



# アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

愛称：グローバル・チャンピオン

追加型投信／内外／債券

第312期(決算日2023年12月25日) 第313期(決算日2024年1月25日) 第314期(決算日2024年2月26日)  
第315期(決算日2024年3月25日) 第316期(決算日2024年4月25日) 第317期(決算日2024年5月27日)

## ●当ファンドの仕組み

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信／内外／債券
信託期間	無期限
運用方針	①インカム・ゲインの確保とともに信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。 ②世界中の公社債の中から、相対的に投資価値の高い証券に分散投資することにより、インカム・ゲインの確保とともにキャピタル・ゲインの獲得を目指します。 ③分散投資と投資対象証券の相対価値分析を基本とした、アクティブな運用を行います。
主要運用対象	世界各国の投資適格格付けの公社債を主な投資対象とします。
組入制限	①外貨建資産への投資については、制限を設けません。 ②株式への投資制限は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
分配方針	毎月決算を行い、原則として以下の方針により分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の利子等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ②分配金額は、委託者が基準価額水準や市場動向等を勘案して決定します。 ③収益分配金(税引き後)は自動払いぞく投資契約に基づき再投資されます。 ④留保益の運用については、特に制限を設けず、「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用を行います。

## 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド」は、このたび第317期の決算を行いました。

ここに、第312期から第317期の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## アライアンス・バーンスタイン株式会社

〒100-0011

東京都千代田区内幸町二丁目1番6号 日比谷パークフロント

お問合せ先 お客様窓口

電話番号 03-5962-9687

(受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで)

ホームページアドレス <https://www.alliancebernstein.co.jp>

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税込み期		参考指数 騰落率	債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額	
		分	騰					
	円	円	%		%	%	百万円	
288期(2021年12月27日)	6,196	3	△0.0	432.710	△0.1	100.0	△19.0	1,969
289期(2022年1月25日)	6,111	3	△1.3	426.348	△1.5	101.6	△15.7	1,933
290期(2022年2月25日)	6,010	3	△1.6	419.996	△1.5	102.0	△12.3	1,900
291期(2022年3月25日)	6,161	3	2.6	431.308	2.7	103.2	△9.7	1,941
292期(2022年4月25日)	6,232	3	1.2	435.489	1.0	102.4	△4.4	1,946
293期(2022年5月25日)	6,101	3	△2.1	427.956	△1.7	102.1	△5.8	1,898
294期(2022年6月27日)	6,229	3	2.1	440.471	2.9	101.8	△10.0	1,921
295期(2022年7月25日)	6,363	3	2.2	447.550	1.6	101.7	△15.1	1,954
296期(2022年8月25日)	6,283	3	△1.2	440.161	△1.7	101.7	△9.5	1,921
297期(2022年9月26日)	6,215	3	△1.0	437.608	△0.6	101.9	△13.0	1,873
298期(2022年10月25日)	6,249	3	0.6	442.117	1.0	103.8	△14.7	1,872
299期(2022年11月25日)	6,211	3	△0.6	440.986	△0.3	101.9	△8.9	1,845
300期(2022年12月26日)	5,932	3	△4.4	422.550	△4.2	101.4	△10.3	1,757
301期(2023年1月25日)	6,027	3	1.7	427.245	1.1	101.0	△7.1	1,786
302期(2023年2月27日)	6,049	3	0.4	430.723	0.8	103.2	△0.3	1,775
303期(2023年3月27日)	5,999	3	△0.8	428.146	△0.6	102.5	△11.1	1,760
304期(2023年4月25日)	6,153	3	2.6	439.045	2.5	103.6	△7.3	1,803
305期(2023年5月25日)	6,224	3	1.2	445.887	1.6	103.7	0.6	1,819
306期(2023年6月26日)	6,418	3	3.2	463.445	3.9	106.4	△0.2	1,866
307期(2023年7月25日)	6,369	3	△0.7	458.638	△1.0	103.6	△4.2	1,847
308期(2023年8月25日)	6,392	3	0.4	462.133	0.8	107.9	△10.7	1,837
309期(2023年9月25日)	6,406	3	0.3	463.373	0.3	108.9	△8.8	1,827
310期(2023年10月25日)	6,335	3	△1.1	460.637	△0.6	108.0	△2.0	1,803
311期(2023年11月27日)	6,554	3	3.5	475.792	3.3	108.2	△6.0	1,852
312期(2023年12月25日)	6,537	3	△0.2	474.809	△0.2	107.7	△4.4	1,841
313期(2024年1月25日)	6,653	3	1.8	480.889	1.3	107.6	△0.3	1,870
314期(2024年2月26日)	6,752	3	1.5	490.878	2.1	109.2	△3.4	1,891
315期(2024年3月25日)	6,820	3	1.1	495.872	1.0	110.3	△4.4	1,904
316期(2024年4月25日)	6,835	3	0.3	496.770	0.2	111.1	△12.3	1,902
317期(2024年5月27日)	6,966	3	2.0	509.054	2.5	109.9	△6.9	1,937

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 債券組入比率には、新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(注) 債券先物比率は買建比率-売建比率。

※参考指数について

当ファンドの参考指数はブルームバーグ・グローバル総合インデックス(ヘッジなし、円ベース)です。ブルームバーグ・グローバル総合インデックス(ヘッジなし、円ベース)は、原則として基準価額計算日前日付の数値を採用しています。

当該指数に係る著作権等の知的財産権、その他一切の権利は、当該指数等の開発元または公表元に帰属します。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準 価 額		参 考 指 数 率	債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		円	騰 落 率			
第312期	(期 首) 2023年11月27日	6,554	—	475.792	108.2	△ 6.0
	11月末	6,555	0.0	476.285	107.5	△ 1.3
	(期 末) 2023年12月25日	6,540	△0.2	474.809	107.7	△ 4.4
第313期	(期 首) 2023年12月25日	6,537	—	474.809	107.7	△ 4.4
	12月末	6,559	0.3	473.528	107.6	△ 3.0
	(期 末) 2024年 1 月25日	6,656	1.8	480.889	107.6	△ 0.3
第314期	(期 首) 2024年 1 月25日	6,653	—	480.889	107.6	△ 0.3
	1 月末	6,678	0.4	485.495	107.7	△ 0.3
	(期 末) 2024年 2 月26日	6,755	1.5	490.878	109.2	△ 3.4
第315期	(期 首) 2024年 2 月26日	6,752	—	490.878	109.2	△ 3.4
	2 月末	6,747	△0.1	491.040	111.2	△ 3.7
	(期 末) 2024年 3 月25日	6,823	1.1	495.872	110.3	△ 4.4
第316期	(期 首) 2024年 3 月25日	6,820	—	495.872	110.3	△ 4.4
	3 月末	6,826	0.1	496.669	109.9	△ 9.6
	(期 末) 2024年 4 月25日	6,838	0.3	496.770	111.1	△12.3
第317期	(期 首) 2024年 4 月25日	6,835	—	496.770	111.1	△12.3
	4 月末	6,914	1.2	503.060	111.3	△12.3
	(期 末) 2024年 5 月27日	6,969	2.0	509.054	109.9	△ 6.9

