       | 社債券 | 4.8750 | 4,150    | 3,476    | 478,851   | 2030/01/15 |
| ZIGGO BOND CO 5.125% 02/28/30 144A   | 社債券 | 5.1250 | 2,840    | 2,241    | 308,726   | 2030/02/28 |
| FRONTIER COMM 6% 01/31/30 144A       | 社債券 | 6.0000 | 6,275    | 4,550    | 626,721   | 2030/01/15 |
| LAMB WESTON 4.125% 01/30 144A        | 社債券 | 4.1250 | 4,710    | 4,253    | 585,767   | 2030/01/31 |
| TENET HEALTH 4.375% 1/30             | 社債券 | 4.3750 | 14,020   | 12,515   | 1,723,636 | 2030/01/15 |
| FERTITTA ENTERT 6.75% 07/15/30 144A  | 社債券 | 6.7500 | 11,205   | 8,952    | 1,232,886 | 2030/07/15 |
| MIWD HOLDCO II 5.5% 02/01/30 144A    | 社債券 | 5.5000 | 1,300    | 1,047    | 144,215   | 2030/02/01 |
| VISTAJET MAL/XO 6.375% 02/01/30 144A | 社債券 | 6.3750 | 9,445    | 7,792    | 1,073,144 | 2030/02/01 |
| ERO COPPER 6.5% 2/15/30 144A         | 社債券 | 6.5000 | 24,590   | 21,585   | 2,972,734 | 2030/02/15 |
| MINERVA MERGE 6.5% 02/15/30 144A     | 社債券 | 6.5000 | 16,765   | 13,741   | 1,892,539 | 2030/02/15 |

| 銘柄                                   | 当期末 |         |          |          |           |            |
|--------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
|                                      | 種類  | 利率      | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                                      |     |         |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                               |     | %       | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| INTELSAT JACKSN 6.5% 1/30 144A       | 社債券 | 6.5000  | 23,650   | 21,639   | 2,980,226 | 2030/03/15 |
| VENTURE GBL 6.25% 01/15/30 144A      | 社債券 | 6.2500  | 15,005   | 14,766   | 2,033,693 | 2030/01/15 |
| TRANSOCEAN 8.75% 02/15/30 144A       | 社債券 | 8.7500  | 6,100    | 6,098    | 839,839   | 2030/02/15 |
| CAESARS ENT 7% 02/15/30 144A         | 社債券 | 7.0000  | 28,815   | 29,002   | 3,994,156 | 2030/02/15 |
| ROYAL CARIBBEA 7.25% 1/30 144A       | 社債券 | 7.2500  | 4,160    | 4,222    | 581,577   | 2030/01/15 |
| ALBERTSONS 4.875% 2/15/30 144A       | 社債券 | 4.8750  | 15,497   | 14,257   | 1,963,507 | 2030/02/15 |
| OPEN TEXT 4.125% 2/15/30 144A        | 社債券 | 4.1250  | 7,655    | 6,497    | 894,802   | 2030/02/15 |
| CENTENE CORP 3.375% 2/15/30 WI       | 社債券 | 3.3750  | 4,895    | 4,199    | 578,323   | 2030/02/15 |
| HESS INFRA/FI 4.25% 02/30 144A       | 社債券 | 4.2500  | 3,345    | 2,918    | 401,937   | 2030/02/15 |
| GRAPHIC PACK 3.75% 02/30 144A        | 社債券 | 3.7500  | 2,510    | 2,196    | 302,467   | 2030/02/01 |
| RAND PARENT LLC 8.5% 02/15/30 144A   | 社債券 | 8.5000  | 15,785   | 14,007   | 1,929,084 | 2030/02/15 |
| CCO HLDGS 4.75% 03/01/30 144A        | 社債券 | 4.7500  | 12,395   | 10,477   | 1,442,960 | 2030/03/01 |
| ASBURY AUTOMOTI 4.75% 03/01/30       | 社債券 | 4.7500  | 1,662    | 1,459    | 200,979   | 2030/03/01 |
| CLYDESDALE ACQUI 8.75% 03/30 144A    | 社債券 | 8.7500  | 13,965   | 12,185   | 1,678,236 | 2030/04/15 |
| CDI ESCROW ISSU 5.75% 04/01/30 144A  | 社債券 | 5.7500  | 9,515    | 9,012    | 1,241,163 | 2030/04/01 |
| POST HLDGS IN 4.625% 4/30 144A       | 社債券 | 4.6250  | 1,416    | 1,252    | 172,440   | 2030/04/15 |
| CHS/CMNTY HEALT 6.125% 04/01/30 144A | 社債券 | 6.1250  | 17,790   | 9,988    | 1,375,549 | 2030/04/01 |
| CHS/CMNTY HEALT 5.25% 05/15/30 144A  | 社債券 | 5.2500  | 20,895   | 15,665   | 2,157,410 | 2030/05/15 |
| MINERAL RES 8.5% 5/1/30 144A         | 社債券 | 8.5000  | 1,465    | 1,472    | 202,800   | 2030/05/01 |
| DAVITA INC 0% 05/31/30 144A          | 社債券 | 4.6250  | 14,645   | 12,605   | 1,735,994 | 2030/06/01 |
| ROBLOX CO 3.875% 05/01/30 144A       | 社債券 | 3.8750  | 22,315   | 18,939   | 2,608,397 | 2030/05/01 |
| US FOODS INC 4.625% 06/01/30 144A    | 社債券 | 4.6250  | 2,370    | 2,146    | 295,623   | 2030/06/01 |
| FRONTIER COMM 8.75% 05/15/30 144A    | 社債券 | 8.7500  | 4,885    | 4,689    | 645,905   | 2030/05/15 |
| DARLING INGRED 6% 6/15/30 144A       | 社債券 | 6.0000  | 4,950    | 4,865    | 670,077   | 2030/06/15 |
| IQVIA INC 6.5% 05/15/30 144A         | 社債券 | 6.5000  | 5,465    | 5,526    | 761,106   | 2030/05/15 |
| SIRIUS XM R 4.125% 7/1/30 144A       | 社債券 | 4.1250  | 4,755    | 3,819    | 526,002   | 2030/07/01 |
| TENET HEALTH 6.125% 06/15/30 144A    | 社債券 | 6.1250  | 8,165    | 7,939    | 1,093,493 | 2030/06/15 |
| ADVANCED DRAIN 6.375% 06/15/30 144A  | 社債券 | 6.3750  | 8,020    | 7,903    | 1,088,465 | 2030/06/15 |
| UNIVISION COM 7.375% 06/30/30 144A   | 社債券 | 7.3750  | 7,630    | 7,145    | 984,067   | 2030/06/30 |
| PG&E CORP 5.25% 07/01/30             | 社債券 | 5.2500  | 19,645   | 17,800   | 2,451,462 | 2030/07/01 |
| OCCIDENTL PETE 8.875% 07/15/30       | 社債券 | 8.8750  | 14,070   | 16,198   | 2,230,800 | 2030/07/15 |
| PG&E 4.55% 07/01/30                  | 社債券 | 4.5500  | 36,411   | 32,926   | 4,534,695 | 2030/07/01 |
| DUKE ENERGY FLD 8.125% 8/16/30       | 社債券 | 8.1250  | 425      | 472      | 65,029    | 2030/08/16 |
| VICI PROPE 4.125% 8/15/30 144A       | 社債券 | 4.1250  | 5,935    | 5,204    | 716,774   | 2030/08/15 |
| CCO HLDGS/CAP 4.5% 08/30 144A        | 社債券 | 4.5000  | 12,200   | 10,095   | 1,390,285 | 2030/08/15 |
| MATCH GROUP INC 4.125% 08/01/2       | 社債券 | 4.1250  | 5,750    | 4,818    | 663,580   | 2030/08/01 |
| FMG RES AG 5.875% 4/15/30 144A       | 社債券 | 5.8750  | 9,275    | 8,865    | 1,220,945 | 2030/04/15 |
| ENLINK MIDSTR 6.5% 9/1/30 144A       | 社債券 | 6.5000  | 4,735    | 4,688    | 645,680   | 2030/09/01 |
| OCCIDENTAL PETE 6.625% 9/1/30        | 社債券 | 6.6250  | 17,605   | 18,265   | 2,515,481 | 2030/09/01 |
| L BRANDS INC 6.625% 10/01/30 144A    | 社債券 | 6.6250  | 10,425   | 9,973    | 1,373,563 | 2030/10/01 |
| 1011778 BC ULC 4% 10/15/30 144A      | 社債券 | 4.0000  | 10,310   | 8,909    | 1,227,057 | 2030/10/15 |
| DANA INC 4.25% 09/01/30              | 社債券 | 4.2500  | 3,175    | 2,544    | 350,416   | 2030/09/01 |
| CENTRAL GARDEN 4.125% 10/15/30       | 社債券 | 4.1250  | 3,435    | 2,899    | 399,364   | 2030/10/15 |
| HESS MIDSTREAM 5.5% 10/30 144A       | 社債券 | 5.5000  | 1,990    | 1,825    | 251,416   | 2030/10/15 |
| BAUSCH HEALTH 14% 10/30 144A         | 社債券 | 14.0000 | 797      | 522      | 71,894    | 2030/10/15 |
| MOLINA HEALTHCA 3.875% 11/15/30 144A | 社債券 | 3.8750  | 4,985    | 4,293    | 591,277   | 2030/11/15 |
| FORD MTR CR LLC 4% 11/13/30          | 社債券 | 4.0000  | 3,440    | 2,888    | 397,827   | 2030/11/13 |
| CSC HLDGS LLC 4.125% 12/01/30 144A   | 社債券 | 4.1250  | 5,315    | 3,767    | 518,887   | 2030/12/01 |

| 銘柄                                   | 当期末 |        |          |          |           |            |
|--------------------------------------|-----|--------|----------|----------|-----------|------------|
|                                      | 種類  | 利率     | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                                      |     |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                               |     | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| SPRINGLEAF CORP 4% 09/15/30          | 社債券 | 4.0000 | 6,100    | 4,496    | 619,324   | 2030/09/15 |
| TALLGRASS LP 6% 12/31/30 144A        | 社債券 | 6.0000 | 5,145    | 4,485    | 617,773   | 2030/12/31 |
| CNX RESOURCES 7.375% 01/15/31 144A   | 社債券 | 7.3750 | 3,710    | 3,620    | 498,627   | 2031/01/15 |
| EMERALD DEBT 6.625% 12/30 144A       | 社債券 | 6.6250 | 15,880   | 15,848   | 2,182,619 | 2030/12/15 |
| OCCIDENTAL PETRO 6.125% 01/01/31     | 社債券 | 6.1250 | 12,810   | 13,034   | 1,795,066 | 2031/01/01 |
| SCRIPPS ESC II 5.375% 01/15/31 144A  | 社債券 | 5.3750 | 2,450    | 1,747    | 240,603   | 2031/01/15 |
| MURPHY OIL USA 3.75% 02/15/31 144A   | 社債券 | 3.7500 | 2,245    | 1,908    | 262,869   | 2031/02/15 |
| CHS/CMNTY HEALT 4.75% 02/15/31 144A  | 社債券 | 4.7500 | 26,430   | 18,975   | 2,613,331 | 2031/02/15 |
| CLEAN HARBORS 6.375% 2/31 144A       | 社債券 | 6.3750 | 1,965    | 1,969    | 271,215   | 2031/02/01 |
| CRESTWOOD M 7.375% 02/31 144A        | 社債券 | 7.3750 | 10,000   | 9,855    | 1,357,327 | 2031/02/01 |
| CSC HLDGS LLC 3.375% 02/15/31 144A   | 社債券 | 3.3750 | 7,020    | 4,822    | 664,110   | 2031/02/15 |
| DAVITA INC 3.75% 02/15/31 144A       | 社債券 | 3.7500 | 5,275    | 4,209    | 579,739   | 2031/02/15 |
| COMMERCIAL META 3.875% 02/15/31      | 社債券 | 3.8750 | 2,620    | 2,243    | 308,957   | 2031/02/15 |
| CLEVELAND-CLIF 4.875% 3/1/31 144A    | 社債券 | 4.8750 | 3,385    | 2,916    | 401,723   | 2031/03/01 |
| WR GRACE HLD 7.375% 3/31 144A        | 社債券 | 7.3750 | 11,435   | 11,230   | 1,546,607 | 2031/03/01 |
| WYNN RESORTS 7.125% 2/31 144A        | 社債券 | 7.1250 | 14,335   | 14,460   | 1,991,431 | 2031/02/15 |
| KENNEDY-WILSON 5% 03/01/31           | 社債券 | 5.0000 | 5,095    | 3,700    | 509,597   | 2031/03/01 |
| CHARLES RIVER L 4% 03/15/31 144A     | 社債券 | 4.0000 | 4,710    | 4,108    | 565,827   | 2031/03/15 |
| FMG RES AUG LTD 4.375% 04/01/31 144A | 社債券 | 4.3750 | 3,615    | 3,092    | 425,907   | 2031/04/01 |
| CCO HLDGS/CAP 7.375% 03/03/31 144A   | 社債券 | 7.3750 | 29,290   | 28,328   | 3,901,428 | 2031/03/03 |
| ORGANON FINAN 5.125% 04/30/31 144A   | 社債券 | 5.1250 | 6,600    | 5,606    | 772,063   | 2031/04/30 |
| SCOTTS MIRACLE 4% 04/01/31           | 社債券 | 4.0000 | 3,370    | 2,723    | 375,126   | 2031/04/01 |
| ADIANT GLOBAL 8.25% 04/15/31 144A    | 社債券 | 8.2500 | 9,280    | 9,330    | 1,284,994 | 2031/04/15 |
| KNIFE RIVER 7.75% 5/1/31 144A        | 社債券 | 7.7500 | 10,000   | 10,030   | 1,381,372 | 2031/05/01 |
| CHURCHILL 6.75% 05/01/31 144A        | 社債券 | 6.7500 | 6,000    | 6,007    | 827,352   | 2031/05/01 |
| OCCIDENTAL PETE 7.5% 05/01/31        | 社債券 | 7.5000 | 22,290   | 24,193   | 3,331,968 | 2031/05/01 |
| EQT CORP 3.625% 05/15/31 144A        | 社債券 | 3.6250 | 3,875    | 3,285    | 452,489   | 2031/05/15 |
| BLOCK INC 3.5% 06/01/31              | 社債券 | 3.5000 | 5,755    | 4,681    | 644,723   | 2031/06/01 |
| DT MIDSTREAM 4.375% 06/15/31 144A    | 社債券 | 4.3750 | 5,735    | 4,889    | 673,419   | 2031/06/15 |
| TENET HEALTH 6.75% 5/31 144A         | 社債券 | 6.7500 | 5,290    | 5,276    | 726,717   | 2031/05/15 |
| NORTHERN OIL 8.75% 06/31 144A        | 社債券 | 8.7500 | 5,320    | 5,236    | 721,218   | 2031/06/15 |
| OWENS BROCKWAY 7.25% 5/31 144A       | 社債券 | 7.2500 | 10,075   | 10,137   | 1,396,201 | 2031/05/15 |
| CQP HOLDCO 5.5% 06/15/31 144A        | 社債券 | 5.5000 | 16,265   | 14,661   | 2,019,239 | 2031/06/15 |
| FORD MTR CR LLC 3.625% 6/17/31       | 社債券 | 3.6250 | 5,490    | 4,425    | 609,455   | 2031/06/17 |
| MC BRAZIL DWNST 7.25% 06/31 144A     | 社債券 | 7.2500 | 15,508   | 12,104   | 1,666,998 | 2031/06/30 |
| VENTURE GLOBAL 4.125% 08/15/31 144A  | 社債券 | 4.1250 | 4,765    | 4,057    | 558,824   | 2031/08/15 |
| CROCS INC 4.125% 08/15/31 144A       | 社債券 | 4.1250 | 11,830   | 9,762    | 1,344,438 | 2031/08/15 |
| TEVA PH FIN NV 8.125% 08/31/31       | 社債券 | 8.1250 | 6,370    | 6,649    | 915,753   | 2031/09/15 |
| ALLEGHENY TECH 5.125% 10/01/31       | 社債券 | 5.1250 | 1,780    | 1,577    | 217,315   | 2031/10/01 |
| COINBASE GLOBAL 3.625% 10/01/31      | 社債券 | 3.6250 | 12,770   | 7,426    | 1,022,762 | 2031/10/01 |
| ALLY 8% GLOBAL                       | 社債券 | 8.0000 | 34,804   | 35,341   | 4,867,166 | 2031/11/01 |
| ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31           | 社債券 | 8.0000 | 18,070   | 18,604   | 2,562,238 | 2031/11/01 |
| TENET HEALTH 6.875% 11/15/31         | 社債券 | 6.8750 | 725      | 697      | 96,102    | 2031/11/15 |
| CSC HLDGS LLC 4.5% 11/15/31 144A     | 社債券 | 4.5000 | 4,930    | 3,475    | 478,652   | 2031/11/15 |
| CSC HLDGS LLC 5% 11/15/31 144A       | 社債券 | 5.0000 | 5,185    | 2,351    | 323,913   | 2031/11/15 |
| SOUTHWESTERN EN 4.75% 02/01/32       | 社債券 | 4.7500 | 4,720    | 4,095    | 564,031   | 2032/02/01 |
| HILTON DOMEST 3.625% 02/15/32 144A   | 社債券 | 3.6250 | 3,430    | 2,869    | 395,230   | 2032/02/15 |
| YUM BRANDS INC 4.625% 01/31/32       | 社債券 | 4.6250 | 5,800    | 5,325    | 733,364   | 2032/01/31 |