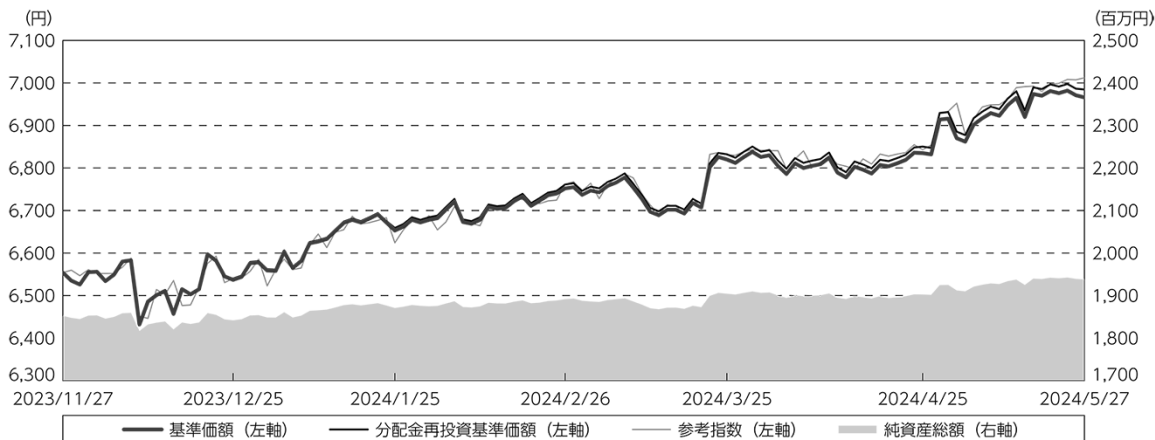
(注) 各期末基準価額は分配金込み、各騰落率は期首比です。  
(注) 債券組入比率には、新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。  
(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。  
(注) 月末は、各月の最終営業日です。

## 運用経過

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド(以下「当ファンド」ということがあります。)の運用状況をご報告いたします。

### 作成期間中の基準価額等の推移

(2023年11月28日～2024年5月27日)



第312期首：6,554円

第317期末：6,966円 (既払分配金(税込み)：18円)

騰落率：6.6% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)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。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 上記騰落率は、小数第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、作成期首(2023年11月27日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 参考指数は、ブルームバーグ・グローバル総合インデックス(ヘッジなし、円ベース)です。

### ○基準価額の推移

基準価額(分配金(税込み)再投資)は、前作成期末比で上昇しました。

### ○基準価額の主な変動要因

#### 上昇要因

- ・保有債券の利息収入
- ・円安米ドル高および円安ユーロ高
- ・保有している金融関連の投資適格社債の価格上昇

## 下落要因

- ・保有している米国国債や日本国債の価格下落

## 投資環境

(2023年11月28日～2024年5月27日)

当作成期間の債券市場については、先進国国債の価格は前作成期末並みの水準となった一方、投資適格社債の価格は上昇しました。また、為替市場では円安米ドル高、円安ユーロ高が進行しました。

### 【債券市場】

**米国国債金利**は前作成期末並みの水準でした。

2023年12月末にかけては、金融引締めを終了に加え、2024年の利下げ開始が示唆されたことを受けて、金利は大きく低下しました。しかし2024年に入ると堅調な経済指標を背景に利下げ期待が後退し、金利は上昇(価格は下落)基調に転じました。インフレ圧力の根強さを示す経済指標などを背景に利下げ開始時期の先送り観測から、金利は上昇基調で推移した後、5月以降はやや低下しました。

**ドイツ国債金利**は当作成期を通じておおむね米国国債金利の動きに連動しました。前作成期末比ではやや低下(価格は上昇)しました。

**投資適格社債市場**は前作成期末比で上昇しました。

2023年12月末にかけてはおおむね上昇基調だったものの、2024年1月から4月末にかけては、欧米の長期金利が上昇したことから、景気後退リスクが意識されて下落しました。その後当作成期末にかけては、欧米の金利がやや低下基調となったことから、上昇しました。

### 【為替市場】

米ドル/円：前作成期末比で円安米ドル高となりました。2023年12月末にかけては、米国国債金利の低下を背景に円高米ドル安となりました。しかしその後は、米国国債金利が上昇に転じたことや、日本銀行(日銀)が大規模緩和の解除を決定したものの緩和的な金融環境維持を示したことから、円安米ドル高が進行しました。

ユーロ/円：米ドル同様日欧の金利差を背景に、前作成期末比で円安ユーロ高となりました。

## 運用概況

(2023年11月28日～2024年5月27日)

当ファンドは、世界各国の投資適格債を対象に、調査チームによる相対的投資価値分析を基本としたアクティブ運用を行います。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。

運用にあたっては、当作成期間も引き続き、ファンダメンタル分析と計量分析を融合した運用判断に基づき、相対的に高い収益が期待される国、債券セクターや銘柄に対して機動的に資産配分を行いました。

その結果、国債・政府機関債や社債券等の組入れは低下した一方、モーゲージ証券の組入れは上昇しました。

### < 公社債のセクター別組入比率 >

前作成期末(2023年11月27日現在)

セクター	比率
国債・政府機関債	59.2%
社債券等	31.2%
モーゲージ証券	17.9%
現金等	-8.2%



当作成期末(2024年5月27日現在)