| 銘柄                                   | 当期  |        |           |           |             |            | 期末 |  |
|--------------------------------------|-----|--------|-----------|-----------|-------------|------------|----|--|
|                                      | 種類  | 利率     | 額面金額      | 評価額       |             | 償還年月日      |    |  |
|                                      |     |        |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額      |            |    |  |
| (アメリカ)                               |     | %      | 千アメリカ・ドル  | 千アメリカ・ドル  | 千円          |            |    |  |
| VZ SECURED FINA 5% 01/15/32 14       | 社債券 | 5.0000 | 15,310    | 12,272    | 1,690,104   | 2032/01/15 |    |  |
| NRG ENERGY INC 3.875% 02/15/32 144A  | 社債券 | 3.8750 | 2,945     | 2,272     | 312,974     | 2032/02/15 |    |  |
| ASBURY AUTOMO 5% 02/15/32 144A       | 社債券 | 5.0000 | 3,075     | 2,643     | 364,060     | 2032/02/15 |    |  |
| FORD MOTOR 3.25% 02/12/32            | 社債券 | 3.2500 | 9,450     | 7,149     | 984,680     | 2032/02/12 |    |  |
| BUILDERS F 4.25% 02/01/32 144A       | 社債券 | 4.2500 | 12,090    | 10,469    | 1,441,903   | 2032/02/01 |    |  |
| BELLRING BRANDS 7% 3/30 144A         | 社債券 | 7.0000 | 1,860     | 1,888     | 260,024     | 2030/03/15 |    |  |
| SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32        | 社債券 | 8.7500 | 44,955    | 54,343    | 7,484,235   | 2032/03/15 |    |  |
| MACYS RTL HLDG 6.125% 03/15/32       | 社債券 | 6.1250 | 2,345     | 2,016     | 277,749     | 2032/03/15 |    |  |
| CCO HLDGS/CAP 4.5% 05/01/32          | 社債券 | 4.5000 | 4,545     | 3,580     | 493,169     | 2032/05/01 |    |  |
| MOLINA HEALTHCA 3.875% 05/15/32 144A | 社債券 | 3.8750 | 6,725     | 5,653     | 778,600     | 2032/05/15 |    |  |
| FORD MOTOR 6.1% 08/19/32             | 社債券 | 6.1000 | 9,770     | 9,189     | 1,265,640   | 2032/08/19 |    |  |
| CCO HLDGS/CAP 4.5% 04/33 144A        | 社債券 | 4.5000 | 9,955     | 7,618     | 1,049,173   | 2033/06/01 |    |  |
| CCO HLDGS/ 4.25% 01/15/34 144A       | 社債券 | 4.2500 | 8,000     | 5,920     | 815,313     | 2034/01/15 |    |  |
| CF INDUSTRI INC 5.15% 03/15/34       | 社債券 | 5.1500 | 5,115     | 4,819     | 663,742     | 2034/03/15 |    |  |
| OCCIDENTAL PETE 6.45% 09/15/36       | 社債券 | 6.4500 | 4,200     | 4,263     | 587,100     | 2036/09/15 |    |  |
| ALCOA INC GLB 5.95 2/1/37            | 社債券 | 5.9500 | 3,730     | 3,743     | 515,575     | 2037/02/01 |    |  |
| OCCIDENTAL PETRO 4.3% 08/15/39       | 社債券 | 4.3000 | 2,145     | 1,716     | 236,327     | 2039/08/15 |    |  |
| OCCIDENTAL PETE 6.2% 03/15/40        | 社債券 | 6.2000 | 2,405     | 2,354     | 324,323     | 2040/03/15 |    |  |
| PACIFIC GAS & ELE 3.75% 8/15/42      | 社債券 | 3.7500 | 855       | 580       | 80,011      | 2042/08/15 |    |  |
| CF INDUS INC 5.375% 03/15/44         | 社債券 | 5.3750 | 5,780     | 5,035     | 693,478     | 2044/03/15 |    |  |
| OCCIDENTAL PETE 4.5% 07/15/44        | 社債券 | 4.5000 | 1,985     | 1,528     | 210,498     | 2044/07/15 |    |  |
| OCCIDENTAL PETE 6.6% 03/15/46        | 社債券 | 6.6000 | 5,365     | 5,484     | 755,263     | 2046/03/15 |    |  |
| OCCIDENTAL PETROLEUM 4.4% 4/46       | 社債券 | 4.4000 | 4,275     | 3,317     | 456,937     | 2046/04/15 |    |  |
| KRAFT HEINZ CO 4.375% 6/1/46         | 社債券 | 4.3750 | 1,500     | 1,251     | 172,407     | 2046/06/01 |    |  |
| PACIFIC GAS & ELEC 3.95% 12/47       | 社債券 | 3.9500 | 5,170     | 3,440     | 473,822     | 2047/12/01 |    |  |
| KRAFT HEINZ FD 4.875% 10/01/49       | 社債券 | 4.8750 | 7,485     | 6,655     | 916,659     | 2049/10/01 |    |  |
| ALLIANT HLDG PREF A 9.75% PERP       | 社債券 | 9.7500 | 3,000     | 2,610     | 359,449     | 2049/12/31 |    |  |
| JPMORGAN CHASE 5.15% PERP            | 社債券 | 8.5491 | 35,000    | 34,909    | 4,807,667   | 2049/12/31 |    |  |
| CITIGROUP 5.35% PERP                 | 社債券 | 8.7867 | 25,370    | 24,705    | 3,402,449   | 2049/12/31 |    |  |
| BANK OF AMERICA 6.1% VAR PERP        | 社債券 | 6.1000 | 12,630    | 12,122    | 1,669,496   | 2049/12/31 |    |  |
| KRAFT HEINZ FD 5.5% 06/01/50         | 社債券 | 5.5000 | 1,990     | 1,927     | 265,421     | 2050/06/01 |    |  |
| PG&E 4.95% 07/01/50                  | 社債券 | 4.9500 | 40,141    | 30,578    | 4,211,338   | 2050/07/01 |    |  |
| CITIGROUP INC 5%/VAR PERP            | 社債券 | 5.0000 | 5,310     | 4,919     | 677,506     | 2049/12/31 |    |  |
| CA MAGNUM HLD 5.375% 10/31/26 144A   | 社債券 | 5.3750 | 1,565     | 1,354     | 186,609     | 2026/10/31 |    |  |
| OPEN TEXT HOLDI 4.125% 12/01/31 144A | 社債券 | 4.1250 | 4,655     | 3,813     | 525,210     | 2031/12/01 |    |  |
| STATION CAS LLC 4.625% 12/01/31 144A | 社債券 | 4.6250 | 7,800     | 6,586     | 907,121     | 2031/12/01 |    |  |
| CITIGROUP 7.375%/VAR PERP            | 社債券 | 7.3750 | 7,000     | 6,868     | 945,964     | 2049/12/31 |    |  |
| BOA CORP 4.375%/VAR PERP             | 社債券 | 4.3750 | 9,710     | 8,101     | 1,115,690   | 2049/12/31 |    |  |
| CHARLES SCHWAB 5.375%/VAR PERP       | 社債券 | 5.3750 | 12,130    | 11,528    | 1,587,751   | 2049/12/31 |    |  |
| 小計                                   |     | —      | 4,418,093 | 3,867,786 | 532,671,595 | —          |    |  |
| 合計                                   |     | —      | —         | —         | 532,671,595 | —          |    |  |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

#### (4) 金銭債権

##### (A) 金銭債権

| 区 分     | 当 期 末               |                  |            |
|---------|---------------------|------------------|------------|
|         | 外 貨 建 金 額           | 邦 貨 換 算 金 額      | 比 率        |
| ア メ リ カ | 千アメリカ・ドル<br>336,835 | 千円<br>46,388,921 | %<br><7.1> |
| 合 計     | —                   | 46,388,921       | <7.1>      |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

##### (B) 個別銘柄開示

##### 外国(外貨建)金銭債権

| 銘 柄                                | 当 期 末 |          |          |           |             |            |
|------------------------------------|-------|----------|----------|-----------|-------------|------------|
|                                    | 種 類   | 利 率      | 額 面 金 額  | 評 価 額     |             | 償 還 年 月 日  |
|                                    |       |          |          | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
| (アメリカ)                             |       | %        | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円          |            |
| SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C1   | 金銭債権  | 0.00000  | 1,814    | 0         | 0           | 2049/12/31 |
| SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C2   | 金銭債権  | 0.00000  | 1,638    | 0         | 0           | 2049/12/31 |
| SANCHEZ DIP ROLL UP TL 5/11/20 C1  | 金銭債権  | 0.00000  | 1,489    | 0         | 0           | 2049/12/31 |
| SOFTBANK SVF II TERM 1LN 12/24 C1  | 金銭債権  | 5.00000  | 22,690   | 22,399    | 3,084,912   | 2024/12/31 |
| MISYS LTD TERM B 1LN 6/13/24 C4    | 金銭債権  | 8.65495  | 12,214   | 11,584    | 1,595,382   | 2024/06/13 |
| MISYS LTD TERM B 1LN 6/13/24 C5    | 金銭債権  | 8.65495  | 2,501    | 2,372     | 326,729     | 2024/06/13 |
| MISYS LTD TERM B 1LN 6/13/24 C6    | 金銭債権  | 8.65495  | 2,276    | 2,158     | 297,323     | 2024/06/13 |
| MISYS LIMITED TERM 2LN 06/25       | 金銭債権  | 0.00000  | 3,136    | 2,646     | 364,495     | 2025/06/13 |
| KINDERCARE TERM 2LN 08/22/2025 C1  | 金銭債権  | 13.40914 | 13,635   | 13,089    | 1,802,699   | 2025/08/22 |
| AKZONOBEL TERM B 10/01/25 C1       | 金銭債権  | 7.89542  | 0        | 0         | 0           | 2025/10/01 |
| MISYS LIMITED TERM 2LN 06/25 C1    | 金銭債権  | 12.40495 | 6,294    | 5,311     | 731,515     | 2025/06/13 |
| CONSOLIDATE TM INCR B 1LN 5/25 C1  | 金銭債権  | 8.02457  | 12,600   | 12,285    | 1,691,965   | 2025/05/07 |
| ANASTASIA BEV TERM B 08/25 C1      | 金銭債権  | 8.90914  | 7,672    | 5,913     | 814,454     | 2025/08/10 |
| ULTIMATE SOFTWARE TERM 1LN 5/26 C1 | 金銭債権  | 8.89542  | 1,891    | 1,823     | 251,171     | 2026/05/04 |
| TRAVELPORT TERM 1LN 05/29/2026 C1  | 金銭債権  | 13.36464 | 3,466    | 2,149     | 296,013     | 2026/05/29 |
| THE GOLUB CORPOR TM 2LN 05/26 C1   | 金銭債権  | 18.60000 | 9,315    | 9,047     | 1,246,044   | 2026/05/08 |
| UKG TERM 1LN 5/3/26 C1             | 金銭債権  | 8.27063  | 8,319    | 7,935     | 1,092,920   | 2026/05/03 |
| BREAKWATER ENERG TM B 1LN 9/26 C1  | 金銭債権  | 11.00000 | 25,699   | 24,414    | 3,362,376   | 2026/09/01 |
| FRST EAGLE TERM B 1LN 2/1/27 C1    | 金銭債権  | 7.65914  | 2,448    | 2,330     | 320,986     | 2027/02/01 |
| AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C1       | 金銭債権  | 9.02457  | 682      | 639       | 88,109      | 2027/01/23 |
| ACRISURE TERM B 1LN 02/15/27 C1    | 金銭債権  | 9.27457  | 454      | 431       | 59,431      | 2027/02/15 |
| UKG TERM 2LN 05/03/2027 C1         | 金銭債権  | 10.27063 | 29,030   | 26,985    | 3,716,471   | 2027/05/03 |
| ANGUS CHEMICAL TM B 1LN 11/27 C1   | 金銭債権  | 9.02457  | 7,974    | 7,728     | 1,064,417   | 2027/11/24 |
| ANGUS CHEMICAL TM 1LN 11/04/27 C1  | 金銭債権  | 9.73221  | 578      | 561       | 77,287      | 2027/11/04 |
| ALLIANT HLDNGS TM B5 1LN 11/27 C1  | 金銭債権  | 8.55929  | 3,474    | 3,397     | 467,908     | 2027/11/06 |
| AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C2       | 金銭債権  | 9.02457  | 343      | 322       | 44,358      | 2027/01/23 |
| EPICOR SOFTWARE TL 2LN 07/28 C1    | 金銭債権  | 12.83221 | 4,075    | 4,034     | 555,686     | 2028/07/30 |
| CSC SERVICEWORKS TM B 1LN 3/28 C1  | 金銭債権  | 8.98571  | 18,677   | 15,182    | 2,090,894   | 2028/03/04 |
| ALTERRA MOUNT TM B-1 1LN 07/28 C1  | 金銭債権  | 8.52457  | 275      | 273       | 37,725      | 2028/07/21 |
| EXAMWORKS TERM B 1LN 11/01/28 C1   | 金銭債権  | 8.09669  | 594      | 581       | 80,131      | 2028/11/01 |

| 銘柄                                | 当期   |          |          |          |            | 償還年月日      |
|-----------------------------------|------|----------|----------|----------|------------|------------|
|                                   | 種類   | 利率       | 額面金額     | 評価額      |            |            |
|                                   |      |          |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額     |            |
| (アメリカ)                            |      | %        | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円         |            |
| ECHO GLOBAL LOGIS TM 2LN 10/28 C1 | 金銭債権 | 12.03414 | 1,915    | 1,905    | 262,415    | 2028/10/25 |
| GREAT OUTDOOR TM B1 1LN 3/5/28 C1 | 金銭債権 | 8.77457  | 6,154    | 6,031    | 830,658    | 2028/03/05 |
| ASURION TM B10 1LN 8/17/28 C1     | 金銭債権 | 9.08221  | 9,432    | 8,710    | 1,199,640  | 2028/08/17 |
| TORY BURCH TERM B 1LN 04/14/28 C1 | 金銭債権 | 8.52457  | 2,984    | 2,768    | 381,339    | 2028/04/16 |
| CORELOGIC TERM B 1LN 06/02/28 C1  | 金銭債権 | 8.56250  | 15,725   | 14,034   | 1,932,850  | 2028/06/02 |
| OATLY GROUP TM B 1LN 3/15/28 C1   | 金銭債権 | 12.48188 | 7,780    | 7,468    | 1,028,603  | 2028/03/15 |
| INTERNET BRANDS TM B 1LN 04/28 C1 | 金銭債権 | 9.28387  | 15,583   | 14,902   | 2,052,317  | 2028/04/25 |
| SFR TERM B14 1LN 08/15/28 C1      | 金銭債権 | 10.48632 | 15,431   | 13,785   | 1,898,552  | 2028/08/15 |
| ASCEND LEARNING TM 2LN 11/29 C1   | 金銭債権 | 10.83221 | 650      | 556      | 76,575     | 2029/11/18 |
| AUTHENTIC BR TM B 2LN 12/20/29 C1 | 金銭債権 | 11.08221 | 370      | 340      | 46,879     | 2029/12/20 |
| ATHENAHEALTH TM B 1LN 02/15/29 C1 | 金銭債権 | 8.46430  | 6,246    | 5,887    | 810,827    | 2029/02/15 |
| HUNTER DOUGLAS TERM B 1LN 2/29 C1 | 金銭債権 | 8.37333  | 2,486    | 2,273    | 313,102    | 2029/02/25 |
| DEL MONTE FOODS TM B 1LN 05/29 C1 | 金銭債権 | 9.31430  | 10,407   | 10,121   | 1,393,931  | 2029/05/16 |
| BAYER ENVIR SCI TERM 1LN 10/29 C1 | 金銭債権 | 9.28355  | 6,249    | 5,918    | 815,069    | 2029/10/04 |
| HUB INTERNAT TM B 1LN 11/10/29 C1 | 金銭債権 | 9.07218  | 343      | 340      | 46,939     | 2029/11/10 |
| USI INC TERM 1LN 11/16/29 C1      | 金銭債権 | 8.64833  | 2,967    | 2,940    | 405,034    | 2029/11/16 |
| NEPTUNE BID US 1 TERM B 04/29 C1  | 金銭債権 | 10.00439 | 32,535   | 29,010   | 3,995,323  | 2029/04/11 |
| HUNTER DOUGLAS TERM B 1LN 2/29 C2 | 金銭債権 | 8.37333  | 912      | 834      | 114,967    | 2029/02/25 |
| HUB INTERNAT TM B 1LN 11/10/29 C3 | 金銭債権 | 9.07218  | 0        | 0        | 117        | 2029/11/10 |
| UBER TERM B 1LN 03/01/30 C1       | 金銭債権 | 7.65560  | 6,354    | 6,305    | 868,380    | 2030/03/03 |
| TOPGLF CLL TERM B 1LN 03/09/30 C1 | 金銭債権 | 8.58221  | 1,185    | 1,172    | 161,478    | 2030/03/09 |
| SUBCOM TERM 1LN 4/27/27 C1        | 金銭債権 | 10.35769 | 16,000   | 15,920   | 2,192,502  | 2027/04/27 |
| 小計                                |      | —        | 366,980  | 336,835  | 46,388,921 | —          |
| 合計                                |      | —        | —        | —        | 46,388,921 | —          |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注3) 決算日時点で受渡しが完了していない新規買付銘柄に関しましては、クーポンレートが確定しておりません。

<補足情報>

フィデリティ・インベストメント・ファンズ・区ーフィデリティ・サステナブル・  
UK・アグリゲート・ボンド・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|         |  |
|---------|--|
| 設 定 形 態 | 英国籍証券投資法人／英ポンド建て   |
| 投 資 目 的 | 主として英ポンド建て（もしくは英ポンドヘッジ）投資適格債券に投資し、インカムの確保と元本の成長を目指します。当ファンドは純資産の70%以上を、各業種で優れたサステナビリティ特性を有する企業の株式に投資する「ベスト・イン・クラス」戦略を採用しています。サステナビリティ特性とは、効果的な企業統治と環境・社会問題への優れた取り組み（ESG）を含む企業の性質を指しています。 |
| 決 算 日   | 6月30日  |

## 総利益計算書

期末 2023年 6月30日

2023年 6月30日

2022年 6月30日

千英ポンド

千英ポンド

千英ポンド

千英ポンド

| 収益              | 千英ポンド    | 千英ポンド             | 千英ポンド    | 千英ポンド             |
|-----------------|----------|-------------------|----------|-------------------|
| 売買損益            |          | (143, 896)        |          | (220, 499)        |
| 配当等収益           | 43, 033  |                   | 26, 828  |                   |
| 費用              | (5, 113) |                   | (5, 003) |                   |
| 支払利息および類似費用     | (810)    |                   | (2, 266) |                   |
| 税引前純利益／（損失）     | 37, 110  |                   | 19, 559  |                   |
| 税額              | —        |                   | —        |                   |
| 税引後純利益／（損失）     |          | 37, 110           |          | 19, 559           |
| <b>総利益</b>      |          | <b>(106, 786)</b> |          | <b>(200, 940)</b> |
| 分配金             |          | (37, 406)         |          | (19, 599)         |
| 受益者に帰属する純資産の変動額 |          | (144, 192)        |          | (220, 539)        |

## ポートフォリオ計算書

2023年 6月30日現在

| 保有数量／<br>保有相当量 | 組入投資資産  | 時価／<br>未実現（損）益<br>（千英ポンド） | 純資産<br>比率（%） |
|----------------|---|---------------------------|--------------|
|                | <b>社債 - (52.03%)</b>                                    |                           |              |
| 12, 512, 000   | AXA 4.25% VRN 10/03/2043 EMTN                           | 9, 826                    | 1. 62        |
| 13, 500, 000   | UBS 1.25% 01/06/2026 144A                               | 9, 387                    | 1. 55        |
| 12, 150, 000   | Bank of America Corporation 5.015% VRN 22/07/2033       | 9, 287                    | 1. 53        |
| 11, 000, 000   | Sumitomo Mitsui Financial Group 5.71% 13/01/2030        | 8, 788                    | 1. 45        |
| 9, 100, 000    | Deutsche Pfandbriefbank 7.625% 08/12/2025 Reg S         | 8, 667                    | 1. 43        |
| 10, 511, 000   | UBS Group 6.442% VRN 11/08/2028 144A                    | 8, 323                    | 1. 37        |
| 10, 300, 000   | First Abu Dhabi Bank 1.625% 07/04/2027 EMTN Reg S       | 8, 055                    | 1. 33        |
| 9, 700, 000    | Deutsche Bank 5.00% VRN 05/09/2030 Reg S                | 7, 999                    | 1. 32        |
| 12, 775, 000   | Zurich Finance (Ireland) DAC 3.50% VRN 02/05/2052 EMTN  | 7, 998                    | 1. 32        |
| 8, 775, 000    | First Abu Dhabi Bank 0.875% 09/12/2025 EMTN Reg S       | 7, 737                    | 1. 28        |
| 7, 200, 000    | Credit Suisse London Branch 7.75% 10/03/2026 EMTN Reg S | 7, 273                    | 1. 20        |
| 6, 961, 000    | RL Finance Bonds No 6 10.125% VRN (Perpetual) Reg S     | 6, 842                    | 1. 13        |
| 6, 740, 000    | Yorkshire Building Society 6.375% VRN 15/11/2028 Reg S  | 6, 410                    | 1. 06        |
| 7, 305, 000    | Logicor 2019-1 UK 1.875% 17/11/2031 Reg S               | 6, 211                    | 1. 02        |
| 6, 339, 000    | Bank of Nova Scotia 1.375% 05/12/2023 EMTN Reg S        | 6, 211                    | 1. 02        |
| 6, 383, 000    | Celanese US Holdings 5.337% 19/01/2029                  | 5, 349                    | 0. 88        |
| 6, 200, 000    | First Abu Dhabi Bank 1.125% 07/09/2026 EMTN Reg S       | 5, 327                    | 0. 88        |
| 5, 898, 000    | AA Bond 7.375% 31/07/2050 EMTN Reg S                    | 5, 322                    | 0. 88        |
| 6, 000, 000    | Pension Insurance 5.625% 20/09/2030 Reg S               | 5, 180                    | 0. 85        |
| 6, 009, 000    | AXA 5.50% VRN 11/07/2043 EMTN Reg S                     | 5, 144                    | 0. 85        |
| 5, 389, 000    | Mizuho Financial Group 5.628% 13/06/2028 EMTN Reg S     | 5, 122                    | 0. 85        |



| 保有数量／<br>保有相当量 | 組入投資資産   | 時価／<br>未実現(損)益<br>(千英ポンド) | 純資産<br>比率(%) |
|----------------|--|---------------------------|--------------|
| 5,900,000      | Coface 6.00% 22/09/2032 Reg S  | 5,116                     | 0.84         |
| 5,953,000      | Westfield Stratford City Finance No 2 1.642% 04/08/2031 Reg S          | 5,024                     | 0.83         |
| 7,500,000      | CPI Property Group 2.75% 22/01/2028 EMTN Reg S                         | 4,974                     | 0.82         |
| 5,027,000      | Natwest Markets 6.375% 08/11/2027 Reg S                                | 4,934                     | 0.81         |
| 5,628,000      | Athora Holding 6.625% 16/06/2028 Reg S                                 | 4,785                     | 0.79         |
| 4,727,000      | DNB Bank 1.625% 15/12/2023 EMTN Reg S                                  | 4,633                     | 0.76         |
| 6,230,000      | UBS Group 4.988% VRN 05/08/2033 144A                                   | 4,526                     | 0.75         |
| 5,411,000      | Aviva 6.875% VRN (Perpetual) Reg S                                     | 4,486                     | 0.74         |
| 5,850,000      | Scentre Group Trust 2 3.625% 28/01/2026 144A                           | 4,381                     | 0.72         |
| 4,558,000      | Lloyds Banking Group 6.625% VRN 02/06/2033 EMTN Reg S                  | 4,313                     | 0.71         |
| 5,422,000      | Athene Global Funding 1.75% 24/11/2027 Reg S                           | 4,275                     | 0.71         |
| 4,152,000      | Rothsay Life 7.734% 16/05/2033 EMTN Reg S                              | 4,003                     | 0.66         |
| 5,250,000      | Hammerson Ireland 1.75% 03/06/2027 Reg S                               | 3,686                     | 0.61         |
| 3,901,000      | UBS Group 9.016% VRN 15/11/2033 144A                                   | 3,660                     | 0.60         |
| 4,305,000      | Blackstone Property Partners EUR Holdings 2.00% 20/10/2025 EMTN Reg S  | 3,656                     | 0.60         |
| 3,589,000      | United Utilities Water Finance 5.75% 26/06/2036 EMTN Reg S             | 3,513                     | 0.58         |
| 3,400,000      | Societe Generale France 6.25% 22/06/2033 EMTN Reg S                    | 3,360                     | 0.55         |
| 4,232,000      | Investec 1.875% FRN SNR 16/07/2028 GBP                                 | 3,310                     | 0.55         |
| 3,280,000      | Anglian Water Services Finance 5.875% 20/06/2031 GMTN Reg S            | 3,234                     | 0.53         |
| 3,100,000      | Ladbrokes Group Finance 5.125% 08/09/2023 Reg S                        | 3,085                     | 0.51         |
| 3,100,000      | Volkswagen Finance Services 1.125% 18/09/2023 EMTN Reg S               | 3,069                     | 0.51         |
| 3,254,000      | Wessex Water Services Finance 5.125% 31/10/2032 Reg S                  | 3,005                     | 0.50         |
| 3,800,000      | Investec 2.625% VRN 04/01/2032 EMTN Reg S                              | 2,976                     | 0.49         |
| 2,750,000      | Lloyds TSB Bank 6.00% 08/02/2029 Reg S                                 | 2,808                     | 0.46         |
| 3,850,000      | Prosus 3.257% 19/01/2027 Reg S   | 2,753                     | 0.45         |
| 2,689,000      | Arqiva Financing 7.21% 30/06/2045 Reg S                                | 2,676                     | 0.44         |
| 2,900,000      | Hammerson 6.00% 23/02/2026   | 2,616                     | 0.43         |
| 3,188,000      | Selp Finance SARL 3.75% 10/08/2027 EMTN Reg S                          | 2,559                     | 0.42         |
| 3,833,000      | Canary Wharf Group Investment Holdings PLC 3.375% 23/04/2028 REGS      | 2,539                     | 0.42         |
| 2,680,000      | British Land 5.264% 24/09/2035   | 2,415                     | 0.40         |
| 2,448,000      | Investec 9.125% VRN 06/03/2033 EMTN Reg S                              | 2,379                     | 0.39         |
| 3,145,000      | Anglian Water (Osprey) Financing 2.00% 31/07/2028 EMTN Reg S           | 2,360                     | 0.39         |
| 2,788,000      | Bank of America Corporation 3.648% VRN 31/03/2029 EMTN Reg S           | 2,317                     | 0.38         |
| 3,018,000      | Blackstone Property Partners EUR Holdings 2.625% 20/10/2028 EMTN Reg S | 2,205                     | 0.36         |
| 2,558,000      | Permanent TSB Group Holdings 6.625% VRN 30/06/2029 Reg S               | 2,193                     | 0.36         |
| 2,500,000      | M&G 6.25% VRN 20/10/2068 Reg S   | 2,101                     | 0.35         |
| 2,330,000      | AA Bond 5.50% 31/07/2050 Reg S   | 2,028                     | 0.33         |
| 2,194,000      | Jerrold Finco 4.875% 15/01/2026 Reg S                                  | 1,920                     | 0.32         |
| 1,900,000      | Lloyds Bank 5.125% 07/03/2025 EMTN Reg S                               | 1,867                     | 0.31         |
| 2,378,000      | MPT Operating Partnership 2.50% 24/03/2026                             | 1,856                     | 0.31         |

| 保有数量／<br>保有相当量 | 組入投資資産   | 時価／<br>未実現（損）益<br>（千英ポンド） | 純資産<br>比率（%） |
|----------------|--|---------------------------|--------------|
| 2,275,000      | Glencore Funding 4.125% 12/03/2024 144A                        | 1,777                     | 0.29         |
| 1,725,000      | Anglian Water Services Finance 6.00% 20/06/2039 GMTN Reg S     | 1,713                     | 0.28         |
| 1,963,000      | Phoenix Group Holdings 5.625% 28/04/2031 EMTN Reg S            | 1,700                     | 0.28         |
| 1,750,000      | Clydesdale Bank 4.625% 08/06/2026 EMTN                         | 1,685                     | 0.28         |
| 1,875,000      | QBE Insurance Group 5.875% VRN (Perpetual)                     | 1,407                     | 0.23         |
| 2,727,000      | University of Oxford 2.544% 08/12/2117 Reg S                   | 1,404                     | 0.23         |
| 4,629,000      | CPI Property Group 4.875% VRN (Perpetual) Reg S                | 1,384                     | 0.23         |
| 1,705,000      | AA Bond Co Ltd. 3.25% 31/07/2050 REGS                          | 1,293                     | 0.21         |
| 1,200,000      | Walmart Stores 5.625% 27/03/2034                               | 1,234                     | 0.20         |
| 1,493,000      | NewRiver (REIT) 3.50% 07/03/2028 Reg S                         | 1,215                     | 0.20         |
| 1,192,000      | Close Brothers Group 7.75% 14/06/2028 Reg S                    | 1,175                     | 0.19         |
| 1,438,000      | Canary Wharf Group Investment Holdings 2.625% 23/04/2025 Reg S | 1,150                     | 0.19         |
| 1,250,000      | Society of Lloyds 4.875% VRN 07/02/2047 Reg S                  | 1,126                     | 0.19         |
| 1,212,000      | Travis Perkins 3.75% 17/02/2026 Reg S                          | 1,084                     | 0.18         |
| 1,457,000      | International Business Machines 2.20% 09/02/2027               | 1,046                     | 0.17         |
| 1,100,000      | Volkswagen International Finance 2.625% 16/11/2027 Reg S       | 880                       | 0.15         |
| 956,000        | AA Bond 7.375% 31/07/2050 Reg S                                | 860                       | 0.14         |
| 850,000        | Lloyds Bank 4.875% 30/03/2027 EMTN                             | 820                       | 0.14         |
| 850,000        | CPUK Finance 3.588% 28/02/2042 EMTN Reg S                      | 783                       | 0.13         |
| 1,005,000      | Phoenix Group Holdings 5.625% VRN (Perpetual) Reg S            | 698                       | 0.12         |
| 680,000        | Massachusetts Institute of Technology 5.60% 01/07/2111         | 594                       | 0.10         |
| 1,688,000      | Aroundtown 4.75% VRN (Perpetual)                               | 591                       | 0.10         |
| 600,000        | Virgin Money UK 9.25% VRN (Perpetual)                          | 562                       | 0.09         |
| 550,000        | Santander UK 5.75% 02/03/2026 EMTN Reg S                       | 546                       | 0.09         |
| 525,000        | UNITE (USAF) II 3.921% 30/06/2025 Reg S                        | 492                       | 0.08         |
| 340,000        | Peel Land & Property Investments 8.375% STEP 30/04/2040        | 340                       | 0.06         |
| 375,000        | Digital Stout Holding 3.75% 17/10/2030 Reg S                   | 305                       | 0.05         |
| 280,000        | London Merchant Securities 6.50% 16/03/2026                    | 275                       | 0.05         |
| 356,000        | Land Securities Capital Markets 2.625% 22/09/2039 EMTN Reg S   | 248                       | 0.04         |
| 300,000        | Phoenix Group Holdings 5.375% 06/07/2027 EMTN Reg S            | 227                       | 0.04         |
| 68,000         | Microsoft 2.675% 01/06/2060                                    | 35                        | 0.01         |
|                |  | 310,703                   | 51.27        |
|                | <b>英国国債 - (41.22%)</b>   |                           |              |
| 54,260,000     | UK Gilt 4.25% 07/12/2027                                       | 52,918                    | 8.73         |
| 52,500,000     | UK Gilt 0.875% 22/10/2029 Reg S                                | 42,038                    | 6.94         |
| 52,870,000     | UK Gilt 1.50% 22/07/2047 Reg S                                 | 29,655                    | 4.89         |
| 30,580,000     | UK Gilt 4.00% 22/01/2060 Reg S                                 | 28,910                    | 4.77         |
| 27,815,000     | UK Gilt 3.75% 22/07/2052 Reg S                                 | 24,633                    | 4.06         |
| 20,000,000     | UK Gilt 2.00% 07/09/2025 Reg S                                 | 18,624                    | 3.07         |
| 16,850,000     | UK Gilt 4.25% 07/12/2049                                       | 16,171                    | 2.67         |

| 保有数量/<br>保有相当量 | 組入投資資産  | 時価/<br>未実現(損)益<br>(千英ポンド) | 純資産<br>比率(%) |
|----------------|---|---------------------------|--------------|
| 14,580,000     | UK Gilt 4.25% 07/09/2039 Reg S  | 14,070                    | 2.32         |
| 14,190,000     | UK Gilt 4.25% 07/12/2055  | 13,834                    | 2.28         |
| 8,100,000      | UK Gilt 3.50% 22/07/2068  | 6,973                     | 1.15         |
| 3,730,000      | UK Gilt 1.25% 31/07/2051 Reg S  | 1,833                     | 0.30         |
| 1,700,000      | UK Gilt 3.50% 22/01/2045 Reg S  | 1,453                     | 0.24         |
| 2,454,000      | UK Gilt 1.50% 31/07/2053 Reg S  | 1,269                     | 0.21         |
| 1,000,000      | UK Gilt 2.50% 22/07/2065 Reg S  | 666                       | 0.11         |
| 550,000        | UK Gilt 1.75% 22/01/2049 Reg S  | 323                       | 0.05         |
| 100,000        | UK Gilt 6.00% 07/12/2028  | 106                       | 0.02         |
|                |   | <b>253,476</b>            | <b>41.83</b> |
|                | <b>モーゲージ証券 - (2.70%)</b>  |                           |              |
| 3,677,617      | Tesco Property Finance 2 6.0517% 13/10/2039                                 | 3,497                     | 0.58         |
| 2,940,947      | Together Asset Backed Securitisation 2021-Crel 6.0101% VRN 20/01/2055 Reg S | 2,902                     | 0.48         |
| 2,900,000      | Sage AR Funding No 1 5.9873% VRN 17/11/2051 Reg S                           | 2,659                     | 0.44         |
| 5,336,067      | Intu (SGS) Finance 4.625% 17/03/2028 Reg S                                  | 2,481                     | 0.41         |
| 2,363,750      | Income Contingent Student Loans 1 2002-2006 2.50% 24/07/2056 Reg S          | 1,725                     | 0.28         |
| 3,238,897      | Metrocentre Finance 8.75% VRN 06/12/2028                                    | 1,474                     | 0.24         |
| 1,636,000      | NATS (En Route) 1.375% 31/03/2031 Reg S                                     | 1,331                     | 0.22         |
| 1,200,000      | Broadgate Financing 4.999% 05/10/2033 Reg S                                 | 1,101                     | 0.18         |
| 1,605,000      | Dignity Finance 4.6956% 31/12/2049 Reg S                                    | 1,013                     | 0.17         |
| 1,353,000      | Income Contingent Student Loans 2 2007-2009 2.50% 24/07/2058 Reg S          | 981                       | 0.16         |
| 1,044,000      | Telereal Securitisation 1.9632% VRN 10/12/2033 Reg S                        | 906                       | 0.15         |
| 937,365        | Marstons Issuer 5.158% VRN 15/10/2027                                       | 852                       | 0.14         |
| 1,740,156      | Intu (SGS) Finance 4.25% 17/09/2035 EMTN Reg S                              | 809                       | 0.13         |
| 500,000        | RHP Finance 3.25% 05/02/2048 Reg S  | 355                       | 0.06         |
| 312,881        | Equity Release Funding 3 5.05% 26/04/2033                                   | 294                       | 0.05         |
| 297,107        | Juturna European Loan Conduit No 16 5.0636% 10/08/2033 EMTN Reg S           | 280                       | 0.05         |
| 313,139        | Premiertel 6.175% 08/05/2032  | 279                       | 0.05         |
| 284,764        | Tesco Property Finance 5 5.6611% 13/10/2041 Reg S                           | 259                       | 0.04         |
| 202,019        | Equity Release Funding 3 5.70% 26/02/2031                                   | 197                       | 0.03         |
| 190,000        | Peel South East 10.00% 30/04/2026   | 191                       | 0.03         |
| 156,943        | Longstone Finance 4.791% 19/04/2036   | 148                       | 0.02         |
| 160,914        | Meadowhall Finance 4.986% 12/07/2037 Reg S                                  | 140                       | 0.02         |
| 110,089        | Dignity Finance 3.5456% 31/12/2034 Reg S                                    | 95                        | 0.02         |
| 12,088         | Equity Release Funding 2 5.88% 26/05/2032                                   | 12                        | 0.00         |
|                |   | <b>23,981</b>             | <b>3.96</b>  |
|                | <b>金融 - (0.53%)</b>   |                           |              |
| 553            | Fidelity Institutional Liquidity Fund - Sterling A Accumulation             | 12,008                    | 1.98         |
|                |   | <b>12,008</b>             | <b>1.98</b>  |
|                | <b>スワップ - ((0.21)%)</b>   |                           |              |
| 36,000,000     | Pay fixed 1.4062% receive float SOFR Overnight Deposit Rate Swap 28/01/2027 | 2,624                     | 0.43         |

| 保有数量／<br>保有相当量 | 組入投資資産   | 時価／<br>未実現（損）益<br>（千英ポンド） | 純資産<br>比率（%） |
|----------------|--|---------------------------|--------------|
| 20,000,000     | Pay fixed 3.4986% receive float SONIA Overnight Deposit Rates Swap 07/03/2053      | 1,284                     | 0.21         |
| 101,800,000    | Pay fixed 2.305% receive float 3 Month STIBOR 03/05/2032                           | 437                       | 0.07         |
| 12,100,000     | Pay fixed 3.9863% receive float 6 Month AUD Bank Bill 09/12/2032                   | 211                       | 0.03         |
| 5,000,000      | Pay fixed 3.295% receive float 3 Month CDOR 18/08/2032                             | 137                       | 0.02         |
| 10,700,000     | Pay fixed 3.6392% receive float 3 Month CDOR 29/09/2032                            | 128                       | 0.02         |
| 36,400,000     | Pay fixed 2.5392% receive float 3 Month STIBOR 09/05/2032                          | 109                       | 0.02         |
| 376,000        | Bought Protection on Credit Suisse Group 4.282% 20/12/2027                         | (1)                       | 0.00         |
| 324,000        | Bought Protection on Credit Suisse Group 4.282% 20/12/2027                         | (1)                       | 0.00         |
| 1,050,000      | Bought Protection on Credit Suisse Group 4.282% 20/12/2027                         | (2)                       | 0.00         |
| 3,150,000      | Bought Protection on Credit Suisse Group 4.282% 20/12/2027                         | (7)                       | 0.00         |
| 3,150,000      | Bought Protection on Credit Suisse Group 4.282% 20/12/2027                         | (7)                       | 0.00         |
| 3,950,000      | Bought Protection on Credit Suisse Group 4.282% 20/12/2027                         | (8)                       | 0.00         |
| 9,800,000      | Receive fixed 2.9793% pay float 6 Month EURIBOR 27/03/2033                         | (35)                      | (0.01)       |
| 9,500,000      | Pay fixed 1.85% receive float SARON Fixing 3 Month (Market Close) Index 27/03/2033 | (44)                      | (0.01)       |
| 5,800,000      | Receive fixed 3.7886% pay float SONIA Overnight Deposit Rates Swap 02/03/2033      | (283)                     | (0.05)       |
| 10,500,000     | Receive fixed 2.5143% pay float SOFR Overnight Deposit Rates Swap 01/08/2032       | (691)                     | (0.11)       |
|                |  | <b>3,851</b>              | <b>0.64</b>  |
|                | <b>国債 - (1.83%)</b>  |                           |              |
| 4,150,000      | Abu Dhabi 2.125% 30/09/2024 Reg S  | 3,147                     | 0.52         |
| 200,000        | Qatar 3.25% 02/06/2026 Reg S   | 151                       | 0.02         |
|                |  | <b>3,298</b>              | <b>0.54</b>  |
|                | <b>外国為替先物取引 - ((0.21)%)</b>  |                           |              |
| (133,715,000)  | Bought GBP sold EUR @ 1.145127 for settlement 18/08/2023                           | 1,774                     | 0.29         |
| (175,613,000)  | Bought GBP sold USD @ 1.263791 for settlement 18/08/2023                           | 134                       | 0.02         |
| (4,051,000)    | Bought GBP sold EUR @ 1.145579 for settlement 18/08/2023                           | 52                        | 0.01         |
| (3,108,000)    | Bought GBP sold EUR @ 1.161140 for settlement 18/08/2023                           | 4                         | 0.00         |
| (642,000)      | Bought GBP sold SEK @ 12.797864 for settlement 18/08/2023                          | 3                         | 0.00         |
| (92,000)       | Bought GBP sold CHF @ 1.115334 for settlement 18/08/2023                           | 1                         | 0.00         |
| 8,799,000      | Bought USD sold GBP @ 0.794886 for settlement 18/08/2023                           | 1                         | 0.00         |
| 20,222,000     | Bought USD sold GBP @ 0.794886 for settlement 18/08/2023                           | 1                         | 0.00         |
| (354,000)      | Bought GBP sold CAD @ 1.688308 for settlement 18/08/2023                           | (1)                       | 0.00         |
| 2,591,000      | Bought EUR sold GBP @ 0.866902 for settlement 18/08/2023                           | (1)                       | 0.00         |
| 6,792,000      | Bought USD sold GBP @ 0.794886 for settlement 18/08/2023                           | (4)                       | 0.00         |
| 12,966,000     | Bought USD sold GBP @ 0.794886 for settlement 18/08/2023                           | (6)                       | 0.00         |
| 2,516,000      | Bought EUR sold GBP @ 0.866902 for settlement 18/08/2023                           | (7)                       | 0.00         |
| 6,477,000      | Bought USD sold GBP @ 0.794886 for settlement 18/08/2023                           | (12)                      | 0.00         |
| (6,939,000)    | Bought GBP sold EUR @ 1.165170 for settlement 18/08/2023                           | (12)                      | 0.00         |
| 5,172,000      | Bought EUR sold GBP @ 0.866902 for settlement 18/08/2023                           | (28)                      | 0.00         |
| 2,672,000      | Bought USD sold GBP @ 0.794886 for settlement 18/08/2023                           | (29)                      | 0.00         |
| 3,235,000      | Bought EUR sold GBP @ 0.866902 for settlement 18/08/2023                           | (44)                      | (0.01)       |