セクター	比率
国債・政府機関債	58.8%
社債券等	30.5%
モーゲージ証券	20.5%
現金等	-9.9%

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

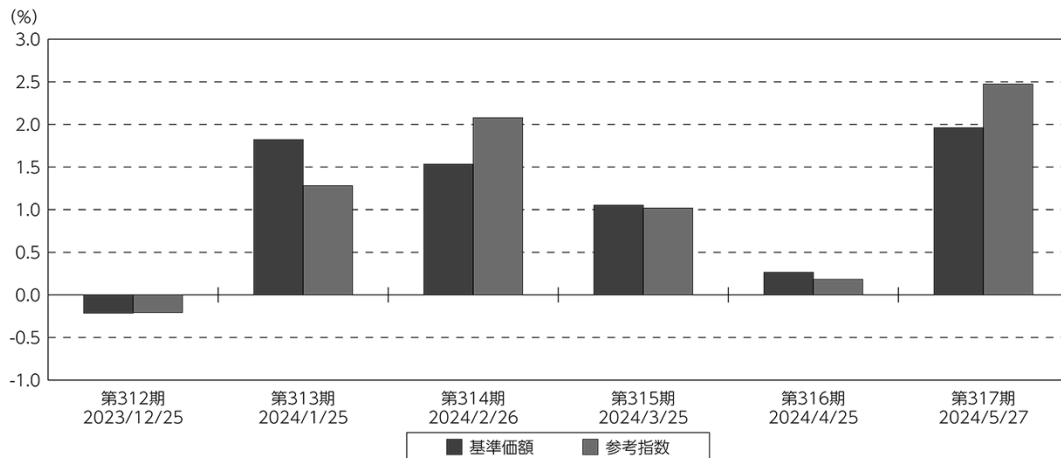
(注) 小数第2位を四捨五入。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

(2023年11月28日～2024年5月27日)

当ファンドは、特定の指数を上回ることを目指す運用を行っていないため、ベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（ヘッジなし、円ベース）です。

## 分配金

(2023年11月28日～2024年5月27日)

当作成期間の収益分配については、配当等収益に基づき、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定しました。各決算期の分配金については、以下をご覧ください(当作成期間合計：18円)。なお、収益分配に充てなかった利益については、信託財産内に留保し「運用の基本方針」に基づいて運用を行います。

## 分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり、税込み)

項 目	第312期	第313期	第314期	第315期	第316期	第317期
	2023年11月28日～ 2023年12月25日	2023年12月26日～ 2024年1月25日	2024年1月26日～ 2024年2月26日	2024年2月27日～ 2024年3月25日	2024年3月26日～ 2024年4月25日	2024年4月26日～ 2024年5月27日
当期分配金	3	3	3	3	3	3
(対基準価額比率)	0.046%	0.045%	0.044%	0.044%	0.044%	0.043%
当期の収益	3	3	3	3	3	3
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	309	322	336	349	359	376

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）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。

(注) 「当期の収益」、「当期の収益以外」は小数以下切り捨てで算出しているため合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注) 上記表は、経費控除後の数値です。分配金の計算過程については、「損益の状況」の注記をご覧ください。

## 今後の運用方針

2024年の世界経済は、予想以上に堅調に推移しており、プラス成長が続くと予想しています。一方、落ち着きを見せ始めていたインフレは、实体经济の底堅さや地政学リスクによるコモディティ価格の上昇などから高位で推移しており、各国中央銀行も利下げを視野に入れているものの、慎重な対応をとる可能性もあります。また、これまでの利上げの影響や金融機関への規制強化から与信市場がタイト化する可能性、弱含みの中国経済、地政学リスクなどを背景に景気後退に陥る状況にならないか注視が必要です。

このような見通しの下、国債や投資適格社債の種別・銘柄など、投資機会を見極めて組み入れる方針です。

※将来の市場環境の変動等により、当該運用方針が変更される場合があります。



○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年11月28日～2024年5月27日)

項 目	第312期～第317期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬	57	0.848	(a) 信託報酬＝作成期間中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(28)	(0.410)	委託した資金の運用、基準価額の算出、法定書類作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(28)	(0.410)	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管理および事務手続き等の対価
（ 受 託 会 社 ）	( 2 )	(0.027)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.004	(b) 売買委託手数料＝作成期間中の売買委託手数料÷作成期間中の平均受益権口数
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.004)	売買委託手数料は、組入金融商品等の売買の際に売買仲介人に支払う手数料
(c) そ の 他 費 用	6	0.083	(c) その他費用＝作成期間中のその他費用÷作成期間中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 3 )	(0.047)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.007)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 2 )	(0.028)	その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	63	0.935	
作成期間中の平均基準価額は、6,713円です。			

(注) 作成期間中の費用（消費税等の課されるものは消費税等相当額を含めて表示）は、追加・解約により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。

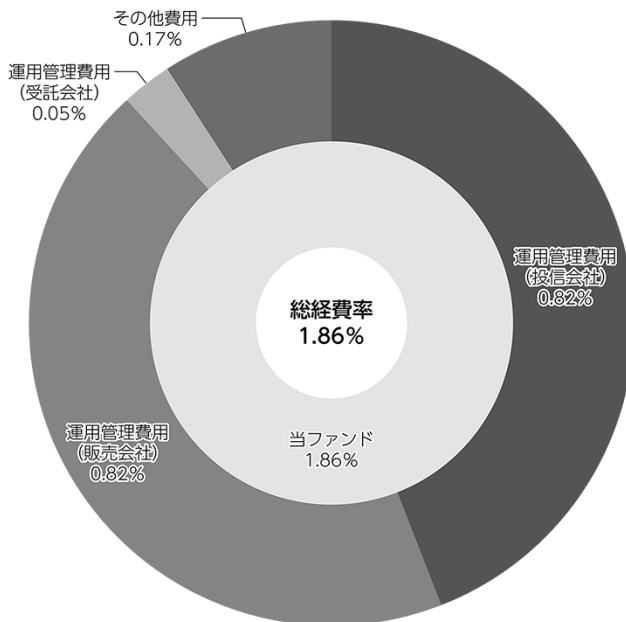
(注) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。ただし、平均基準価額は円未満切り捨て。

(注) 各比率は、1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を作成対象期間の平均受益権口数に作成対象期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.86%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2023年11月28日～2024年5月27日)

公社債

			第312期～第317期		
			買付額	売付額	
国内	国債証券		千円	千円	
			114,634	100,817	
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル	千米ドル	
			1,303	1,745	
		地方債証券		43	
		特殊債証券	14,080	13,820	
	カナダ	社債証券	566	606	
				(206)	
		千カナダドル		千カナダドル	
		国債証券	90	279	
		地方債証券	75	25	
		特殊債証券	25	—	
		社債証券	24	37	
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ	千メキシコペソ	
			—	997	
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	
			555,188	—	
	ペルー	国債証券	千ペルーソル	千ペルーソル	
			170	76	
	ユーロ			千ユーロ	千ユーロ
	国	ドイツ	国債証券	633	387
			社債証券	12	52
		イタリア	国債証券	304	340
			社債証券	99	100
フランス		国債証券	—	68	
オランダ		特殊債証券	—	88	
ベルギー		国債証券	13	10	
オーストリア		国債証券	—	21	
フィンランド		国債証券	—	242	
その他		国債証券	128	167	
		特殊債証券	—	131	
		社債証券	287	94	
イギリス		国債証券	千英ポンド	千英ポンド	
			530	244	
		社債証券	—	24	
スウェーデン		国債証券	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ	
		76	—		
ハンガリー	国債証券	千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント		
		34,612	—		

アラライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

			第312期～第317期	
			買付額	売付額
外 国	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ
			429	—
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル
			60	61
			256	157
		特殊債券	—	49
中国	国債証券	千中国元	千中国元	
		—	1,104	
インドネシア	国債証券	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア	
		3,333,971	—	

- (注) 金額は受け渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。  
 (注) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。  
 (注) ( )内は償還等による増減分で、上段の数値には含まれておりません。  
 (注) 単位未満は切り捨て。  
 (注) 一印は該当なし。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		第312期～第317期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	債券先物取引	百万円 —	百万円 —	百万円 175	百万円 117
外国	債券先物取引	1,071	1,164	1,160	1,290

- (注) 金額は受け渡し代金。  
 (注) 取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。  
 (注) 単位未満は切り捨て。  
 (注) 一印は該当なし。

直物為替先渡取引状況

種 類 別		第312期～第317期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
米ドル		百万円	百万円	百万円	百万円
	(チリペソ)	59	62	60	62
	(コロンビアペソ)	115	101	129	101
	(インドネシアルピア)	62	35	77	35
	(インドルピー)	38	9	19	9
	(韓国ウォン)	72	53	63	53
	(マレーシアリンギット)	13	13	13	13
	(ペルーソル)	85	83	89	83
	(新台湾ドル)	38	38	37	38

- (注) 取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。  
 (注) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2023年11月28日～2024年5月27日)

該当事項はございません。

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

(2024年5月27日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第317期末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	174,950	164,453	8.5	—	4.3	4.2	—
合 計	174,950	164,453	8.5	—	4.3	4.2	—

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(注) ー印は該当なし。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	第317期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第161回利付国債 (5年)	0.3	81,550	80,900	2028/6/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	12,300	12,673	2051/3/20
第16回利付国債 (40年)	1.3	14,400	10,846	2063/3/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	8,100	5,737	2049/3/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	2,250	1,592	2050/9/20
第82回利付国債 (30年)	1.8	25,150	23,465	2054/3/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	10,950	10,100	2036/12/20
第183回利付国債 (20年)	1.4	20,250	19,136	2042/12/20
合 計		174,950	164,453	

(注) 単位未満は切り捨て。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	第317期末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 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	千米ドル 6,794	千米ドル 6,197	千円 972,163	% 50.2	% 0.0	% 33.9	% 15.3	% 1.0
カナダ	千カナダドル 822	千カナダドル 811	93,101	4.8	0.2	2.9	1.9	—
コロンビア	千コロンビアペソ 472,300	千コロンビアペソ 533,165	21,588	1.1	—	1.1	—	—
ペルー	千ペルーソル 97	千ペルーソル 98	4,146	0.2	—	0.2	—	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	425	402	68,573	3.5	—	2.9	0.6	—
イタリア	225	225	38,358	2.0	—	2.0	—	—
フランス	408	392	66,793	3.4	—	0.1	3.4	—
オランダ	100	102	17,396	0.9	—	—	0.9	—
スペイン	111	114	19,437	1.0	—	1.0	—	—
ベルギー	57	49	8,507	0.4	—	0.4	—	—
オーストリア	434	366	62,385	3.2	—	3.2	—	—
その他	1,791	1,747	297,336	15.3	—	7.7	5.9	1.7
イギリス	千英ポンド 677	千英ポンド 621	124,243	6.4	—	6.3	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 495	千スウェーデンクローナ 660	9,714	0.5	—	—	0.5	—
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 41,140	千ハンガリーフォリント 34,811	15,427	0.8	—	0.8	—	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 454	千ポーランドズロチ 423	16,936	0.9	—	0.9	—	—
オーストラリア	千オーストラリアドル 730	千オーストラリアドル 661	68,740	3.5	—	1.8	1.2	0.5
中国	千中国元 1,200	千中国元 1,244	26,888	1.4	—	—	1.4	—
インドネシア	千インドネシアルピア 3,326,000	千インドネシアルピア 3,326,831	32,602	1.7	—	—	1.7	—
合 計	—	—	1,964,343	101.4	0.2	65.3	32.9	3.3

(注) 邦貨換算金額は、第317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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(注) 一印は該当なし。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 格付はムーディーズとS&Pのうちいずれか高い方を採用して集計したものです。

アラライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利率	額面金額	第317期末		償還年月日
				評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY	0.5	163	143	22,438	2027/8/31
	US TREASURY	2.875	180	168	26,471	2028/5/15
	US TREASURY	3.625	213	205	32,258	2028/5/31
	US TREASURY	1.125	289	251	39,423	2028/8/31
	US TREASURY	4.0	131	128	20,090	2029/1/31
	US TREASURY	1.125	637	383	60,218	2040/8/15
	US TREASURY	1.75	23	15	2,426	2041/8/15
	US TREASURY	3.0	68	52	8,241	2045/11/15
	US TREASURY	2.0	128	76	12,012	2051/8/15
	US TREASURY	4.125	154	142	22,382	2053/8/15
	US TSY INFL IX N/B	0.125	240	247	38,895	2027/4/15
	US TSY INFL IX N/B	1.375	150	145	22,807	2033/7/15
	地方債証券	CMWLTH FING AUTH PA	4.144	5	4	721
FL ST BRD ADMIN FIN-A		5.526	11	11	1,737	2034/7/1
FLORIDA ST BRD OF ADM		2.154	20	16	2,636	2030/7/1
NJ ECON-SER A		7.425	14	14	2,329	2029/2/15
NJ ST TRANSN-BAB-C		5.754	10	10	1,573	2028/12/15
特殊債券 (除く金融債)	GNMAII 30 YR MA 8428	5.0	68	66	10,437	2052/11/20
	GNMAII30YR TBA 2.5 JUN24	2.5	159	132	20,839	2054/6/1
	GNMAII30YR TBA 3.0 JUN24	3.0	198	171	26,896	2054/6/1
	GNMAII30YR TBA 4.0 JUN24	4.0	35	32	5,153	2054/6/1
	GNMAII30YR TBA 4.5 JUN24	4.5	218	206	32,368	2054/6/1
	GNMAII30YR TBA 5.0 JUN24	5.0	194	188	29,557	2054/6/1
	GNMAII30YR TBA 5.5 JUN24	5.5	318	316	49,658	2054/6/1
	UMBS 30YR TBA 2.0 JUN24	2.0	149	115	18,077	2054/6/1
	UMBS 30YR TBA 3.5 JUN24	3.5	77	68	10,745	2054/6/1
	UMBS 30YR TBA 5.5 JUN24	5.5	183	180	28,287	2054/6/1
	UMBS 30YR TBA 6.0 JUN24	6.0	240	240	37,797	2054/6/1
普通社債券	AHT1 2018-ASHF A	6.389	74	73	11,534	2035/4/15
	AIRCASTLE LTD	5.25	15	14	2,329	2025/8/11
	AIRCASTLE LTD	5.95	8	7	1,251	2029/2/15
	AMGEN INC	5.15	32	31	5,005	2028/3/2
	AT&T INC	4.5	4	3	573	2035/5/15
	ATHENE GLOBAL FUNDING	6.195016	37	37	5,805	2026/5/8
	AVIATION CAPITAL GROUP	4.125	16	15	2,452	2025/8/1
	AVIATION CAPITAL GROUP	1.95	10	9	1,469	2026/1/30
	AVIATION CAPITAL GROUP	1.95	14	12	2,010	2026/9/20
	BANK OF AMERICA CORP	3.559	60	57	9,068	2027/4/23
	BANK OF AMERICA CORP	3.846	23	20	3,159	2037/3/8
	BOEING CO	3.25	4	3	571	2028/2/1
	BOEING CO	6.298	6	6	949	2029/5/1
	BOEING CO	5.15	10	9	1,495	2030/5/1
	BOEING CO	3.625	7	6	955	2031/2/1

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

銘柄		第317期末				
		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		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券	BOEING CO	6.528	10	10	1,596	2034/5/1
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5.75	12	12	1,942	2031/2/1
	BROADRIDGE FINANCIAL SOL	2.6	40	33	5,245	2031/5/1
	BVABS 2023-CAR3 A2	6.291	13	13	2,156	2032/7/26
	BX 2019-IMC A	6.3633	47	46	7,323	2034/4/15
	CAS 2014-C03 2M2	8.3445	2	2	391	2024/7/25
	CAS 2016-C01 1M2	12.1945	5	6	957	2028/8/25
	CAS 2016-C01 2M2	12.3945	4	4	712	2028/8/25
	CAS 2016-C02 1M2	11.4445	11	11	1,805	2028/9/25
	CAS 2021-R01 1M2	6.88002	10	10	1,652	2041/10/25
	CAS 2021-R03 1M1	6.18002	35	35	5,567	2041/12/25
	CAS 2021-R03 1M2	6.98002	100	100	15,793	2041/12/25
	CAS 2022-R01 1M2	7.23002	100	101	15,848	2041/12/25
	CAS 2022-R07 1M1	8.28002	10	10	1,653	2042/6/25
	CAS 2023-R02 1M1	7.63002	41	42	6,651	2043/1/25
	CBS CORP	5.5	20	17	2,723	2033/5/15
	CHARTER COMM OPT LLC/CAP	5.375	20	15	2,497	2047/5/1
	CITIGROUP INC	2.014	26	25	3,975	2026/1/25
	CNH INDUSTRIAL CAP LLC	5.5	34	34	5,360	2029/1/12
	CODELCO INC	5.625	35	34	5,338	2035/9/21
	COMMONSPIRIT HEALTH	5.318	32	31	4,896	2034/12/1
	CONTINENTAL RESOURCES	5.75	8	7	1,236	2031/1/15
	CONTINENTAL RESOURCES	2.875	35	28	4,448	2032/4/1
	COX COMMUNICATIONS INC	5.45	7	7	1,098	2028/9/15
	COX COMMUNICATIONS INC	1.8	37	29	4,620	2030/10/1
	COX COMMUNICATIONS INC	5.7	5	4	779	2033/6/15
	CVS HEALTH CORP	5.7	25	24	3,912	2034/6/1
	DELL INT LLC / EMC CORP	8.1	32	38	5,999	2036/7/15
	DEVON ENERGY CORP	7.95	18	20	3,210	2032/4/15
	DLAA 2023-1A A2	5.93	11	11	1,748	2026/7/20
	DTE ENERGY CO	5.85	18	18	2,854	2034/6/1
	ELEVANCE HEALTH INC	5.85	37	37	5,927	2036/1/15
	ERAC USA FINANCE LLC	4.6	13	12	1,996	2028/5/1
	ERAC USA FINANCE LLC	4.9	24	23	3,642	2033/5/1
	FISERV INC	5.625	37	37	5,835	2033/8/21
	FOX CORP	5.476	20	18	2,957	2039/1/25
	GENERAL MOTORS FINL CO	6.1	38	38	5,996	2034/1/7
	GILEAD SCIENCES INC	5.25	37	37	5,809	2033/10/15
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	1.542	47	42	6,726	2027/9/10
	GRUPO TELEVISIA SAB	8.5	22	24	3,907	2032/3/11
	GWT 2024-WOLF A	6.85877	23	23	3,610	2039/3/15
	HARLEY-DAVIDSON FINL SER	3.35	3	2	458	2025/6/8
	HARLEY-DAVIDSON FINL SER	3.05	27	25	3,944	2027/2/14
	HASBRO INC	3.55	27	25	4,022	2026/11/19



アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

銘柄		第317期末				
		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		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券	HASBRO INC	6.05	11	10	1,723	2034/5/14
	HINTT 2024-A A	5.49	47	47	7,484	2043/3/15
	HSBC HOLDINGS PLC	4.755	207	202	31,719	2028/6/9
	HUMANA INC	5.95	38	38	6,075	2034/3/15
	HYUNDAI CAPITAL AMERICA	1.8	20	17	2,754	2028/1/10
	HYUNDAI CAPITAL AMERICA	2.1	26	22	3,544	2028/9/15
	IHSFR 2018-SFR4 A	6.53148	83	83	13,134	2038/1/17
	INTERPUBLIC GROUP COS	5.375	23	22	3,559	2033/6/15
	JPMBB 2014-C21 B	4.3413	17	16	2,598	2047/8/15
	KYNDRYL HOLDINGS INC	2.05	26	23	3,747	2026/10/15
	LADAR 2023-2A A2	5.93	9	9	1,418	2027/6/15
	LEAR CORP	3.5	33	29	4,624	2030/5/30
	MARRIOTT INTERNATIONAL	2.85	10	8	1,333	2031/4/15
	MDC HOLDINGS INC	6.0	20	19	3,101	2043/1/15
	META PLATFORMS INC	4.65	11	9	1,480	2062/8/15
	NEW YORK LIFE GLOBAL FDG	5.8343	21	20	3,293	2026/6/9
	NIAGARA MOHAWK POWER	4.278	19	17	2,813	2028/12/15
	NIAGARA MOHAWK POWER	5.29	19	18	2,890	2034/1/17
	PULTE GROUP INC	7.875	33	37	5,912	2032/6/15
	ROSS STORES INC	1.875	35	28	4,442	2031/4/15
	RYDER SYSTEM INC	6.6	36	38	6,022	2033/12/1
	SANTANDER HOLDINGS USA	6.174	16	16	2,530	2030/1/9
	SBA TOWER TRUST	3.869	25	24	3,891	2049/10/15
	SBALT 2023-A A2	6.27	20	20	3,160	2026/4/20
	STACR 2021-DNA5 M2	6.98002	8	8	1,316	2034/1/25
	STACR 2021-HQA4 M1	6.28002	37	37	5,937	2041/12/25
	SUNCOR ENERGY INC	6.85	15	16	2,524	2039/6/1
	SUTTER HEALTH	5.164	9	8	1,407	2033/8/15
	T-MOBILE USA INC	5.75	14	14	2,248	2034/1/15
	THOMSON REUTERS CORP	5.5	20	20	3,138	2035/8/15
	VISTRA OPERATIONS CO LLC	6.0	8	7	1,251	2034/4/15
	WELLS FARGO & CO	5.499	9	8	1,400	2035/1/23
	XCAP 2023-1A A2	6.18	100	100	15,728	2028/12/15
小	計				972,163	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	3.5	70	69	7,950	2028/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT I/L	4.0	20	40	4,621	2031/12/1
地方債証券	CALGARY (CITY OF)	4.2	8	7	902	2034/6/1
	PROVINCE OF ONTARIO	2.9	86	66	7,651	2046/12/2
特殊債券 (除く金融債)	CANADA HOUSING TRUST	3.95	85	84	9,749	2028/6/15
	CANADA HOUSING TRUST	4.25	25	25	2,919	2034/3/15
普通社債券	407 INTERNATIONAL INC	5.75	51	53	6,147	2036/2/14
	AIR LEASE CORP	5.4	22	22	2,553	2028/6/1
	BELL CANADA	4.55	3	2	338	2030/2/9

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

銘柄		第317期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	普通社債券	BELL CANADA	3.0	5	4	510	2031/3/17
		BELL CANADA	5.85	21	22	2,531	2032/11/10
		BELL CANADA	5.15	27	25	2,941	2053/2/9
		CU INC	5.183	35	35	4,104	2035/11/21
		ELECTRICITE DE FRANCE SA	5.993	27	28	3,232	2030/5/23
		ENBRIDGE INC	6.1	47	49	5,734	2032/11/9
		ENBRIDGE PIPELINES INC	2.82	14	12	1,413	2031/5/12
		GENERAL MOTORS FINL CO	5.1	3	3	345	2028/7/14
		METRO INC	4.657	37	36	4,188	2033/2/7
		SAPUTO INC	2.297	41	37	4,271	2028/6/22
		TELUS CORP	3.15	30	27	3,149	2030/2/19
		TELUS CORP	5.25	26	26	3,011	2032/11/15
		TORONTO-DOMINION BANK	1.896	63	56	6,519	2028/9/11
		TRANSCANADA PIPELINES	5.33	26	26	3,040	2032/5/12
		VERIZON COMMUNICATIONS	2.375	50	45	5,270	2028/3/22
小	計					93,101	
コロンビア			千コロンビアペソ	千コロンビアペソ			
	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	13.25	472,300	533,165	21,588	2033/2/9
小	計					21,588	
ペルー			千ペルーソル	千ペルーソル			
	国債証券	REPUBLIC OF PERU	7.3	97	98	4,146	2033/8/12
小	計					4,146	
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	2.1	73	71	12,232	2029/4/12
		BUNDESREP. DEUTSCHLAND	2.2	278	269	45,840	2034/2/15
		BUNDESREP. DEUTSCHLAND	1.0	56	45	7,738	2038/5/15
		BUNDESREP. DEUTSCHLAND	2.5	16	16	2,762	2054/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	96	95	16,259	2031/2/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2	69	71	12,110	2034/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.05	43	43	7,340	2037/10/30
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	17	15	2,647	2038/3/1
フランス	国債証券	FRENCH TREASURY	2.5	8	7	1,278	2043/5/25
	特殊債券 (除く金融債)	CAISSE FRANCAISE DE FIN	3.125	100	99	16,915	2027/11/16
	普通社債券	CIE FINANCEMENT FONCIER	0.01	100	93	15,832	2026/7/15
		SNCF RESEAU	0.875	100	89	15,277	2029/1/22
		SUEZ	4.625	100	102	17,489	2028/11/3
オランダ	普通社債券	ING GROEP NV	4.5	100	102	17,396	2029/5/23
スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	3.9	111	114	19,437	2039/7/30
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	2.85	13	13	2,315	2034/10/22
		BELGIUM KINGDOM	1.45	18	15	2,590	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	25	21	3,601	2038/6/22
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	—	39	33	5,619	2030/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	140	114	19,569	2031/2/20