| 保有数量／<br>保有相当量 | 組入投資資産   | 時価／<br>未実現（損）益<br>（千英ポンド） | 純資産<br>比率（％）  |
|----------------|--|---------------------------|---------------|
| 4,845,000      | Bought USD sold GBP @ 0.794886 for settlement 18/08/2023   | (45)                      | (0.01)        |
| 6,616,000      | Bought EUR sold GBP @ 0.866902 for settlement 18/08/2023   | (48)                      | (0.01)        |
| 13,947,000     | Bought EUR sold GBP @ 0.866902 for settlement 18/08/2023   | (49)                      | (0.01)        |
| 11,334,000     | Bought EUR sold GBP @ 0.866902 for settlement 18/08/2023   | (53)                      | (0.01)        |
| 4,240,000      | Bought USD sold GBP @ 0.794886 for settlement 18/08/2023   | (57)                      | (0.01)        |
| 8,192,000      | Bought USD sold GBP @ 0.794886 for settlement 18/08/2023   | (83)                      | (0.01)        |
| 11,558,000     | Bought EUR sold GBP @ 0.866902 for settlement 18/08/2023   | (84)                      | (0.01)        |
| 8,237,000      | Bought EUR sold GBP @ 0.866902 for settlement 18/08/2023   | (93)                      | (0.02)        |
| 11,273,000     | Bought EUR sold GBP @ 0.866902 for settlement 18/08/2023   | (120)                     | (0.02)        |
| 9,157,000      | Bought USD sold GBP @ 0.794886 for settlement 18/08/2023   | (137)                     | (0.02)        |
|                |  | <b>1,057</b>              | <b>0.17</b>   |
|                | <b>先物取引 - ((0.05)%)</b>                                    |                           |               |
| (25,500,000)   | US 10 Year Treasury Note (CBT) Commodity Future 20/09/2023 | 501                       | 0.08          |
| (30,600,000)   | Euro-Bobl Commodity Future 07/09/2023                      | 267                       | 0.04          |
| (12,700,000)   | US 10 Year Ultra Future 20/09/2023                         | 193                       | 0.03          |
| (6,400,000)    | US 20 Year Long Bond (CBT) Commodity Future 20/09/2023     | 83                        | 0.01          |
| (14,500,000)   | Euro-Schatz Commodity Future 07/09/2023                    | 79                        | 0.01          |
| (13,100,000)   | Euro-Bund Commodity Future 07/09/2023                      | 76                        | 0.01          |
| 3,200,000      | US 2 Year Treasury Note (CBT) Commodity Future 29/09/2023  | (9)                       | 0.00          |
| (700,000)      | Euro-Buxl 30 Year Commodity Future 07/09/2023              | (13)                      | 0.00          |
| 3,000,000      | US Ultra Bond Commodity Future 20/09/2023                  | (26)                      | 0.00          |
| 8,600,000      | US 5 Year Treasury Note (CBT) Commodity Future 29/09/2023  | (90)                      | (0.01)        |
| 112,300,000    | Long Gilt Commodity Future 27/09/2023                      | (718)                     | (0.12)        |
|                |  | <b>343</b>                | <b>0.06</b>   |
|                | <b>組入投資資産</b>  | <b>608,717</b>            | <b>100.45</b> |
|                | <b>現金その他純資産（負債控除後）</b>                                     | <b>(2,730)</b>            | <b>(0.45)</b> |
|                | <b>純資産額</b>  | <b>605,987</b>            | <b>100.00</b> |

カッコ内の数字は2022年6月30日現在の割合を示す。当期中に有価証券の分類の変更があった場合、割合は修正されている。

純資産比率は端数処理されている。

特に記載のない限り、すべての保有資産は証券取引所に上場されているか、認可された集団投資スキームである。

保有数量／保有相当量がゼロの場合、単元未満株によるものである。

<補足情報>

## フィデリティ・ファンズーユーロ・ボンド・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|      |                        |
|------|------------------------|
| 設定形態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／ユーロ建て   |
| 投資目的 | 主としてユーロ建ての債券に投資を行いません。 |
| 決算日  | 4月30日                  |

## 運用および純資産変動計算書

2023年4月30日に終了した年度

| 通貨                       | EUR                  |
|--------------------------|----------------------|
| <b>投資収益</b>              |                      |
| 受取配当金および受取利息             | 23,534,472           |
| スワップ取引に係る受取利息            | 10,247,472           |
| デリバティブ収益                 | —                    |
| <b>純利益</b>               | <b>33,781,944</b>    |
| <b>費用</b>                |                      |
| 運用報酬                     | 6,798,388            |
| 管理費                      | 1,950,180            |
| 国税                       | 441,025              |
| 保管費用                     | 122,541              |
| 販売手数料                    | 343,611              |
| 成功報酬                     | —                    |
| その他費用                    | 193,206              |
| <b>費用合計</b>              | <b>9,848,951</b>     |
| スワップ取引に係る支払利息            | 11,545,211           |
| デリバティブ費用                 | 10,317               |
| 差金決済取引に係る財務費用            | —                    |
| 還付ブローカー費用                | —                    |
| 管理費用の払戻                  | —                    |
| 払戻費用                     | (382,535)            |
| 費用還付                     | —                    |
| <b>総費用</b>               | <b>21,021,944</b>    |
| <b>純投資収益(損失)</b>         | <b>12,760,000</b>    |
| 有価証券に係る実現純(損)益           | (146,843,351)        |
| 外貨取引に係る実現純(損)益           | (516,298)            |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益         | —                    |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益       | 2,643,960            |
| オプション取引に係る実現純(損)益        | —                    |
| 先物取引に係る実現純(損)益           | 19,628,786           |
| スワップ取引に係る実現純(損)益         | (68,737,696)         |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額     | 46,713,120           |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額     | (436,905)            |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額   | —                    |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (1,338,366)          |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額  | —                    |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額     | (10,451,998)         |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額   | 26,759,942           |
| <b>運用実績</b>              | <b>(119,818,806)</b> |
| <b>受益者への分配金</b>          | <b>(769,984)</b>     |
| <b>設定解約</b>              |                      |
| 当期設定額                    | 450,293,895          |
| 当期解約額                    | (314,758,439)        |
| 調整勘定                     | 1,168,148            |
| <b>設定解約に伴う増加(減少)額</b>    | <b>136,703,604</b>   |
| <b>純増加(減少)</b>           | <b>16,114,814</b>    |
| <b>純資産額</b>              |                      |
| 期首                       | 1,159,532,605        |
| 期末                       | 1,175,647,419        |

投資資産明細表 2023年4月30日現在

| 国コード             | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR            | % Net<br>Assets |
|------------------|------------------|-------------------|-----------------|
| 公認の証券取引所で取引される証券 |                  |                   |                 |
| エネルギー            |                  |                   |                 |
| US               | EUR              | 20,686,611        | 13,819,484 1.18 |
| US               | EUR              | 16,492,119        | 11,896,404 1.01 |
| FR               | EUR              | 6,093,147         | 6,340,102 0.54  |
| DE               | EUR              |                   |                 |
|                  |                  | <b>32,058,502</b> | <b>2.73</b>     |

| 国コード | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR             | % Net<br>Assets |
|------|------------------|--------------------|-----------------|
| 公益事業 |                  |                    |                 |
| GB   | EUR              | 25,801,846         | 25,737,032 2.19 |
| GB   | EUR              | 25,528,031         | 25,629,351 2.18 |
| FR   | EUR              | 23,695,573         | 22,455,285 1.91 |
| FR   | EUR              | 23,093,781         | 20,646,777 1.76 |
| GB   | EUR              | 24,175,246         | 18,762,476 1.60 |
| DE   | EUR              | 14,523,410         | 13,235,685 1.13 |
| DK   | EUR              | 7,748,076          | 7,707,972 0.66  |
| DE   | EUR              | 4,618,756          | 4,591,548 0.39  |
|      |                  | <b>138,761,726</b> | <b>11.80</b>    |

| 国コード | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR            | % Net<br>Assets |
|------|------------------|-------------------|-----------------|
| 素材   |                  |                   |                 |
| US   | EUR              | 18,514,893        | 18,195,900 1.55 |
| US   | EUR              | 12,729,412        | 13,012,056 1.11 |
|      |                  | <b>31,207,956</b> | <b>2.65</b>     |

| 国コード     | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR            | % Net<br>Assets |
|----------|------------------|-------------------|-----------------|
| 資本財・サービス |                  |                   |                 |
| US       | EUR              | 32,739,760        | 33,516,805 2.85 |
| FR       | EUR              | 24,447,813        | 27,062,727 2.30 |
|          |                  | <b>60,579,532</b> | <b>5.15</b>     |

| 国コード       | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR            | % Net<br>Assets |
|------------|------------------|-------------------|-----------------|
| 一般消費財・サービス |                  |                   |                 |
| NL         | EUR              | 45,780,392        | 36,226,917 3.08 |
|            |                  | <b>36,226,917</b> | <b>3.08</b>     |

| 国コード  | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR            | % Net<br>Assets |
|-------|------------------|-------------------|-----------------|
| ヘルスケア |                  |                   |                 |
| GB    | EUR              | 17,479,810        | 17,986,064 1.53 |
| DE    | EUR              | 15,496,153        | 14,249,952 1.21 |
|       |                  | <b>32,236,016</b> | <b>2.74</b>     |

| 国コード | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR             | % Net<br>Assets |
|------|------------------|--------------------|-----------------|
| 金融   |                  |                    |                 |
| DE   | EUR              | 39,643,070         | 34,413,634 2.93 |
| GB   | EUR              | 34,021,577         | 34,338,522 2.92 |
| FR   | EUR              | 31,211,977         | 31,413,090 2.67 |
| SG   | EUR              | 25,698,789         | 25,746,024 2.19 |
| GB   | EUR              | 23,539,107         | 23,750,394 2.02 |
| GB   | EUR              | 19,373,932         | 19,904,914 1.69 |
| CH   | EUR              | 18,789,461         | 18,783,054 1.60 |
| US   | EUR              | 21,220,702         | 18,782,528 1.60 |
| US   | EUR              | 19,559,755         | 17,757,637 1.51 |
| NL   | EUR              | 14,676,963         | 14,713,655 1.25 |
| IT   | EUR              | 10,738,232         | 8,103,920 0.69  |
| DE   | EUR              | 4,062,098          | 4,080,581 0.35  |
| FI   | EUR              | 4,489,371          | 3,516,493 0.30  |
| IT   | EUR              | 2,983,385          | 2,564,023 0.22  |
|      |                  | <b>257,868,469</b> | <b>21.93</b>    |

| 国コード | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR             | % Net<br>Assets   |
|------|------------------|--------------------|-------------------|
| 国債   |                  |                    |                   |
| DE   | EUR              | 198,987,978        | 189,439,739 16.11 |
| DE   | EUR              | 81,475,159         | 80,045,759 6.81   |
| DE   | EUR              | 29,529,264         | 26,472,978 2.18   |
| DE   | EUR              | 11,238,472         | 9,257,574 0.79    |
| DE   | EUR              | 9,064,497          | 9,035,282 0.77    |
| DE   | EUR              | 5,266,568          | 503,999 0.04      |
| DE   | EUR              | 284,497            | 262,140 0.02      |
|      |                  | <b>314,197,471</b> | <b>26.73</b>      |

| 国コード         | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR | % Net<br>Assets        |
|--------------|------------------|--------|------------------------|
| オープンエンド型ファンド |                  |        |                        |
| IE           | EUR              | 1,148  | 15,807,525 1.34        |
|              |                  |        | <b>15,807,525 1.34</b> |

| 国コード           | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR           | % Net<br>Assets |
|----------------|------------------|------------------|-----------------|
| コミュニケーション・サービス |                  |                  |                 |
| FR             | EUR              | 8,349,869        | 8,313,421 0.71  |
|                |                  | <b>8,313,421</b> | <b>0.71</b>     |

| 国コード           | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR            | % Net<br>Assets |
|----------------|------------------|-------------------|-----------------|
| その他の市場で取引される証券 |                  |                   |                 |
| 公益事業           |                  |                   |                 |
| DE             | EUR              | 17,227,810        | 16,940,434 1.44 |
| IT             | EUR              | 10,964,656        | 11,032,964 0.94 |
| PT             | EUR              | 9,102,109         | 6,910,085 0.59  |
| PT             | EUR              | 1,203,585         | 1,188,540 0.10  |
|                |                  | <b>36,092,025</b> | <b>3.07</b>     |

| 国コード       | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR     | % Net<br>Assets        |
|------------|------------------|------------|------------------------|
| 素材         |                  |            |                        |
| DE         | EUR              | 24,222,141 | 25,253,641 2.15        |
|            |                  |            | <b>25,253,641 2.15</b> |
| 一般消費財・サービス |                  |            |                        |
| US         | EUR              | 24,833,713 | 25,532,409 2.17        |
|            |                  |            | <b>25,532,409 2.17</b> |

| 国コード  | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR    | % Net<br>Assets       |
|-------|------------------|-----------|-----------------------|
| 生活必需品 |                  |           |                       |
| NL    | EUR              | 7,793,211 | 7,953,930 0.68        |
|       |                  |           | <b>7,953,930 0.68</b> |

| 国コード | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR             | % Net<br>Assets |
|------|------------------|--------------------|-----------------|
| 金融   |                  |                    |                 |
| NL   | EUR              | 30,205,462         | 31,730,294 2.70 |
| ES   | EUR              | 28,284,240         | 28,866,471 2.46 |
| NL   | EUR              | 27,984,848         | 27,796,111 2.36 |
| IE   | EUR              | 9,989,753          | 9,089,196 0.77  |
| IE   | EUR              | 5,040,011          | 5,119,794 0.44  |
| ES   | EUR              | 5,717,027          | 4,913,568 0.42  |
|      |                  | <b>107,515,434</b> | <b>9.15</b>     |

| 国コード | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR            | % Net<br>Assets |
|------|------------------|-------------------|-----------------|
| 不動産  |                  |                   |                 |
| LU   | EUR              | 25,162,442        | 22,448,151 1.91 |
| LU   | EUR              | 14,764,975        | 14,497,286 1.23 |
|      |                  | <b>36,945,437</b> | <b>3.14</b>     |

| 国コード | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR | % Net<br>Assets |
|------|------------------|--------|-----------------|
| 非上場  |                  |        |                 |

| 国コード | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR    | % Net<br>Assets |
|------|------------------|-----------|-----------------|
| 公益事業 |                  |           |                 |
| GB   | EUR              | 3,197,022 | 32 0.00         |
|      |                  |           | <b>32 0.00</b>  |

| 国コード | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR | % Net<br>Assets |
|------|------------------|--------|-----------------|
| その他  |                  |        |                 |
|      |                  |        | 1 0.00          |

| 国コード                                       | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR               | % Net<br>Assets |
|--|------------------|----------------------|-----------------|
| Total Investments (Cost EUR 1,177,973,204) |                  |                      |                 |
|  |                  | <b>1,166,550,644</b> | <b>99.23</b>    |

| 国コード             | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR      | % Net<br>Assets                         |
|------------------|------------------|-------------|---|
| クレジット・デフォルト・スワップ |                  |             |   |
| USD              | EUR              | 85,021,973  | (1,075,704) (0.09)                      |
| USD              | EUR              | 165,109,248 | (4,398,938) (0.37)                      |
|                  |                  |             | <b>(5,474,642) (0.47)</b>               |
|                  | 契約額等 EUR         |             | Unrealised % Net gain/(loss) Assets EUR |
|                  |                  |             | <b>11,161 0.00</b>                      |

| 国コード     | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR    | % Net<br>Assets    |
|----------|------------------|-----------|--------------------|
| 外国為替先物取引 |                  |           |                    |
|          |                  | 2,090,671 | 64,313 0.01        |
|          |                  | 1,333,645 | 49,347 0.00        |
|          |                  | 1,527,667 | 41,802 0.00        |
|          |                  | 1,388,108 | 33,210 0.00        |
|          |                  | 1,864,771 | (29,392) (0.00)    |
|          |                  | 1,560,879 | (32,531) (0.00)    |
|          |                  | 2,649,699 | (56,613) (0.00)    |
|          |                  | 1,752,753 | (58,975) (0.01)    |
|          |                  |           | <b>11,161 0.00</b> |

| 国コード                        | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR  | % Net<br>Assets    |
|-----------------------------|------------------|---------|--------------------|
| A-ACC Shares (HUF) (hedged) |                  |         |                    |
|                             |                  | 668,502 | 21,969 0.00        |
|                             |                  | 720,195 | 510 0.00           |
|                             |                  | 17,751  | 291 0.00           |
|                             |                  | 18,749  | 150 0.00           |
|                             |                  | 16,424  | 20 0.00            |
|                             |                  | 11,750  | (299) (0.00)       |
|                             |                  | 732,107 | (959) (0.00)       |
|                             |                  |         | <b>21,682 0.00</b> |

| 国コード                        | 株数または額面<br>通貨 価額 | 時価 EUR     | % Net<br>Assets |
|-----------------------------|------------------|------------|-----------------|
| A-ACC Shares (USD) (hedged) |                  |            |                 |
|                             |                  | 17,925,638 | 89,254 0.01     |
|                             |                  | 1,590,605  | 10,016 0.00     |
|                             |                  | 678,868    | 6,336 0.00      |
|                             |                  | 3,991,116  | 3,991 0.00      |
|                             |                  | 443,827    | 2,905 0.00      |
|                             |                  | 377,646    | (4,169) (0.00)  |
|                             |                  | 17,944,777 | (91,229) (0.01) |



|  | 契約額等 EUR   | Unrealised gain/(loss) EUR | % Net Assets  |
|--|------------|----------------------------|---------------|
| Bought USD Sold EUR at 1.090678 09/05/2023 | 20,922,124 | (261,546)                  | (0.02)        |
|  |            | <b>(244,442)</b>           | <b>(0.02)</b> |

#### Y-ACC Shares (USD) (hedged)

|  |        |              |               |
|--|--------|--------------|---------------|
| Bought EUR Sold USD at 0.909907 09/05/2023 | 47,171 | 235          | 0.00          |
| Bought EUR Sold USD at 0.905738 09/05/2023 | 724    | 0            | 0.00          |
| Bought USD Sold EUR at 1.092299 09/05/2023 | 732    | (8)          | (0.00)        |
| Bought USD Sold EUR at 1.100805 07/04/2023 | 47,329 | (241)        | (0.00)        |
| Bought USD Sold EUR at 1.090678 09/05/2023 | 47,768 | (597)        | (0.00)        |
|  |        | <b>(611)</b> | <b>(0.00)</b> |

|  | 契約額等 Ccy | Unrealised gain/(loss) EUR | % Net Assets |
|--|----------|----------------------------|--------------|
|--|----------|----------------------------|--------------|

#### 先物取引

|                                 |     |              |                    |               |
|---------------------------------|-----|--------------|--------------------|---------------|
| Euro-Btp Bond Future 08/06/2023 | EUR | (29,287,841) | (875,958)          | (0.07)        |
| Euro-Bond Future 08/06/2023     | EUR | 202,723,737  | (1,309,144)        | (0.11)        |
|                                 |     |              | <b>(2,185,102)</b> | <b>(0.19)</b> |

|  | 契約額等 Ccy | Unrealised gain/(loss) EUR | % Net Assets |
|--|----------|----------------------------|--------------|
|--|----------|----------------------------|--------------|

#### 金利スワップ取引

|   |     |            |                |             |
|---|-----|------------|----------------|-------------|
| Pay fixed 2.458% receive float. (6m EURIBOR) 05/04/2033 | EUR | 27,832,895 | 650,932        | 0.06        |
| Pay fixed 2.476% receive float. (6m EURIBOR) 11/04/2033 | EUR | 28,585,136 | 535,365        | 0.05        |
| Receive fixed 3.109% pay float. (6m EURIBOR) 21/04/2033 | EUR | 36,859,780 | 393,428        | 0.03        |
| Pay fixed 2.647% receive float. (6m EURIBOR) 21/04/2033 | EUR | 14,292,568 | (208,908)      | (0.02)      |
| Receive fixed 2.918% pay float. (6m EURIBOR) 05/04/2033 | EUR | 75,224,041 | (375,871)      | (0.03)      |
| Receive fixed 2.903% pay float. (6m EURIBOR) 11/04/2033 | EUR | 73,719,561 | (452,314)      | (0.04)      |
|   |     |            | <b>562,630</b> | <b>0.05</b> |

#### その他資産（負債控除後）

16,406,099 1.38

**Net Assets** **1,175,647,419** **100.00**

# フィデリティ・ワールド株式・マザーファンド 運用報告書

## 《第36期》

決算日 2023年11月10日

(計算期間：2023年5月11日から2023年11月10日まで)

### ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | <ul style="list-style-type: none"> <li>●投資信託証券への投資を通じて、実質的に主として国内外の取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている株式に投資を行い、配当等収入を確保するとともに、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目指します。</li> <li>●主として投資信託証券(国内投資信託証券、外国籍投資信託証券を含みます。)に投資を行います。</li> <li>●投資信託証券への投資に際しては、別に定める投資信託証券(「ファンド・ユニバース」)の中から、主として投資目的、予想配当利回り、リスク・リターン特性、地域分散などを考慮して選定したファンドに投資します。</li> <li>●組入れた投資信託証券(「投資対象ファンド」)は定期的にモニターを行い、主としてファンド全体の予想配当利回り、リスク・リターン特性、地域配分などを考慮して、組入れ比率の調整を行います。また投資対象ファンドの入れ替えを行う可能性もあります。</li> <li>●投資対象ファンドへの配分にあたっては、各市場における配当水準と共に、北米、欧州、アジア・パシフィックの3地域への配分のバランスも考慮し、特定地域への配分が極端に偏らないよう運用を行います。</li> <li>●ファンド・ユニバースは、投資信託証券(国内投資信託証券、外国籍投資信託証券を含みます。)の中から、当該投資信託証券の投資対象を勘案して適宜見直します。</li> <li>●組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</li> <li>●ファンドの基本資産配分に関する運用にあたっては、FILインベストメント・マネジメント(香港)・リミテッドに、運用の指図に関する権限を委託します。</li> <li>●ファンドの運用にあたっては、FILインベストメント・インターナショナルに、上記以外のファンドの運用の指図に関する権限を委託することがあります。</li> <li>●資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては上記のような運用ができない場合もあります。</li> </ul> |
| 主要運用対象 | <p>主として、国内外の取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている株式を主要投資対象とする投資信託証券に投資を行います。</p>  |
| 組入制限   | <ul style="list-style-type: none"> <li>●投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>●投資信託証券および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外への直接投資は行いません。</li> <li>●外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>   |

## ■最近5期の運用実績

| 決算期               | 基準価額        |             | 投資<br>受組 | 資<br>益<br>入 | 信<br>託<br>証<br>比 | 証<br>券<br>率 | 投<br>資<br>入<br>証<br>比 | 証<br>券<br>率 | 純<br>資<br>産<br>額 |
|-------------------|-------------|-------------|----------|-------------|------------------|-------------|-----------------------|-------------|------------------|
|                   | 期<br>騰      | 落<br>中<br>率 |          |             |                  |             |                       |             |                  |
| 32期 (2021年11月10日) | 円<br>26,838 | %<br>3.9    |          |             |                  | %<br>—      |                       | %<br>99.8   | 百万円<br>6,549     |
| 33期 (2022年5月10日)  | 28,094      | 4.7         |          |             |                  | —           | 99.6                  | 6,427       |                  |
| 34期 (2022年11月10日) | 30,136      | 7.3         |          |             |                  | —           | 99.8                  | 6,319       |                  |
| 35期 (2023年5月10日)  | 31,696      | 5.2         |          |             |                  | —           | 99.6                  | 6,086       |                  |
| 36期 (2023年11月10日) | 34,991      | 10.4        |          |             |                  | —           | 99.8                  | 6,210       |                  |

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークは設定しておりません。

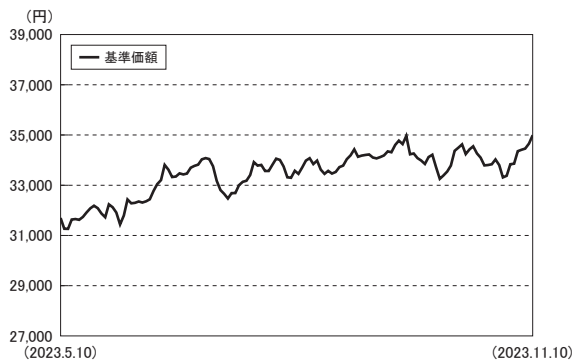
## ■当期中の基準価額等の推移

| 年月日                 | 基準価額        |        | 投資<br>受組 | 信<br>託<br>証<br>比 | 証<br>券<br>率 | 投<br>資<br>入<br>証<br>比 | 証<br>券<br>率 |
|---------------------|-------------|--------|----------|------------------|-------------|-----------------------|-------------|
|                     | 騰           | 落<br>率 |          |                  |             |                       |             |
| (期首)<br>2023年5月10日  | 円<br>31,696 | %<br>— |          |                  | %<br>—      |                       | %<br>99.6   |
| 5月末                 | 31,913      | 0.7    |          |                  | —           | 99.8                  |             |
| 6月末                 | 33,821      | 6.7    |          |                  | —           | 99.7                  |             |
| 7月末                 | 33,818      | 6.7    |          |                  | —           | 99.8                  |             |
| 8月末                 | 34,429      | 8.6    |          |                  | —           | 99.8                  |             |
| 9月末                 | 34,121      | 7.7    |          |                  | —           | 99.8                  |             |
| 10月末                | 33,378      | 5.3    |          |                  | —           | 99.8                  |             |
| (期末)<br>2023年11月10日 | 34,991      | 10.4   |          |                  | —           | 99.8                  |             |

(注) 騰落率は期首比です。

## ■運用経過の説明

### ●基準価額の推移



### ●運用経過

当期の当ファンドの騰落率は+10.4%でした。

当ファンドは、従来通り、日本、米国、欧州、アジアの株式に分散投資を行いました。組入れ投資信託証券の選別、組入れ比率は、各市場における配当利回り水準を重視し、特定地域への配分に極端な偏りがないことを考慮した上で決定しております。

当期末時の各投資信託証券の組入れ比率は以下の通りでした。

| 組入れ投資信託証券                     | 組入れ比率<br>(当期末現在) |
|-------------------------------|------------------|
| フィデリティ・ファンズーグローバル・ディビデンド・ファンド | 99.8%            |
| フィデリティ・ファンズーUSドル・キャッシュ・ファンド   | 0.1%             |

※組入れ比率は、対純資産総額比率。

## ●投資環境

(以下、別途記載がない限り、現地通貨ベースでの相場の動きを記載しています。)

当期の世界の株式市場は上昇しました。期前半は、先進国のインフレ率に鎮静化の兆しが見え、市場では主要中央銀行が金融引き締めペースをさらに緩めるのではないかとの期待が高まりました。また、堅調な企業業績や米国の4-6月期のGDP(国内総生産)の伸び率など、経済の底堅さが示され、市場では世界経済のソフトランディング(軟着陸)に対する期待が高まり、投資家心理を下支えしました。しかし期後半に入ると、インフレ率が依然として目標よりも高い水準で推移していることから、主要中央銀行は積極的な金融引き締め姿勢を維持し、高い金利水準が長期化する可能性が高いとの見方を示唆したことなどが投資家心理の重石となりました。また、中国の軟調な経済データや低迷が続く不動産セクターも市場の下押し圧力となりました。期終盤は、中東情勢の緊迫化が投資家心理をさらに冷やす展開となりました。このような状況の下、米国と日本が最も上昇した一方、日本を除く太平洋地域及び欧州は下落して期を終えました。中国経済の軟化を背景に、新興国市場は横ばいとなりました。業種別では、情報技術及びコミュニケーション・サービスが最も上昇しました。

## ■今後の運用方針

当ファンドは、今後も、各投資信託証券への投資を通じ、日本を含む世界の株式市場へ分散投資を行います。各投資信託証券におきましては、グローバルな調査ネットワークを活用し、中長期的に株主価値を創造できる銘柄の選択に注力してまいります。

## ■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用明細

（2023年5月11日～2023年11月10日）

| 項目                  | 金額       |
|---------------------|----------|
| (a) 売買委託手数料         | －円       |
| (b) 有価証券取引税         | －        |
| (c) その他費用<br>（保管費用） | 0<br>(0) |
| 合計                  | 0        |

（注）費用明細の項目の概要および注記については、前述の「1万口（元本10,000円）当たりの費用明細」をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況（2023年5月11日から2023年11月10日まで）

### ● 投資信託受益証券、投資証券

|   | 買 付                   |                        | 売 付                    |                          |
|---|-----------------------|------------------------|------------------------|--------------------------|
|   | 単位数又は口数               | 金 額                    | 単位数又は口数                | 金 額                      |
| 外国<br>FF-GLOBAL DIVIDEND FUND A-MINCOME-USD | 千口<br>36.34905<br>(－) | 千アメリカ・ドル<br>615<br>(－) | 千口<br>185.72852<br>(－) | 千アメリカ・ドル<br>3,140<br>(－) |

（注1）金額は受渡し代金。

（注2）買付（ ）内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

（注3）売付（ ）内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

（注4）金額の単位未満は切捨て。

## ■ 利害関係人との取引状況等（2023年5月11日から2023年11月10日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

| 区 分     | 当         |                         |               | 期          |                         |               |
|---------|-----------|-------------------------|---------------|------------|-------------------------|---------------|
|         | 買付額等<br>A | うち利害<br>関係人との<br>取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C  | うち利害<br>関係人との<br>取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
| 投 資 証 券 | 百万円<br>89 | 百万円<br>89               | %<br>100.0    | 百万円<br>461 | 百万円<br>461              | %<br>100.0    |
| 為 替     | 103       | 88                      | 85.6          | 493        | 455                     | 92.2          |

## (2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類           | 当 期       |            |              |
|---------------|-----------|------------|--------------|
|               | 買 付 額     | 売 付 額      | 期 末 保 有 額    |
| そ の 他 有 価 証 券 | 百万円<br>89 | 百万円<br>461 | 百万円<br>6,198 |

## (3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目                         | 当 期 |
|-----------------------------|-----|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)       | －千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | －   |
| (B) / (A)                   | －   |

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは、FIL DISTRIBUTORS、FIL LUXEMBOURG SAです。

## ■組入資産の明細 (2023年11月10日現在)

## ●ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名                             | 当                 | 期                  |                 | 末         |
|---------------------------------------|-------------------|--------------------|-----------------|-----------|
|                                       | 単位数又は口数           | 評 価 額              |                 | 比 率       |
|                                       |                   | 外 貨 建 金 額          | 邦 貨 換 算 金 額     |           |
| FF-GLOBAL DIVIDEND FUND A-MINCOME-USD | 千口<br>2,470.32956 | 千アメリカ・ドル<br>40,908 | 千円<br>6,194,798 | %<br>99.8 |
| FF-US DOLLAR CASH FUND A ACC USD      | 2.13882           | 25                 | 3,878           | 0.1       |
| 合 計                                   | 2,472.46838       | －                  | 6,198,676       | 99.8      |

(注1) 邦貨換算金額は期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 比率欄は、純資産総額に対する評価額(邦貨換算金額)の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

(2023年11月10日現在)

| 項 目                     | 当 期 末           |           |
|-------------------------|-----------------|-----------|
|                         | 評 価 額           | 比 率       |
| 投 資 証 券                 | 千円<br>6,198,676 | %<br>99.6 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 26,164          | 0.4       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 6,224,840       | 100.0     |

(注1) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、11月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=151.43円です。

(注2) 当期末における外貨建資産(6,189,231千円)の投資信託財産総額(6,224,840千円)に対する比率は、99.4%です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年11月10日現在)

| 項 目                    | 当 期 末              |
|------------------------|--------------------|
| (A) 資 産                | 円<br>6,239,550,532 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等        | 20,849,492         |
| 投 資 証 券(評価額)           | 6,198,676,486      |
| 未 収 入 金                | 14,740,163         |
| そ の 他 未 収 収 益          | 5,284,391          |
| (B) 負 債                | 29,460,865         |
| 未 払 金                  | 29,459,229         |
| そ の 他 未 払 費 用          | 1,636              |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B)     | 6,210,089,667      |
| 元 本                    | 1,774,785,074      |
| 次 期 繰 越 損 益 金          | 4,435,304,593      |
| (D) 受 益 権 総 口 数        | 1,774,785,074口     |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D) | 34,991円            |

(注1) 当ファンドの期首元本額、期中追加設定元本額、期中一部解約元本額は以下の通りです。

|           |                |
|-----------|----------------|
| 期首元本額     | 1,920,405,394円 |
| 期中追加設定元本額 | 4,707,793円     |
| 期中一部解約元本額 | 150,328,113円   |

(注2) 当ファンドの当期末元本の内訳は以下の通りです。

|                          |              |
|--------------------------|--------------|
| フィデリティ・世界3資産・ファンド(毎月決算型) | 802,829,006円 |
| フィデリティ・世界分散・ファンド(債券重視型)  | 276,606,276円 |
| フィデリティ・世界分散・ファンド(株式重視型)  | 695,349,792円 |

(注3) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

## ■損益の状況

当期 自2023年5月11日 至2023年11月10日

| 項 目                  | 当 期              |
|----------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 収 益        | 円<br>112,525,614 |
| 受 取 配 当 金            | 87,936,149       |
| 受 取 利 息              | 9,752            |
| そ の 他 収 益 金          | 24,579,713       |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益  | 503,907,748      |
| 売 買 益                | 715,385,104      |
| 売 買 損                | △211,477,356     |
| (C) 信 託 報 酬 等        | △17,260          |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 616,416,102      |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金    | 4,166,500,838    |
| (F) 解 約 差 損 益 金      | △359,057,954     |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金  | 11,445,607       |
| (H) 合 計(D+E+F+G)     | 4,435,304,593    |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H)     | 4,435,304,593    |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示していません。

(注3) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注4) (G)追加信託差損益金とあるのは、追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。



ご参考として以下に、フィデリティ・ワールド株式・マザーファンドが組入れている各投資信託証券の直前の作成期における運用内容を掲載いたします。

<補足情報>

## フィデリティ・ファンズーグローバル・ディビデンド・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|         |  |
|---------|--|
| 設 定 形 態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／米ドル建て                     |
| 投 資 目 的 | 主として世界の高配当株式に投資し、長期的な元本成長とインカムの確保を目指します。 |
| 決 算 日   | 4月30日                                    |

## 運用および純資産変動計算書

2023年4月30日に終了した年度

| 通貨                       | USD                  |
|--------------------------|----------------------|
| <b>投資収益</b>              |                      |
| 受取配当金および受取利息             | 302,860,659          |
| スワップ取引に係る受取利息            | —                    |
| デリバティブ収益                 | 20,801               |
| <b>純利益</b>               | <b>302,881,460</b>   |
| <b>費用</b>                |                      |
| 運用報酬                     | 145,738,348          |
| 管理費                      | 29,979,448           |
| 国税                       | 5,277,723            |
| 保管費用                     | 1,132,061            |
| 販売手数料                    | 4,848,825            |
| 成功報酬                     | —                    |
| その他費用                    | 1,934,408            |
| <b>費用合計</b>              | <b>188,910,813</b>   |
| スワップ取引に係る支払利息            | —                    |
| デリバティブ費用                 | —                    |
| 差金決済取引に係る財務費用            | —                    |
| 還付ブローカー費用                | —                    |
| 管理費用の払戻                  | —                    |
| 払戻費用                     | —                    |
| 費用還付                     | —                    |
| <b>総費用</b>               | <b>188,910,813</b>   |
| <b>純投資収益(損失)</b>         | <b>113,970,647</b>   |
| 有価証券に係る実現純(損)益           | (222,309,581)        |
| 外貨取引に係る実現純(損)益           | 121,640,359          |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益         | —                    |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益       | 13,669,996           |
| オプション取引に係る実現純(損)益        | —                    |
| 先物取引に係る実現純(損)益           | —                    |
| スワップ取引に係る実現純(損)益         | —                    |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額     | 652,756,598          |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額     | (7,577,545)          |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額   | —                    |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 46,448,390           |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額  | —                    |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額     | —                    |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額   | —                    |
| <b>運用実績</b>              | <b>718,598,864</b>   |
| <b>受益者への分配金</b>          | <b>(145,935,148)</b> |
| <b>設定解約</b>              |                      |
| 当期設定額                    | 2,985,760,261        |
| 当期解約額                    | (1,748,469,789)      |
| 調整勘定                     | 6,022,889            |
| 設定解約に伴う増加(減少)額           | 1,243,313,361        |
| <b>純増加(減少)</b>           | <b>1,815,977,077</b> |
| <b>純資産額</b>              |                      |
| 期首                       | 11,019,557,068       |
| 期末                       | 12,835,534,145       |