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

銘	柄	第317期末					
		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		
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ							
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.9	255	218	37,196	2032/2/20
その他	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT	4.0	29	28	4,921	2029/7/25
		POLAND GOVERNMENT	2.75	33	31	5,354	2032/5/25
		REPUBLIC OF INDONESIA	1.0	100	86	14,762	2029/7/28
		ROMANIA	6.625	25	27	4,610	2029/9/27
		UNITED MEXICAN STATES	4.4899	100	100	17,080	2032/5/25
	地方債証券	JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	0.01	100	88	15,046	2028/2/2
		PROVINCE OF QUEBEC	0.875	100	93	15,856	2027/5/4
	特殊債券 (除く金融債)	DEVELOPMENT BK OF JAPAN	3.125	100	99	16,879	2028/4/13
	普通社債券	ALTRIA GROUP INC	3.125	100	91	15,616	2031/6/15
		BOOKING HOLDINGS INC	4.75	100	107	18,237	2034/11/15
		CARGILL INC	3.875	100	101	17,282	2030/4/24
		COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA	3.768	100	100	17,179	2027/8/31
		CREDIT SUISSE AG LONDON	0.25	100	94	16,069	2026/1/5
		HONEYWELL INTERNATIONAL	4.125	100	102	17,437	2034/11/2
		JPMORGAN CHASE & CO	4.457	100	104	17,704	2031/11/13
		MORGAN STANLEY	4.656	100	102	17,511	2029/3/2
		ROYAL BANK OF CANADA	0.125	104	94	16,102	2027/4/26
SUMITOMO MITSUI TR BK LT		3.629	100	99	16,961	2026/4/6	
TOYOTA FINANCE AUSTRALIA		3.386	100	98	16,811	2030/3/18	
WESTPAC BANKING CORP		1.079	100	93	15,910	2027/4/5	
小	計					578,789	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド			
	国債証券	UK TREASURY	3.25	50	46	9,373	2033/1/31
		UK TREASURY	4.625	357	367	73,514	2034/1/31
		UK TREASURY	3.75	23	22	4,397	2038/1/29
		UK TREASURY	1.25	28	17	3,424	2041/10/22
		UK TREASURY	4.75	24	24	4,994	2043/10/22
		UK TREASURY	0.875	91	44	8,868	2046/1/31
		UK TREASURY	1.25	11	5	1,117	2051/7/31
	普通社債券	ANGLIAN WATER SERV FIN	6.293	30	31	6,199	2030/7/30
		HEATHROW FUNDING LTD	6.45	50	52	10,578	2031/12/10
		THAMES WATER UTIL FIN	6.75	10	8	1,774	2028/11/16
小	計					124,243	
スウェーデン			千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ			
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT I/L	0.158597	135	172	2,532	2026/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT I/L	0.160346	285	355	5,220	2027/12/1
		SWEDISH GOVERNMENT I/L	5.57445	75	133	1,961	2028/12/1
小	計					9,714	
ハンガリー			千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント			
	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT	4.75	38,530	33,133	14,684	2032/11/24
		HUNGARY GOVERNMENT	3.0	2,610	1,678	743	2038/10/27
小	計					15,427	

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

銘	柄	第317期末				
		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	
ポーランド		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
	国債証券 POLAND GOVERNMENT	5.0	454	423	16,936	2034/10/25
小	計				16,936	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	地方債証券 NEW S WALES TREASURY CRP	2.0	103	81	8,461	2033/3/8
	NEW S WALES TREASURY CRP	4.75	179	172	17,962	2035/2/20
	TREASURY CORP VICTORIA	2.25	73	55	5,781	2034/11/20
	TREASURY CORP VICTORIA	2.0	40	26	2,776	2037/11/20
	特殊債券 (除く金融債) BNG BANK NV	3.5	101	97	10,160	2027/7/19
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1.8	25	23	2,427	2027/1/19
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	0.75	35	31	3,247	2027/7/15
	INTL FINANCE CORP	4.45	48	48	4,991	2027/5/14
	KFW	4.1	96	95	9,919	2026/2/20
	普通社債券 VODAFONE GROUP PLC	4.2	30	28	3,012	2027/12/13
小	計				68,740	
中国			千中国元	千中国元		
	国債証券 CHINA GOVERNMENT	3.01	1,200	1,244	26,888	2028/5/13
小	計				26,888	
インドネシア			千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
	国債証券 INDONESIA GOVERNMENT	6.875	3,326,000	3,326,831	32,602	2029/4/15
小	計				32,602	
合	計				1,964,343	

(注) 邦貨換算金額は、第317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) 単位未満は切り捨て。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			第317期末	
			買 建 額	売 建 額
国内	債券先物取引	海外市場JGB (SGX) min	百万円 —	百万円 57
		債券先物取引		
外	債券先物取引	10 ULTRA FUT	—	35
		2YR T-NOTES	—	63
		30YR T-BOND	—	18
		5YR T-NOTES	116	—
		SFE 10YR TBO	—	23
		SFE 3YR TBON	—	10
		CAN10YR BOND	13	—
国	債券先物取引	EUR-SCHATZ	—	35
		10YR KTB	38	—
		3YR KTB	—	35
		EURO-OAT	—	21

(注) 邦貨換算金額は、第317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) 単位未満は切り捨て。

(注) —印は該当なし。

直物為替先渡取引残高

銘柄別		取引契約残高			
		第317期末想定元本額			
		買 建 額		売 建 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	外貨建金額	邦貨換算金額
米ドル		千米ドル	百万円	千米ドル	百万円
	(チリペソ)	5	0	—	—
	(コロンビアペソ)	121	19	191	30
	(インドネシアルピア)	238	37	270	42
	(インドルピー)	188	29	62	9
	(韓国ウォン)	229	36	62	9
	(マレーシアリングット)	44	6	—	—
	(ペルーソル)	81	12	101	15

(注) 邦貨換算金額は、第317期末の外貨建金額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) 単位未満は切り捨て。

(注) —印は該当なし。

## ○投資信託財産の構成

(2024年5月27日現在)

項 目	第317期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 2, 128, 796	% 95. 8
コール・ローン等、その他	93, 926	4. 2
投資信託財産総額	2, 222, 722	100. 0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注) 第317期末における外貨建純資産 (1, 760, 662千円) の投資信託財産総額 (2, 222, 722千円) に対する比率は79. 2%です。

(注) 外貨建資産は、第317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、邦貨換算に使用した為替レートは、1米ドル=156. 87円、1カナダドル=114. 76円、100コロンビアペソ=4. 0491円、1ペルーソル=41. 9148円、1ユーロ=170. 17円、1英ポンド=199. 84円、1スウェーデンクローナ=14. 70円、100ハンガリーフォリント=44. 3183円、1ポーランドズロチ=39. 9954円、1オーストラリアドル=103. 94円、1中国元=21. 6006円、100インドネシアルピア=0. 98円、100韓国ウォン=11. 49円です。