投資資産明細表 2023年4月30日現在

|   | 国コード | 株数または<br>通貨 | 額面                   |              | 時価 (米ドル<br>) | % Net<br>Assets |
|---|------|-------------|----------------------|--------------|--------------|-----------------|
|   |      |             | 株数                   | 額面           |              |                 |
| 公認の証券取引所で取引される証券                              |      |             |                      |              |              |                 |
| <b>公益事業</b>                                   |      |             |                      |              |              |                 |
| National Grid                                 | GB   | GBP         | 21,819,599           | 314,166,921  | 2.45         |                 |
| Enel  | IT   | EUR         | 23,395,649           | 160,133,238  | 1.25         |                 |
| Ameren  | US   | USD         | 1,550,340            | 136,873,449  | 1.08         |                 |
| CMS Energy                                    | US   | USD         | 1,521,630            | 94,843,192   | 0.74         |                 |
|   |      |             | <b>708,022,800</b>   | <b>5.52</b>  |              |                 |
| <b>素材</b>                                     |      |             |                      |              |              |                 |
| UPM-Kymmene                                   | FI   | EUR         | 7,849,314            | 250,437,058  | 1.95         |                 |
| Packaging Corp of America                     | US   | USD         | 1,416,360            | 191,789,296  | 1.49         |                 |
|   |      |             | <b>442,226,354</b>   | <b>3.45</b>  |              |                 |
| <b>資本財・サービス</b>                               |      |             |                      |              |              |                 |
| RELX (NL)                                     | GB   | EUR         | 17,403,044           | 578,694,372  | 4.51         |                 |
| Wolters Kluwer                                | NL   | EUR         | 3,024,120            | 401,136,189  | 3.13         |                 |
| Legrand                                       | FR   | EUR         | 3,560,040            | 336,925,333  | 2.62         |                 |
| Vinci   | FR   | EUR         | 2,363,790            | 292,799,814  | 2.28         |                 |
| Hubbell (B)                                   | US   | USD         | 952,311              | 251,476,672  | 1.96         |                 |
| Cie de Saint-Gobain                           | FR   | EUR         | 4,306,500            | 249,224,375  | 1.94         |                 |
| SanDisk                                       | SE   | SEK         | 5,890,335            | 119,876,503  | 0.93         |                 |
| Schneider Electric (FR)                       | FR   | EUR         | 665,115              | 115,885,161  | 0.90         |                 |
|   |      |             | <b>2,345,918,419</b> | <b>18.28</b> |              |                 |
| <b>情報技術</b>                                   |      |             |                      |              |              |                 |
| Cisco Systems                                 | US   | USD         | 7,474,170            | 351,883,903  | 2.74         |                 |
| Texas Instruments                             | US   | USD         | 1,555,125            | 259,006,053  | 2.02         |                 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing            | TW   | TWD         | 14,257,385           | 233,043,840  | 1.82         |                 |
| Samsung Electronics Perpetual (PreA'd)        | KR   | KRW         | 5,368,770            | 273,828,285  | 1.74         |                 |
| Intel   | US   | USD         | 3,603,105            | 112,526,792  | 0.88         |                 |
|   |      |             | <b>1,180,088,873</b> | <b>9.19</b>  |              |                 |
| <b>一般消費財・サービス</b>                             |      |             |                      |              |              |                 |
| Omnicon Group                                 | US   | USD         | 4,603,170            | 417,691,621  | 3.25         |                 |
| Bridgestone                                   | JP   | JPY         | 6,377,065            | 255,551,877  | 1.99         |                 |
|   |      |             | <b>673,243,498</b>   | <b>5.25</b>  |              |                 |
| <b>生活必需品</b>                                  |      |             |                      |              |              |                 |
| Unilever                                      | GB   | GBP         | 10,928,939           | 609,981,132  | 4.75         |                 |
| Colgate-Palmolive                             | US   | USD         | 4,679,730            | 380,696,013  | 2.97         |                 |
| Tesco   | GB   | GBP         | 75,894,880           | 216,933,026  | 2.09         |                 |
| Procter & Gamble                              | US   | USD         | 1,684,520            | 264,404,558  | 2.06         |                 |
| Kao   | JP   | JPY         | 3,179,154            | 128,355,283  | 1.00         |                 |
|   |      |             | <b>1,651,829,992</b> | <b>12.87</b> |              |                 |
| <b>ヘルスケア</b>                                  |      |             |                      |              |              |                 |
| Sanofi  | FR   | EUR         | 4,344,780            | 479,663,684  | 3.74         |                 |
| Roche Holding                                 | CH   | CHF         | 1,412,532            | 444,373,363  | 3.46         |                 |
| Novartis                                      | CH   | CHF         | 3,890,205            | 397,816,709  | 3.10         |                 |
| Bristol-Myers Squibb                          | US   | USD         | 4,418,469            | 294,137,464  | 2.29         |                 |
| Boyer   | DE   | EUR         | 1,738,689            | 114,721,945  | 0.89         |                 |
| Astellas Pharmaceutical                       | JP   | JPY         | 6,364,050            | 95,858,326   | 0.75         |                 |
|   |      |             | <b>1,826,571,491</b> | <b>14.23</b> |              |                 |
| <b>金融</b>                                     |      |             |                      |              |              |                 |
| Deutsche Boerse                               | DE   | EUR         | 2,559,018            | 488,469,422  | 3.81         |                 |
| Zurich Insurance Group                        | CH   | CHF         | 823,020              | 398,788,099  | 3.11         |                 |
| Sampo (A)                                     | FI   | EUR         | 6,670,290            | 836,449,428  | 6.64         |                 |
| CME Group                                     | US   | USD         | 1,837,440            | 337,905,196  | 2.63         |                 |
| BlackRock                                     | US   | USD         | 450,747              | 302,730,682  | 2.36         |                 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft    | DE   | EUR         | 733,953              | 276,646,030  | 2.16         |                 |
| Alliant                                       | DE   | EUR         | 1,075,784            | 269,624,768  | 2.10         |                 |
| Progressive                                   | US   | USD         | 1,789,590            | 241,791,491  | 1.88         |                 |
| Admiral Group                                 | GB   | GBP         | 5,697,021            | 165,632,532  | 1.29         |                 |
| Singapore Exchange                            | SG   | SGD         | 16,288,139           | 117,188,693  | 0.91         |                 |
|   |      |             | <b>2,937,226,341</b> | <b>22.88</b> |              |                 |
| <b>オープンエンド型ファンド</b>                           |      |             |                      |              |              |                 |
| Fidelity IIF - The US Dollar Fund - A-ACC-USD | IE   | USD         | 22,055               | 413,082,404  | 3.22         |                 |
|   |      |             | <b>413,082,404</b>   | <b>3.22</b>  |              |                 |
| <b>コミュニケーション・サービス</b>                         |      |             |                      |              |              |                 |
| KDDI  | JP   | JPY         | 7,399,428            | 231,149,246  | 1.80         |                 |
|   |      |             | <b>231,149,246</b>   | <b>1.80</b>  |              |                 |
| その他の市場で取引される証券                                |      |             |                      |              |              |                 |
| <b>公益事業</b>                                   |      |             |                      |              |              |                 |
| Iberdrola                                     | ES   | EUR         | 29,504,308           | 385,707,070  | 2.99         |                 |
|   |      |             | <b>385,707,070</b>   | <b>2.99</b>  |              |                 |

その他

投資資産合計 (取得価額 USD 11,337,751,866)

時価 (米ドル  
) % Net  
Assets

1 0.00

12,793,066,489 99.67

契約額等 USD 未実現 (損  
) 益 (米ドル  
) % Net  
Assets

外国為替先物取引

A-ACC Shares (EUR) (hedged)

|  |             |                  |             |
|--|-------------|------------------|-------------|
| Bought EUR Sold USD at 0.914570 16/05/2023 | 673,306,570 | 7,119,472        | 0.06        |
| Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023 | 57,543,950  | 1,411,604        | 0.01        |
| Bought EUR Sold USD at 0.915367 16/05/2023 | 46,040,420  | 527,393          | 0.00        |
| Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023 | 18,912,461  | 239,074          | 0.00        |
| Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023 | 20,334,211  | 220,116          | 0.00        |
| Bought USD Sold JPY at 0.007519 16/05/2023 | 3,938,268   | 79,977           | 0.00        |
| Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023 | 9,880,704   | 17,077           | 0.00        |
| Bought USD Sold KRW at 0.000758 16/05/2023 | 1,294,355   | 16,809           | 0.00        |
| Bought USD Sold TWD at 0.032867 16/05/2023 | 1,391,660   | 12,540           | 0.00        |
| Bought USD Sold SGD at 0.751107 16/05/2023 | 676,284     | 614              | 0.00        |
| Bought USD Sold EUR at 1.103406 16/05/2023 | 7,737,674   | (10,963)         | (0.00)      |
| Bought USD Sold SEK at 0.095718 16/05/2023 | 713,281     | (14,371)         | (0.00)      |
| Bought USD Sold CHF at 1.110032 16/05/2023 | 7,048,917   | (88,350)         | (0.00)      |
| Bought USD Sold GBP at 1.241911 16/05/2023 | 7,530,402   | (99,055)         | (0.00)      |
| Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023 | 10,422,012  | (212,897)        | (0.00)      |
| Bought USD Sold GBP at 1.244279 16/05/2023 | 11,035,123  | (1,240,285)      | (0.01)      |
| Bought USD Sold CHF at 1.109640 16/05/2023 | 102,995,030 | (1,325,012)      | (0.01)      |
|  |             | <b>6,653,745</b> | <b>0.05</b> |

A-ACC Shares (HUF) (hedged)

|  |            |                |             |
|--|------------|----------------|-------------|
| Bought HUF Sold USD at 347.331200 16/05/2023 | 36,233,467 | 845,821        | 0.01        |
| Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023   | 1,990,090  | 48,632         | 0.00        |
| Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023   | 654,065    | 8,268          | 0.00        |
| Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023   | 703,235    | 7,612          | 0.00        |
| Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023   | 341,744    | 591            | 0.00        |
| Bought TWD Sold USD at 30.703297 16/05/2023  | 37,338     | 4              | 0.00        |
| Bought USD Sold HUF at 0.0282945 16/05/2023  | 547,345    | (282)          | (0.00)      |
| Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023   | 360,431    | (7,363)        | (0.00)      |
| Bought USD Sold GBP at 1.244737 16/05/2023   | 3,803,346  | (41,509)       | (0.00)      |
| Bought USD Sold CHF at 1.109643 16/05/2023   | 5,562,004  | (45,877)       | (0.00)      |
| Bought USD Sold EUR at 1.093508 16/05/2023   | 15,501,759 | (140,071)      | (0.00)      |
|  |            | <b>675,826</b> | <b>0.01</b> |

A-HMDIST (G) Shares (AUD) (hedged)

|  |            |                  |               |
|--|------------|------------------|---------------|
| Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023 | 4,787,100  | 116,984          | 0.00          |
| Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023 | 1,573,354  | 19,889           | 0.00          |
| Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023 | 1,691,611  | 18,312           | 0.00          |
| Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023 | 822,016    | 1,421            | 0.00          |
| Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023 | 867,009    | (17,711)         | (0.00)        |
| Bought USD Sold GBP at 1.244738 16/05/2023 | 9,133,570  | (99,847)         | (0.00)        |
| Bought USD Sold CHF at 1.109643 16/05/2023 | 8,586,167  | (110,335)        | (0.00)        |
| Bought USD Sold EUR at 1.093508 16/05/2023 | 32,478,099 | (336,937)        | (0.00)        |
| Bought AUD Sold USD at 1.501229 16/05/2023 | 87,865,823 | (529,544)        | (0.00)        |
|  |            | <b>(937,788)</b> | <b>(0.01)</b> |

A-HMDIST (G) Shares (PLN) (hedged)

|  |            |                  |             |
|--|------------|------------------|-------------|
| Bought PLN Sold USD at 4.292275 16/05/2023 | 60,869,912 | 1,982,061        | 0.02        |
| Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023 | 1,698,539  | 80,852           | 0.00        |
| Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023 | 1,087,394  | 13,746           | 0.00        |
| Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023 | 1,169,138  | 12,656           | 0.00        |
| Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023 | 568,072    | 982              | 0.00        |
| Bought USD Sold PLN at 0.240273 16/05/2023 | 931,866    | (1,145)          | (0.00)      |
| Bought USD Sold PLN at 0.232945 16/05/2023 | 832,077    | (11,489)         | (0.00)      |
| Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023 | 599,223    | (12,241)         | (0.00)      |
| Bought USD Sold GBP at 1.244738 16/05/2023 | 6,326,429  | (69,009)         | (0.00)      |
| Bought USD Sold CHF at 1.109643 16/05/2023 | 9,921,872  | (76,271)         | (0.00)      |
| Bought USD Sold EUR at 1.093518 16/05/2023 | 22,446,946 | (240,796)        | (0.00)      |
|  |            | <b>1,679,346</b> | <b>0.01</b> |

A-HMDIST (G) Shares (RMB) (hedged)

|   |            |           |        |
|---|------------|-----------|--------|
| Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023    | 4,806,712  | 117,463   | 0.00   |
| Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023    | 1,579,780  | 19,970    | 0.00   |
| Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023    | 1,698,539  | 18,387    | 0.00   |
| Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023    | 823,318    | 1,426     | 0.00   |
| Bought CHF Sold USD at 0.891280 16/05/2023    | 489,633    | 934       | 0.00   |
| Bought SEK Sold USD at 0.10297432 16/05/2023  | 58,248     | 344       | 0.00   |
| Bought SGD Sold USD at 1.334950 16/05/2023    | 54,983     | 98        | 0.00   |
| Bought KRW Sold USD at 1337.260001 16/05/2023 | 148,221    | 19        | 0.00   |
| Bought TWD Sold USD at 30.672999 16/05/2023   | 171,356    | (151)     | (0.00) |
| Bought USD Sold CNY at 0.144342 16/05/2023    | 1,457,277  | (2,860)   | (0.00) |
| Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023    | 870,365    | (17,784)  | (0.00) |
| Bought USD Sold GBP at 1.244738 16/05/2023    | 9,191,072  | (100,236) | (0.00) |
| Bought USD Sold CHF at 1.109643 16/05/2023    | 8,603,239  | (110,806) | (0.00) |
| Bought USD Sold EUR at 1.093077 16/05/2023    | 32,611,137 | (351,041) | (0.00) |

|   | 契約額等 USD    | 未実現 (損益) (米ドル)   | % Net Assets  |  | 契約額等 USD    | 未実現 (損益) (米ドル)        | % Net Assets  |
|---|-------------|------------------|---------------|--|-------------|-----------------------|---------------|
| Bought CNV Sold USD at 6.874470 16/05/2023    | 87,987,830  | (508,160)        | (0.00)        | Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023     | 8,990,532   | 219,704               | 0.00          |
|   |             | <b>(932,417)</b> | <b>(0.01)</b> | Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023     | 2,954,839   | 37,353                | 0.00          |
| A-MCDIST (G) Shares (SGD) (SGD/USD hedged)    |             |                  |               | Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023     | 5,176,971   | 34,990                | 0.00          |
| Bought SGD Sold USD at 1.032926 16/05/2023    | 8,465,599   | (14,606)         | (0.00)        | Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023     | 2,543,776   | 2,668                 | 0.00          |
|   |             | <b>(14,606)</b>  | <b>(0.00)</b> | Bought USD Sold EUR at 1.105495 16/05/2023     | 2,028,728   | 961                   | 0.00          |
| A-MINCOME (G) Shares (AUD) (hedged)           |             |                  |               | Bought TWD Sold USD at 30.703300 16/05/2023    | 176,317     | 19                    | 0.00          |
| Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023    | 2,141,612   | 52,355           | 0.00          | Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023     | 1,628,312   | (35,263)              | (0.00)        |
| Bought USD Sold AUD at 0.676958 16/05/2023    | 558,487     | 12,527           | 0.00          | Bought USD Sold GBP at 1.244737 16/05/2023     | 17,191,008  | (187,520)             | (0.00)        |
| Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023    | 705,865     | 8,899            | 0.00          | Bought USD Sold CHF at 1.109645 16/05/2023     | 16,091,687  | (207,255)             | (0.00)        |
| Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023    | 756,779     | 8,192            | 0.00          |  |             | <b>1,001,881</b>      | <b>0.01</b>   |
| Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023    | 367,709     | 656              | 0.00          | I-ACC Shares (USD) (hedged)                    |             |                       |               |
| Bought TWD Sold USD at 30.673001 16/05/2023   | 75,136      | (64)             | (0.00)        | Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023     | 500,609     | 12,234                | 0.00          |
| Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023    | 387,880     | (7,923)          | (0.00)        | Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023     | 164,551     | 2,080                 | 0.00          |
| Bought USD Sold GBP at 1.244738 16/05/2023    | 4,095,045   | (44,669)         | (0.00)        | Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023     | 176,899     | 1,915                 | 0.00          |
| Bought USD Sold CHF at 1.109645 16/05/2023    | 3,835,142   | (49,569)         | (0.00)        | Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023     | 85,924      | 149                   | 0.00          |
| Bought USD Sold EUR at 1.093508 16/05/2023    | 14,529,714  | (150,756)        | (0.00)        | Bought TWD Sold USD at 30.673004 16/05/2023    | 16,979      | (15)                  | (0.00)        |
| Bought AUD Sold USD at 1.501107 16/05/2023    | 39,311,853  | (240,089)        | (0.00)        | Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023     | 80,672      | (1,852)               | (0.00)        |
|   |             | <b>(410,262)</b> | <b>(0.00)</b> | Bought USD Sold GBP at 1.244737 16/05/2023     | 957,188     | (10,441)              | (0.00)        |
|   |             |                  |               | Bought USD Sold CHF at 1.109645 16/05/2023     | 896,037     | (11,541)              | (0.00)        |
|   |             |                  |               | Bought USD Sold EUR at 1.093516 16/05/2023     | 3,396,351   | (36,256)              | (0.00)        |
|   |             |                  |               |  |             | <b>(43,727)</b>       | <b>(0.00)</b> |
| A-MINCOME (G) Shares (HKD) (hedged)           |             |                  |               | Svetovych dividend A-ACC Shares (CZK) (hedged) |             |                       |               |
| Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023    | 2,275,120   | 55,598           | 0.00          | Bought CZK Sold USD at 21.477200 16/05/2023    | 261,784,623 | 2,132,126             | 0.02          |
| Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023    | 747,743     | 9,452            | 0.00          | Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023     | 14,301,001  | 349,478               | 0.00          |
| Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023    | 803,955     | 8,703            | 0.00          | Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023     | 4,700,183   | 59,416                | 0.00          |
| Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023    | 390,672     | 675              | 0.00          | Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023     | 5,035,520   | 54,704                | 0.00          |
| Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023    | 412,058     | (8,417)          | (0.00)        | Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023     | 2,455,618   | 4,244                 | 0.00          |
| Bought USD Sold GBP at 1.244738 16/05/2023    | 4,350,261   | (47,453)         | (0.00)        | Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023     | 2,901,115   | (52,910)              | (0.00)        |
| Bought USD Sold CHF at 1.109645 16/05/2023    | 4,072,130   | (52,447)         | (0.00)        | Bought USD Sold GBP at 1.244737 16/05/2023     | 27,345,309  | (298,283)             | (0.00)        |
| Bought HKD Sold USD at 7.852971 16/05/2023    | 41,622,190  | (61,152)         | (0.00)        | Bought USD Sold CHF at 1.109625 16/05/2023     | 25,596,697  | (330,082)             | (0.00)        |
| Bought USD Sold EUR at 1.093516 16/05/2023    | 15,455,569  | (164,772)        | (0.00)        | Bought USD Sold EUR at 1.093508 16/05/2023     | 97,025,125  | (1,006,567)           | (0.01)        |
|   |             | <b>(259,813)</b> | <b>(0.00)</b> |  |             | <b>912,126</b>        | <b>0.01</b>   |
| A-MINCOME (G) Shares (SGD) (hedged)           |             |                  |               | W-QINCOME (G) Shares (GBP) (hedged)            |             |                       |               |
| Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023    | 2,026,354   | 49,519           | 0.00          | Bought GBP Sold USD at 0.803714 16/05/2023     | 180,006,973 | 2,060,299             | 0.02          |
| Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023    | 665,984     | 8,419            | 0.00          | Bought USD Sold TWD at 0.007550 16/05/2023     | 10,916,869  | 266,779               | 0.00          |
| Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023    | 716,050     | 7,751            | 0.00          | Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023     | 3,587,951   | 45,356                | 0.00          |
| Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023    | 367,005     | (7,497)          | (0.00)        | Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023     | 5,857,675   | 41,759                | 0.00          |
| Bought USD Sold GBP at 1.244738 16/05/2023    | 3,874,687   | (42,265)         | (0.00)        | Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023     | 1,874,488   | 3,240                 | 0.00          |
| Bought USD Sold CHF at 1.109645 16/05/2023    | 3,626,866   | (46,713)         | (0.00)        | Bought TWD Sold USD at 30.722500 16/05/2023    | 242,181     | 178                   | 0.00          |
| Bought SGD Sold USD at 1.330278 16/05/2023    | 36,748,710  | (65,404)         | (0.00)        | Bought USD Sold GBP at 1.253705 16/05/2023     | 2,139,642   | (8,093)               | (0.00)        |
| Bought USD Sold EUR at 1.093071 16/05/2023    | 13,747,836  | (147,988)        | (0.00)        | Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023     | 42,977,196  | (40,389)              | (0.00)        |
|   |             | <b>(242,178)</b> | <b>(0.00)</b> | Bought USD Sold CHF at 1.109645 16/05/2023     | 19,539,595  | (261,662)             | (0.00)        |
|   |             |                  |               | Bought USD Sold EUR at 1.093518 16/05/2023     | 74,065,473  | (794,525)             | (0.01)        |
|   |             |                  |               |  |             | <b>1,322,942</b>      | <b>0.01</b>   |
| A-MINCOME (G) Shares (USD) (hedged)           |             |                  |               | Y-ACC Shares (CHF) (hedged)                    |             |                       |               |
| Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023    | 4,396,864   | 107,447          | 0.00          | Bought CHF Sold USD at 0.913190 16/05/2023     | 15,439,022  | 201,443               | 0.00          |
| Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023    | 1,445,078   | 18,268           | 0.00          | Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023     | 924,942     | 22,603                | 0.00          |
| Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023    | 1,353,712   | 16,319           | 0.00          | Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023     | 303,992     | 3,843                 | 0.00          |
| Bought GBP Sold USD at 0.801591 16/05/2023    | 327,723     | 2,875            | 0.00          | Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023     | 326,844     | 3,538                 | 0.00          |
| Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023    | 755,003     | 1,305            | 0.00          | Bought CHF Sold USD at 0.896849 16/05/2023     | 151,642     | 1,239                 | 0.00          |
| Bought CHF Sold USD at 0.891280 16/05/2023    | 467,754     | 892              | 0.00          | Bought USD Sold CHF at 1.128801 16/05/2023     | 179,222     | 747                   | 0.00          |
| Bought SEK Sold USD at 0.095690 16/05/2023    | 55,257      | 327              | 0.00          | Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023     | 158,790     | 274                   | 0.00          |
| Bought SGD Sold USD at 1.334950 16/05/2023    | 52,212      | 93               | 0.00          | Bought USD Sold CHF at 1.125183 16/05/2023     | 158,501     | 150                   | 0.00          |
| Bought KRW Sold USD at 1337.259965 16/05/2023 | 139,580     | 18               | 0.00          | Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023     | 167,521     | (3,422)               | (0.00)        |
| Bought KRW Sold USD at 1339.117962 16/05/2023 | 2,980       | 3                | 0.00          | Bought USD Sold GBP at 1.244737 16/05/2023     | 1,768,647   | (19,292)              | (0.00)        |
| Bought TWD Sold USD at 30.703500 16/05/2023   | 22,884      | 2                | 0.00          | Bought USD Sold EUR at 1.093518 16/05/2023     | 6,275,244   | (67,317)              | (0.00)        |
| Bought TWD Sold USD at 30.673001 16/05/2023   | 161,015     | (141)            | (0.00)        |  |             | <b>143,806</b>        | <b>0.00</b>   |
| Bought EUR Sold USD at 0.904572 16/05/2023    | 1,517,197   | (624)            | (0.00)        | Y-ACC Shares (EUR) (hedged)                    |             |                       |               |
| Bought JPY Sold USD at 133.284554 16/05/2023  | 158,837     | (2,821)          | (0.00)        | Bought EUR Sold USD at 0.914426 16/05/2023     | 440,393,256 | 4,586,673             | 0.04          |
| Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023    | 796,353     | (16,267)         | (0.00)        | Bought EUR Sold USD at 0.913567 16/05/2023     | 112,324,732 | 1,286,680             | 0.01          |
| Bought USD Sold GBP at 1.244737 16/05/2023    | 8,407,500   | (91,707)         | (0.00)        | Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023     | 67,632,161  | 919,811               | 0.01          |
| Bought USD Sold CHF at 1.109645 16/05/2023    | 7,869,570   | (101,359)        | (0.00)        | Bought USD Sold JPY at 0.007519 16/05/2023     | 9,608,165   | 195,121               | 0.00          |
| Bought USD Sold EUR at 1.093516 16/05/2023    | 29,830,587  | (318,437)        | (0.00)        | Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023     | 12,368,229  | 156,349               | 0.00          |
|   |             | <b>(383,307)</b> | <b>(0.00)</b> | Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023     | 15,298,015  | 145,950               | 0.00          |
|   |             |                  |               | Bought USD Sold KRW at 0.000758 16/05/2023     | 5,157,831   | 41,009                | 0.00          |
| D-ACC Shares (EUR) (hedged)                   |             |                  |               | Bought USD Sold TWD at 0.032867 16/05/2023     | 3,595,222   | 30,594                | 0.00          |
| Bought EUR Sold USD at 0.914462 16/05/2023    | 45,534,518  | 474,057          | 0.00          | Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023     | 9,461,690   | 11,168                | 0.00          |
| Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023    | 3,891,140   | 95,089           | 0.00          | Bought USD Sold EUR at 1.105495 16/05/2023     | 6,860,435   | 4,671                 | 0.00          |
| Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023    | 1,278,666   | 16,166           | 0.00          | Bought USD Sold GBP at 1.244737 16/05/2023     | 1,649,811   | 1,497                 | 0.00          |
| Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023    | 1,375,005   | 14,884           | 0.00          | Bought TWD Sold USD at 30.703300 16/05/2023    | 883,556     | 96                    | 0.00          |
| Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023    | 668,104     | 1,155            | 0.00          | Bought USD Sold SEK at 0.095717 16/05/2023     | 1,740,172   | (35,073)              | (0.00)        |
| Bought USD Sold EUR at 1.103404 16/05/2023    | 614,806     | (871)            | (0.00)        | Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023     | 6,815,713   | (139,229)             | (0.00)        |
| Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023    | 704,743     | (14,596)         | (0.00)        | Bought USD Sold CHF at 1.103352 16/05/2023     | 17,197,261  | (215,549)             | (0.00)        |
| Bought USD Sold GBP at 1.244738 16/05/2023    | 7,440,296   | (81,159)         | (0.00)        | Bought USD Sold GBP at 1.241911 16/05/2023     | 18,372,077  | (241,667)             | (0.00)        |
| Bought USD Sold CHF at 1.109645 16/05/2023    | 6,964,607   | (89,701)         | (0.00)        | Bought USD Sold GBP at 1.244279 16/05/2023     | 71,957,385  | (811,112)             | (0.01)        |
|   |             | <b>417,224</b>   | <b>0.00</b>   | Bought USD Sold CHF at 1.109625 16/05/2023     | 67,355,901  | (868,587)             | (0.01)        |
|   |             |                  |               |  |             | <b>5,066,219</b>      | <b>0.04</b>   |
| D-MINCOME (G) Shares (EUR) (hedged)           |             |                  |               | Y-HMDIST (G) Shares (AUD) (AUD/USD hedged)     |             |                       |               |
| Bought EUR Sold USD at 0.914488 16/05/2023    | 48,456,633  | 507,973          | 0.00          | Bought AUD Sold USD at 1.501107 16/05/2023     | 43,501      | (264)                 | (0.00)        |
| Bought USD Sold JPY at 0.007550 16/05/2023    | 4,140,961   | 101,194          | 0.00          |  |             | <b>(264)</b>          | <b>(0.00)</b> |
| Bought USD Sold KRW at 0.000757 16/05/2023    | 1,360,973   | 17,204           | 0.00          | その他資産 (負債控除後)                                  |             | 27,375,688            | 0.18          |
| Bought USD Sold TWD at 0.032926 16/05/2023    | 1,463,285   | 15,840           | 0.00          | Net Assets                                     |             | <b>12,855,554,145</b> | <b>100.00</b> |
| Bought USD Sold SGD at 0.751723 16/05/2023    | 711,028     | 12,279           | 0.00          |  |             |                       |               |
| Bought USD Sold EUR at 1.105495 16/05/2023    | 727,513     | 345              | 0.00          |  |             |                       |               |
| Bought TWD Sold USD at 30.703301 16/05/2023   | 99,341      | 11               | 0.00          |  |             |                       |               |
| Bought USD Sold EUR at 1.096012 16/05/2023    | 548,862     | (3,432)          | (0.00)        |  |             |                       |               |
| Bought USD Sold SEK at 0.095690 16/05/2023    | 749,981     | (15,320)         | (0.00)        |  |             |                       |               |
| Bought USD Sold GBP at 1.244737 16/05/2023    | 7,918,009   | (86,370)         | (0.00)        |  |             |                       |               |
| Bought USD Sold CHF at 1.109645 16/05/2023    | 7,411,621   | (95,459)         | (0.00)        |  |             |                       |               |
|   |             | <b>443,215</b>   | <b>0.00</b>   |  |             |                       |               |
| E-MINCOME (G) Shares (EUR) (hedged)           |             |                  |               |  |             |                       |               |
| Bought EUR Sold USD at 0.914766 16/05/2023    | 105,173,589 | 1,134,824        | 0.01          |  |             |                       |               |

<補足情報>

## フィデリティ・ファンズーUSドル・キャッシュ・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|      |                        |
|------|------------------------|
| 設定形態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／米ドル建て   |
| 投資目的 | 主として米ドル建ての債券等に投資を行います。 |
| 決算日  | 4月30日                  |

## 運用および純資産変動計算書

2023年4月30日に終了した年度

| 通貨                       | USD                |
|--------------------------|--------------------|
| <b>投資収益</b>              |                    |
| 受取配当金および受取利息             | 55,694,003         |
| スワップ取引に係る受取利息            | —                  |
| デリバティブ収益                 | —                  |
| <b>純利益</b>               | <b>55,694,003</b>  |
| <b>費用</b>                |                    |
| 運用報酬                     | 2,319,489          |
| 管理費                      | 1,821,034          |
| 国税                       | 166,513            |
| 保管費用                     | 133,881            |
| 販売手数料                    | —                  |
| 成功報酬                     | —                  |
| その他費用                    | 296,499            |
| <b>費用合計</b>              | <b>4,737,416</b>   |
| スワップ取引に係る支払利息            | —                  |
| デリバティブ費用                 | —                  |
| 差金決済取引に係る財務費用            | —                  |
| 還付ブローカー費用                | —                  |
| 管理費用の払戻                  | —                  |
| 払戻費用                     | —                  |
| 費用還付                     | —                  |
| <b>総費用</b>               | <b>4,737,416</b>   |
| <b>純投資収益(損失)</b>         | <b>50,956,587</b>  |
| 有価証券に係る実現純(損)益           | (4,743,059)        |
| 外貨取引に係る実現純(損)益           | (11,724)           |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益         | —                  |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益       | (730,619)          |
| オプション取引に係る実現純(損)益        | —                  |
| 先物取引に係る実現純(損)益           | —                  |
| スワップ取引に係る実現純(損)益         | —                  |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額     | 4,838,963          |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額     | 22                 |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額   | —                  |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 482,429            |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額  | —                  |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額     | —                  |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額   | —                  |
| <b>運用実績</b>              | <b>50,792,599</b>  |
| <b>受益者への分配金</b>          | <b>—</b>           |
| <b>設定解約</b>              |                    |
| 当期設定額                    | 1,144,398,460      |
| 当期解約額                    | (967,655,858)      |
| 調整勘定                     | (1,234,033)        |
| 設定解約に伴う増加(減少)額           | 175,508,569        |
| <b>純増加(減少)</b>           | <b>226,301,168</b> |
| <b>純資産額</b>              |                    |
| 期首                       | 1,496,795,903      |
| 期末                       | 1,723,097,071      |

投資資産明細表 2023年4月30日現在

| 国コード | 株数または額面<br>通貨 | 時価 (米ドル)<br>価額 | % Net<br>Assets |
|------|---------------|----------------|-----------------|
|------|---------------|----------------|-----------------|

公認の証券取引所で取引される証券

金融

|                             |    |     |            |                   |             |
|-----------------------------|----|-----|------------|-------------------|-------------|
| SG Issuer -0.80% 07/05/2024 | LU | USD | 34,724,694 | 34,965,357        | 2.03        |
|                             |    |     |            | <b>34,965,357</b> | <b>2.03</b> |

短期金融商品

|  |    |     |            |                      |              |
|--|----|-----|------------|----------------------|--------------|
| Austria CP 4.85% 03/05/2023                | AT | USD | 59,528,047 | 59,487,562           | 3.45         |
| Sweden CP 4.88% 05/05/2023                 | SE | USD | 49,606,706 | 49,571,971           | 2.88         |
| NAB VCD 0.44% 15/05/2023                   | AU | USD | 39,685,364 | 39,690,158           | 2.30         |
| Mitsui Finance CP 4.98% 17/05/2023         | GB | USD | 39,685,364 | 39,578,746           | 2.30         |
| Royal Bank of Canada CD 0.46% 04/05/2023   | CA | USD | 29,764,023 | 29,754,648           | 1.73         |
| Landesreditbank CP 4.84% 03/05/2023        | DE | USD | 29,764,023 | 29,745,264           | 1.73         |
| Mizuho London CD 5.50% 05/07/2023          | GB | USD | 29,764,023 | 29,471,033           | 1.71         |
| Cooperative CD 0.48% 17/05/2023            | NL | USD | 19,842,682 | 19,845,091           | 1.15         |
| Barclays CD 10.03% 02/05/2023              | GB | USD | 19,842,682 | 19,831,785           | 1.15         |
| Standard Chartered SG CD 10.20% 02/05/2023 | SG | USD | 19,842,682 | 19,831,598           | 1.15         |
| MUFG Bank CD 10.35% 02/05/2023             | JP | USD | 19,842,682 | 19,831,455           | 1.15         |
| Mitsui Finance CP 4.93% 05/05/2023         | GB | USD | 19,842,682 | 19,831,455           | 1.15         |
| SMBC Brussel BRH CD 6.52% 08/05/2023       | BE | USD | 19,842,682 | 19,814,564           | 1.15         |
| Matchpoint Finance CP 4.86% 09/05/2023     | IE | USD | 19,842,682 | 19,812,142           | 1.15         |
| Sumi Trust Bank CD 6.29% 09/05/2023        | JP | USD | 19,842,682 | 19,811,965           | 1.15         |
| Robobank NL Bank LDN CD 5.13% 01/06/2023   | GB | USD | 19,842,682 | 19,753,874           | 1.15         |
| Barclays CP 4.965% 01/06/2023              | GB | USD | 19,842,682 | 19,750,027           | 1.15         |
| KBC Bank CD 5.44% 01/06/2023               | BE | USD | 19,842,682 | 19,748,514           | 1.15         |
| La Banque Postale CP 4.90% 01/06/2023      | FR | USD | 19,842,682 | 19,748,416           | 1.15         |
| ABN Amro Bank CD 5.50% 01/06/2023          | NL | USD | 19,842,682 | 19,747,440           | 1.15         |
| KBC Bank CD 5.46% 09/06/2023               | BE | USD | 19,842,682 | 19,724,699           | 1.14         |
| Mitsubishi UFJ Trust CD 5.44% 03/07/2023   | JP | USD | 19,842,682 | 19,655,063           | 1.14         |
| Lloyds Bank (Ugta) CP 5.13% 06/07/2023     | GB | USD | 19,842,682 | 19,648,384           | 1.14         |
| Mizuho London CD 5.57% 05/07/2023          | GB | USD | 19,842,682 | 19,644,669           | 1.14         |
| JP Morgan Securities CP 5.15% 10/07/2023   | US | USD | 19,842,682 | 19,632,782           | 1.14         |
| SMBC Brussel BRH CD 5.45% 12/07/2023       | BE | USD | 19,842,682 | 19,628,915           | 1.14         |
| Sumi Trust Bank CD 5.52% 14/07/2023        | JP | USD | 19,842,682 | 19,620,016           | 1.14         |
| Lloyds Bank CD 5.43% 24/07/2023            | GB | USD | 19,842,682 | 19,595,001           | 1.14         |
| ABN Amro Bank CD 5.39% 01/08/2023          | NL | USD | 19,842,682 | 19,573,692           | 1.14         |
| Banco Santander CP 5.3% 01/08/2023         | ES | USD | 19,842,682 | 19,570,593           | 1.14         |
| Mizuho London CD 5.52% 01/08/2023          | GB | USD | 19,842,682 | 19,567,638           | 1.14         |
| NatWest CD 5.40% 07/08/2023                | GB | USD | 19,842,682 | 19,556,035           | 1.13         |
| ING Bank CP 5.43% 23/10/2023               | NL | USD | 19,842,682 | 19,330,070           | 1.12         |
| KBC Bank CD 5.34% 28/07/2023               | BE | USD | 14,882,012 | 14,888,535           | 0.86         |
| TD (London) CD 0.48% 11/05/2023            | GB | USD | 14,882,012 | 14,882,968           | 0.86         |
| SMBC Sydney BRH CD 5.46% 26/07/2023        | AU | USD | 14,882,012 | 14,690,656           | 0.85         |
| Credit Agricole CD 5.37% 01/08/2023        | FR | USD | 14,882,012 | 14,681,067           | 0.85         |
| NatWest CP 5.45% 24/10/2023                | GB | USD | 14,882,012 | 14,499,187           | 0.84         |
| Credit Agricole CD 5.38% 01/11/2023        | FR | USD | 14,882,012 | 14,486,790           | 0.84         |
| Bred Banque CP 5.46% 26/10/2023            | FR | USD | 14,882,012 | 14,480,116           | 0.84         |
| Lloyds Bank CD 5.54% 01/11/2023            | GB | USD | 14,882,012 | 14,475,843           | 0.84         |
| Zurich Finance CP 4.85% 09/05/2023         | IE | USD | 12,401,676 | 12,382,328           | 0.72         |
| Zurich Finance CP 5.13% 24/07/2023         | IE | USD | 11,905,609 | 11,754,013           | 0.68         |
| Mitsubishi UFJ Trust VCD 0.75% 02/05/2023  | JP | USD | 10,913,475 | 10,913,960           | 0.63         |
| Banco Santander CP 5.00% 08/05/2023        | ES | USD | 9,921,341  | 9,907,182            | 0.57         |
| Banco Santander CP 5.14% 05/06/2023        | ES | USD | 9,921,341  | 9,867,447            | 0.57         |
| Banco Santander CP 5.15% 06/06/2023        | ES | USD | 9,921,341  | 9,845,998            | 0.57         |
| Swedbank CP 5.15% 30/06/2023               | SE | USD | 9,921,341  | 9,834,184            | 0.57         |
| Banco Santander CP 5.30% 06/07/2023        | ES | USD | 9,921,341  | 9,821,906            | 0.57         |
| MUFG Bank CD 5.48% 07/08/2023              | JP | USD | 9,921,341  | 9,776,127            | 0.57         |
| ABN Amro Bank CD 5.49% 02/10/2023          | NL | USD | 9,921,341  | 9,695,465            | 0.56         |
| Matchpoint Finance CP 4.85% 09/05/2023     | IE | USD | 7,441,006  | 7,432,553            | 0.43         |
|  |    |     |            | <b>1,037,569,345</b> | <b>60.22</b> |

その他

|  |  |  |   |      |
|--|--|--|---|------|
|  |  |  | 1 | 0.00 |
|--|--|--|---|------|

投資資産合計 (取得価額 USD 1,067,327,411)

|  |  |  |  |                      |              |
|--|--|--|--|----------------------|--------------|
|  |  |  |  | <b>1,072,532,703</b> | <b>62.24</b> |
|--|--|--|--|----------------------|--------------|

銀行預金

|   |    |     |             |                    |              |
|---|----|-----|-------------|--------------------|--------------|
| Swedbank TD 4.79% 02/05/2023                | SE | USD | 124,016,764 | 124,016,764        | 7.20         |
| Hessen-Thüringen (Ugta) TD 4.80% 02/05/2023 | DE | USD | 124,016,764 | 124,016,764        | 7.20         |
| DZ Bank TD 4.75% 02/05/2023                 | DE | USD | 124,016,764 | 124,016,764        | 7.20         |
| DNB Bank TD 4.75% 02/05/2023                | NO | USD | 124,016,764 | 124,016,764        | 7.20         |
| Sumi Trust Bank TD 4.76% 02/05/2023         | JP | USD | 74,410,058  | 74,410,058         | 4.32         |
| Bred Banque TD 4.82% 02/05/2023             | FR | USD | 65,480,851  | 65,480,851         | 3.80         |
|   |    |     |             | <b>635,957,965</b> | <b>36.91</b> |

投資資産合計 (含む銀行預金)

|  |  |  |  |                      |              |
|--|--|--|--|----------------------|--------------|
|  |  |  |  | <b>1,708,490,668</b> | <b>99.15</b> |
|--|--|--|--|----------------------|--------------|

外国為替先物取引

A-ACC Shares (GBP) (hedged)

|  |  |  |  |            |                |             |
|--|--|--|--|------------|----------------|-------------|
| Bought GBP Sold USD at 0.888503 09/05/2023 |  |  |  | 31,903,647 | 250,408        | 0.01        |
| Bought USD Sold GBP at 1.251291 09/05/2023 |  |  |  | 32,154,054 | 121,996        | 0.01        |
| Bought GBP Sold USD at 0.798679 07/06/2023 |  |  |  | 32,558,625 | (121,443)      | (0.01)      |
|  |  |  |  |            | <b>250,961</b> | <b>0.01</b> |

A-ACC Shares (PLN) (hedged)

|  |  |  |  |           |                |             |
|--|--|--|--|-----------|----------------|-------------|
| Bought PLN Sold USD at 4.300779 09/05/2023 |  |  |  | 3,622,553 | 106,582        | 0.01        |
| Bought USD Sold PLN at 2.40122 09/05/2023  |  |  |  | 5,849,718 | 18,707         | 0.00        |
| Bought PLN Sold USD at 4.282552 09/05/2023 |  |  |  | 96,695    | 2,423          | 0.00        |
| Bought PLN Sold USD at 4.225649 09/05/2023 |  |  |  | 169,678   | 1,941          | 0.00        |
| Bought PLN Sold USD at 4.277688 09/05/2023 |  |  |  | 54,773    | 1,309          | 0.00        |
| Bought PLN Sold USD at 4.193649 09/05/2023 |  |  |  | 224,578   | 849            | 0.00        |
| Bought PLN Sold USD at 4.220547 09/05/2023 |  |  |  | 54,593    | 555            | 0.00        |
| Bought PLN Sold USD at 4.161372 09/05/2023 |  |  |  | 137,094   | (541)          | (0.00)      |
| Bought PLN Sold USD at 4.174851 09/05/2023 |  |  |  | 1,115,569 | (803)          | (0.00)      |
| Bought PLN Sold USD at 4.137842 09/05/2023 |  |  |  | 263,354   | (1,262)        | (0.00)      |
| Bought PLN Sold USD at 4.171616 07/06/2023 |  |  |  | 5,860,702 | (18,796)       | (0.00)      |
|  |  |  |  |           | <b>110,964</b> | <b>0.01</b> |

その他資産 (負債控除後)

|  |  |  |  |  |            |      |
|--|--|--|--|--|------------|------|
|  |  |  |  |  | 14,244,478 | 0.82 |
|--|--|--|--|--|------------|------|

Net Assets

|  |  |  |  |  |                      |               |
|--|--|--|--|--|----------------------|---------------|
|  |  |  |  |  | <b>1,723,097,071</b> | <b>100.00</b> |
|--|--|--|--|--|----------------------|---------------|

# フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド 運用報告書

## 《第19期》

決算日 2023年11月10日

(計算期間：2023年5月11日から2023年11月10日まで)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |  |
|--------|--|
| 運用方針   | <ul style="list-style-type: none"><li>●日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(リート)(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。)を主要な投資対象とし、配当等収益の確保と、投資信託財産の成長を図ることを目的に運用を行います。</li><li>●リートへの投資は、原則として高位を維持します。</li><li>●外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</li><li>●FILインベストメンツ・インターナショナルに、運用の指図に関する権限を委託します。</li><li>●資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</li></ul> |
| 主要運用対象 | 日本を含む世界各国の取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(リート)(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。)を主要な投資対象とします。  |
| 組入制限   | <ul style="list-style-type: none"><li>●リートへの投資割合には制限を設けません。</li><li>●外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li><li>●株式への直接投資は行いません。</li></ul>   |



## ■最近5期の運用実績

| 決算期               | 基準価額        |           | 投資組<br>資産入<br>信証比 | 託券率    | 投資組<br>資産入<br>証比 | 券率        | 純総<br>資産<br>産額 |
|-------------------|-------------|-----------|-------------------|--------|------------------|-----------|----------------|
|                   | 期騰<br>落     | 中率        |                   |        |                  |           |                |
| 15期 (2021年11月10日) | 円<br>21,686 | %<br>16.0 |                   | %<br>— |                  | %<br>98.6 | 百万円<br>5,487   |
| 16期 (2022年5月10日)  | 22,360      | 3.1       |                   | —      |                  | 96.8      | 5,058          |
| 17期 (2022年11月10日) | 20,652      | △7.6      |                   | —      |                  | 95.6      | 4,753          |
| 18期 (2023年5月10日)  | 20,721      | 0.3       |                   | —      |                  | 95.3      | 4,899          |
| 19期 (2023年11月10日) | 21,515      | 3.8       |                   | —      |                  | 95.9      | 5,053          |

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークは設定しておりません。

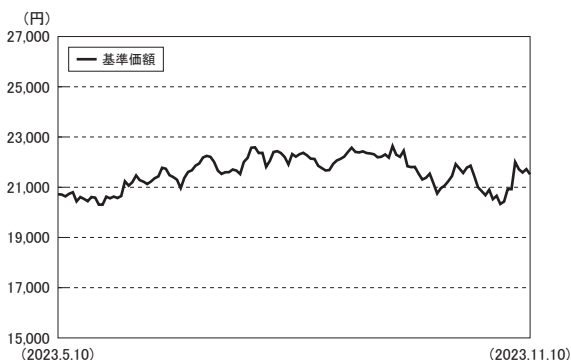
## ■当期中の基準価額等の推移

| 年月日                 | 基準価額        |        | 投資組<br>資産入<br>信証比 | 託券率    | 投資組<br>資産入<br>証比 | 券率        |
|---------------------|-------------|--------|-------------------|--------|------------------|-----------|
|                     | 騰<br>落      | 率      |                   |        |                  |           |
| (期首)<br>2023年5月10日  | 円<br>20,721 | %<br>— |                   | %<br>— |                  | %<br>95.3 |
| 5月末                 | 20,626      | △0.5   |                   | —      |                  | 95.2      |
| 6月末                 | 21,861      | 5.5    |                   | —      |                  | 94.8      |
| 7月末                 | 22,054      | 6.4    |                   | —      |                  | 95.4      |
| 8月末                 | 22,572      | 8.9    |                   | —      |                  | 96.3      |
| 9月末                 | 21,376      | 3.2    |                   | —      |                  | 96.0      |
| 10月末                | 20,428      | △1.4   |                   | —      |                  | 95.9      |
| (期末)<br>2023年11月10日 | 21,515      | 3.8    |                   | —      |                  | 95.9      |

(注) 騰落率は期首比です。

## ■運用経過の説明

### ●基準価額の推移



### ●運用経過

当期のファンドの騰落率は、+3.8%でした。

当ファンドは、従来どおり、ボトム・アップ・アプローチによる個別リートのファンダメンタルズ分析やバリュエーション分析を行い、国別、業種別の分散も考慮した運用を行いました。

### ●投資環境

当期の世界リート相場は米ドルベースで下落しました。

期初は米連邦準備制度理事会(F R B)がインフレ抑制のため、0.25%幅の利上げを実施しました。10回連続となる利上げを受けてリート市場は下落しました。その後F R Bが6月のF O M Cで2022年3月以来初めて利上げを停止したことから、リート市場は前月の下落分を回復し、プラスに転じました。7月は主要中央銀行の利上げサイクル終了が近づいているのではないかと楽観的な見方から、引き続き上昇基調が続きました。しかし8月に入ると、欧米諸国で依然として高水準のインフレ率が続いていることが示されたことから、金融引き締めが継続するのではないかと慎重な見方がリート市場の下押し圧力となりました。9月から10月にかけては、低迷が続く中国の不動産市場への懸念が再燃したことや、債券利回りが十数年ぶりとなる高水準に達し、高い金利水準が長期化するとの見方から、投資家心理が悪化しました。期終盤の11月はF R Bが金利を据え置いたことを受けて、リートは上昇しました。

円ベースでは、米ドルや豪ドル、ユーロ、英ポンドに対して円安となったことがプラスに働きました。

## ■今後の運用方針

トップ・ダウン・アプローチによる国別・業種別配分を考慮したうえで、ボトム・アップ・アプローチによる個別リートのファンダメンタルズ分析を重視した運用を行います。

今後につきましても、調査分析ネットワークを活用し、個別リートの財務内容の精査に基づいた運用を行い、ファンドの付加価値を高める努力をしまる所存です。

## ■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用明細

（2023年5月11日～2023年11月10日）

| 項目                    | 金額        |
|-----------------------|-----------|
| (a) 売買委託手数料<br>（投資証券） | 0円<br>(0) |
| (b) 有価証券取引税<br>（投資証券） | 1<br>(1)  |
| (c) その他費用<br>（保管費用）   | 2<br>(2)  |
| 合計                    | 3<br>3    |

（注）費用明細の項目の概要および注記については、前述の「1万口（元本10,000円）当たりの費用明細」をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況（2023年5月11日から2023年11月10日まで）

### 投資信託受益証券、投資証券

|                             | 買 付     |            | 売 付     |            |
|-----------------------------|---------|------------|---------|------------|
|                             | 単位数又は口数 | 金 額        | 単位数又は口数 | 金 額        |
| 外国                          |         |            |         |            |
| (アメリカ)                      | 千口      | 千アメリカ・ドル   | 千口      | 千アメリカ・ドル   |
| DIGITAL REALTY TRUST INC    | —       | —          | 2.37    | 296        |
|                             | (—)     | (—)        | (—)     | (—)        |
| AMERICAN TOWER CORP         | 0.502   | 89         | —       | —          |
|                             | (—)     | (—)        | (—)     | (—)        |
| WELLTOWER INC               | 0.865   | 70         | —       | —          |
|                             | (—)     | (—)        | (—)     | (—)        |
| DIGITAL CORE REIT           | —       | —          | —       | —          |
|                             | (—)     | (△5)       | (—)     | (—)        |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 6.48    | 107        | —       | —          |
|                             | (—)     | (—)        | (—)     | (—)        |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC   | 0.49    | 87         | —       | —          |
|                             | (—)     | (—)        | (—)     | (—)        |
| SIMON PPTY GROUP INC - REIT | 3.056   | 352        | —       | —          |
|                             | (—)     | (—)        | (—)     | (—)        |
| (シンガポール)                    | 千口      | 千シンガポール・ドル | 千口      | 千シンガポール・ドル |
| Capitaland Ascendas REIT    | —       | —          | —       | —          |
|                             | (—)     | (△6)       | (—)     | (—)        |
| (イギリス)                      | 千口      | 千イギリス・ポンド  | 千口      | 千イギリス・ポンド  |
| SEGRO PLC                   | 34.482  | 255        | —       | —          |
|                             | (—)     | (—)        | (—)     | (—)        |
| LAND SECURITIES GROUP PLC   | —       | —          | —       | —          |
|                             | (2.423) | (16)       | (—)     | (—)        |
| (ユーロ(オランダ))                 | 千口      | 千ユーロ       | 千口      | 千ユーロ       |
| NSI NV                      | —       | —          | —       | —          |
|                             | (1.581) | (44)       | (—)     | (—)        |

|             | 買 付     |       | 売 付     |      |
|-------------|---------|-------|---------|------|
|             | 単位数又は口数 | 金 額   | 単位数又は口数 | 金 額  |
| 外国          |         |       |         |      |
| (ユーロ(フランス)) | 千口      | 千ユーロ  | 千口      | 千ユーロ |
| ICADE       | —       | —     | —       | —    |
|             | (—)     | (△14) | (—)     | (—)  |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付( )内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2023年5月11日から2023年11月10日まで)

期中における当ファンドに係る利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ■ 組入資産の明細 (2023年11月10日現在)

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘 柄     |             | 期 首 (前期末)   | 当 期         |               | 末        |
|---------|-------------|-------------|-------------|---------------|----------|
|         |             | 単位数又は口数     | 単位数又は口数     | 評 価 額         | 比 率      |
| GLP投資法人 |             | 千口<br>1.185 | 千口<br>1.185 | 千円<br>161,871 | %<br>3.2 |
| 合 計     | 口 数 、 金 額   | 1.185       | 1.185       | 161,871       | —        |
|         | 銘 柄 数 、 比 率 | 1           | 1           | —             | 3.2      |

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| 銘柄                           | 期首(前期末)     |           | 当 期 末      |             | 比 率       |      |
|------------------------------|-------------|-----------|------------|-------------|-----------|------|
|                              | 単位数又は口数     | 単位数又は口数   | 評 価 額      |             |           |      |
|                              |             |           | 外 貨 建 金 額  | 邦 貨 換 算 金 額 |           |      |
| (シンガポール)                     | 千口          | 千口        | 千アメリカ・ドル   | 千円          | %         |      |
| DIGITAL CORE REIT            | 489.9       | 489.9     | 257        | 38,947      | 0.8       |      |
| (アメリカ)                       |             |           |            |             |           |      |
| PUBLIC STORAGE INC           | 7.842       | 7.842     | 1,933      | 292,852     | 5.8       |      |
| COPT DEFENSE PROPERTIES      | 20.763      | 20.763    | 488        | 74,013      | 1.5       |      |
| HEALTHPEAK PPTYS INC         | 77.001      | 77.001    | 1,211      | 183,415     | 3.6       |      |
| CAMDEN PROPERTY TRUST - REIT | 15.374      | 15.374    | 1,339      | 202,799     | 4.0       |      |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 22.2        | 19.83     | 2,530      | 383,194     | 7.6       |      |
| AMERICAN TOWER CORP          | 4.352       | 4.854     | 882        | 133,659     | 2.6       |      |
| AMERICAN HOMES 4 RENT CL A   | 66.05       | 66.05     | 2,277      | 344,867     | 6.8       |      |
| WELLTOWER INC                | 20.385      | 21.25     | 1,798      | 272,361     | 5.4       |      |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC  | 67.237      | 73.717    | 1,051      | 159,183     | 3.1       |      |
| PROLOGIS INC                 | 25.661      | 25.661    | 2,650      | 401,330     | 7.9       |      |
| INVITATION HOMES INC         | 70.372      | 70.372    | 2,196      | 332,587     | 6.6       |      |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 6.957       | 7.447     | 1,238      | 187,615     | 3.7       |      |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 29.638      | 29.638    | 1,591      | 241,054     | 4.8       |      |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 32.645      | 32.645    | 2,121      | 321,273     | 6.4       |      |
| SIMON PPTY GROUP INC - REIT  | 4.278       | 7.334     | 834        | 126,373     | 2.5       |      |
| 小 計                          | 口 数 、 金 額   | 960.655   | 969.678    | 24,404      | 3,695,531 | —    |
|                              | 銘 柄 数 <比 率> | 16        | 16         | —           | —         | 73.1 |
| (シンガポール)                     | 千口          | 千口        | 千シンガポール・ドル | 千円          |           |      |
| Capitaland Ascendas REIT     | 541.593     | 541.593   | 1,478      | 164,621     | 3.3       |      |
| 小 計                          | 口 数 、 金 額   | 541.593   | 541.593    | 1,478       | 164,621   | —    |
|                              | 銘 柄 数 <比 率> | 1         | 1          | —           | —         | 3.3  |
| (イギリス)                       | 千口          | 千口        | 千イギリス・ポンド  | 千円          |           |      |
| BRITISH LAND CO PLC          | 203.11      | 203.11    | 636        | 117,887     | 2.3       |      |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC   | 211.245     | 211.245   | 865        | 160,142     | 3.2       |      |
| SEGRO PLC                    | 99.544      | 134.026   | 1,042      | 192,887     | 3.8       |      |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 170.401     | 172.824   | 1,040      | 192,557     | 3.8       |      |
| 小 計                          | 口 数 、 金 額   | 684.3     | 721.205    | 3,584       | 663,474   | —    |
|                              | 銘 柄 数 <比 率> | 4         | 4          | —           | —         | 13.1 |
| ユーロ (オランダ)                   | 千口          | 千口        | 千ユーロ       | 千円          |           |      |
| NSI NV                       | 39.525      | 41.106    | 725        | 117,148     | 2.3       |      |
| 小 計                          | 口 数 、 金 額   | 39.525    | 41.106     | 725         | 117,148   | —    |
|                              | 銘 柄 数 <比 率> | 1         | 1          | —           | —         | 2.3  |
| ユーロ (フランス)                   | 千口          | 千口        | 千ユーロ       | 千円          |           |      |
| ICADE                        | 8.76        | 8.76      | 280        | 45,288      | 0.9       |      |
| 小 計                          | 口 数 、 金 額   | 8.76      | 8.76       | 280         | 45,288    | —    |
|                              | 銘 柄 数 <比 率> | 1         | 1          | —           | —         | 0.9  |
| ユーロ計                         | 口 数 、 金 額   | 48.285    | 49.866     | 1,005       | 162,437   | —    |
|                              | 銘 柄 数 <比 率> | 2         | 2          | —           | —         | 3.2  |
| 合 計                          | 口 数 、 金 額   | 2,234.833 | 2,282.342  | —           | 4,686,064 | —    |
|                              | 銘 柄 数 <比 率> | 23        | 23         | —           | —         | 92.7 |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 比率欄は、純資産総額に対する評価額(邦貨換算金額)の割合。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

(2023年11月10日現在)

| 項 目                     | 当 期 末           |           |
|-------------------------|-----------------|-----------|
|                         | 評 価 額           | 比 率       |
| 投 資 証 券                 | 千円<br>4,847,935 | %<br>95.9 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 205,901         | 4.1       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 5,053,837       | 100.0     |

(注1) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、11月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=151.43円、1シンガポール・ドル=111.34円、1イギリス・ポンド=185.08円、1ユーロ=161.56円です。

(注2) 当期末における外貨建資産(4,887,911千円)の投資信託財産総額(5,053,837千円)に対する比率は、96.7%です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年11月10日現在)

| 項 目                    | 当 期 末              |
|------------------------|--------------------|
| (A) 資 産                | 円<br>5,054,141,388 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等        | 196,439,232        |
| 投 資 証 券(評価額)           | 4,847,935,847      |
| 未 収 入 金                | 303,995            |
| 未 収 配 当 金              | 9,462,314          |
| (B) 負 債                | 373,429            |
| 未 払 金                  | 304,101            |
| 未 払 解 約 金              | 69,282             |
| そ の 他 未 払 費 用          | 46                 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B)     | 5,053,767,959      |
| 元 本                    | 2,348,942,928      |
| 次 期 繰 越 損 益 金          | 2,704,825,031      |
| (D) 受 益 権 総 口 数        | 2,348,942,928口     |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D) | 21,515円            |

(注1) 当ファンドの期首元本額、期中追加設定元本額、期中一部解約元本額は以下の通りです。

|           |                |
|-----------|----------------|
| 期首元本額     | 2,364,696,872円 |
| 期中追加設定元本額 | 41,527,860円    |
| 期中一部解約元本額 | 57,281,804円    |

(注2) 当ファンドの当期末元本の内訳は以下の通りです。

|                              |                |
|------------------------------|----------------|
| フィデリティ・ワールド好配当株・ファンド         | －円             |
| フィデリティ・世界インカム株式・ファンド(毎月決算型)  | 53,244,355円    |
| フィデリティ・世界インカム株式・ファンド(資産成長型)  | 20,139,953円    |
| フィデリティ・世界3資産・ファンド(毎月決算型)     | 1,222,036,584円 |
| フィデリティ・世界分散・ファンド(債券重視型)      | 437,196,004円   |
| フィデリティ・世界分散・ファンド(株式重視型)      | 325,760,222円   |
| フィデリティ・資産分散投信(安定型)           | 26,586,695円    |
| フィデリティ・資産分散投信(成長型)           | 188,881,152円   |
| フィデリティ・世界リート・ファンド(ファンドラップ専用) | 75,097,963円    |

(注3) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

## ■損益の状況

当 期 自2023年5月11日 至2023年11月10日

| 項 目                  | 当 期             |
|----------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益        | 円<br>98,695,699 |
| 受 取 配 当 金            | 93,375,122      |
| 受 取 利 息              | 5,320,577       |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益  | 88,613,935      |
| 売 買 益                | 667,638,509     |
| 売 買 損                | △579,024,574    |
| (C) 信 託 報 酬 等        | △428,027        |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 186,881,607     |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金    | 2,535,246,873   |
| (F) 解 約 差 損 益 金      | △67,850,659     |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金  | 50,547,210      |
| (H) 合 計(D+E+F+G)     | 2,704,825,031   |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H)     | 2,704,825,031   |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示していません。

(注3) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注4) (G)追加信託差損益金とあるのは、追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。