## ○特定資産の価格等の調査

### 調査を行った者の名称

EY新日本有限責任監査法人

### 調査の結果及び方法の概要

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンドにおいて行った取引のうち、調査依頼を行った取引は2023年11月28日から2024年5月27日までの間で直物為替先渡取引（以下「NDF」といいます。）107件及び有価証券（外国貸付債権信託受益証券）取引4件でした。投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）第11条第2項に基づき、これらのNDF取引については比較可能な価格のほか、通貨、期日、レート、取引の相手方の名称、その他当該取引の内容に関して、有価証券取引については比較可能な価格のほか、銘柄、数量、その他当該有価証券の内容に関してEY新日本有限責任監査法人へその調査を委託し、日本公認会計士協会が公表した専門業務実務指針4460「投資信託及び投資法人における特定資産の価格等の調査に係る合意された手続業務に関する実務指針」に基づく調査結果として合意された手続実施結果報告書を受領する予定です。

なお、本調査は財務諸表監査の一部ではなく、また、価格の妥当性や内部管理体制について保証を提供するものではありません。

以上

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第312期末	第313期末	第314期末	第315期末	第316期末	第317期末
	2023年12月25日現在	2024年1月25日現在	2024年2月26日現在	2024年3月25日現在	2024年4月25日現在	2024年5月27日現在
	円	円	円	円	円	円
<b>(A) 資産</b>	<b>3,141,146,046</b>	<b>3,393,242,008</b>	<b>3,490,088,338</b>	<b>2,984,597,609</b>	<b>3,273,850,807</b>	<b>3,318,322,111</b>
コール・ローン等	40,433,050	63,509,405	39,801,606	42,389,630	42,374,087	54,928,341
公社債(評価額)	1,983,302,702	2,012,349,689	2,065,709,318	2,101,176,659	2,113,775,892	2,128,796,939
未収入金	1,091,990,701	1,288,454,326	1,354,606,716	812,208,071	1,089,093,777	1,103,965,935
未収利息	12,085,163	13,408,331	13,941,104	14,517,008	15,379,411	15,715,886
前払費用	1,655,924	1,944,025	2,068,603	1,547,565	1,227,928	2,531,146
その他未収収益	1,853,086	2,065,221	2,301,191	2,551,601	2,773,771	3,022,827
差入委託証拠金	9,825,420	11,511,011	11,659,800	10,207,075	9,225,941	9,361,037
<b>(B) 負債</b>	<b>1,299,456,014</b>	<b>1,522,548,505</b>	<b>1,598,556,705</b>	<b>1,080,284,761</b>	<b>1,371,370,581</b>	<b>1,380,541,302</b>
未払金	1,296,101,638	1,518,547,831	1,594,888,085	1,076,901,267	1,367,439,649	1,376,806,017
未払収益分配金	845,194	843,580	840,465	837,658	834,980	834,527
未払解約金	85,687	445,968	—	68,260	322,434	—
未払信託報酬	2,402,472	2,687,893	2,804,161	2,456,660	2,750,361	2,876,750
未払利息	107	76	90	—	—	—
その他未払費用	20,916	23,157	23,904	20,916	23,157	24,008
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>1,841,690,032</b>	<b>1,870,693,503</b>	<b>1,891,531,633</b>	<b>1,904,312,848</b>	<b>1,902,480,226</b>	<b>1,937,780,809</b>
元本	2,817,315,128	2,811,934,723	2,801,553,019	2,792,196,237	2,783,268,454	2,781,758,348
次期繰越損益金	△ 975,625,096	△ 941,241,220	△ 910,021,386	△ 887,883,389	△ 880,788,228	△ 843,977,539
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>2,817,315,128口</b>	<b>2,811,934,723口</b>	<b>2,801,553,019口</b>	<b>2,792,196,237口</b>	<b>2,783,268,454口</b>	<b>2,781,758,348口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	6,537円	6,653円	6,752円	6,820円	6,835円	6,966円

(注) 第312期首元本額2,826,221,353円、第312～317期中追加設定元本額4,175,243円、第312～317期中一部解約元本額48,638,248円。第317期末現在における1口当たり純資産額0.6966円。

(注) 第317期末現在において純資産総額が元本を下回っており、その差額は△843,977,539円です。

○損益の状況

項 目	第312期	第313期	第314期	第315期	第316期	第317期
	2023年11月28日～ 2023年12月25日	2023年12月26日～ 2024年1月25日	2024年1月26日～ 2024年2月26日	2024年2月27日～ 2024年3月25日	2024年3月26日～ 2024年4月25日	2024年4月26日～ 2024年5月27日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	4,347,216	4,884,602	5,417,524	5,020,566	5,677,617	5,971,601
受取利息	4,059,477	4,637,586	5,143,670	4,724,532	5,398,066	5,660,962
その他収益金	289,986	249,651	276,763	297,362	279,551	310,639
支払利息	△ 2,247	△ 2,635	△ 2,909	△ 1,328	—	—
(B) 有価証券売買損益	△ 3,919,584	29,642,254	25,225,839	17,770,401	△ 620,497	35,156,392
売買益	89,155,916	77,515,328	46,052,046	53,826,782	52,199,919	63,162,538
売買損	△ 93,075,500	△ 47,873,074	△ 20,826,207	△ 36,056,381	△ 52,820,416	△ 28,006,146
(C) 先物取引等取引損益	△ 1,821,084	2,246,498	866,056	△ 194,004	2,946,653	△ 876,756
取引益	5,679,784	6,146,292	4,670,617	4,970,839	10,054,558	5,700,397
取引損	△ 7,500,868	△ 3,899,794	△ 3,804,561	△ 5,164,843	△ 7,107,905	△ 6,577,153
(D) 信託報酬等	△ 2,542,497	△ 3,409,083	△ 2,924,348	△ 2,660,787	△ 2,912,576	△ 3,083,880
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 3,935,949	33,364,271	28,585,071	19,936,176	5,091,197	37,167,357
(F) 前期繰越損益金	△ 71,028,894	△ 75,629,440	△ 42,940,940	△ 15,142,567	3,942,466	8,192,622
(G) 追加信託差損益金	△899,815,059	△898,132,471	△894,825,052	△891,839,340	△888,986,911	△888,502,991
(配当等相当額)	( 3,667,723)	( 3,700,191)	( 3,703,961)	( 3,709,561)	( 3,717,604)	( 3,734,544)
(売買損益相当額)	(△903,482,782)	(△901,832,662)	(△898,529,013)	(△895,548,901)	(△892,704,515)	(△892,237,535)
(H) 計(E+F+G)	△974,779,902	△940,397,640	△909,180,921	△887,045,731	△879,953,248	△843,143,012
(I) 収益分配金	△ 845,194	△ 843,580	△ 840,465	△ 837,658	△ 834,980	△ 834,527
次期繰越損益金(H+I)	△975,625,096	△941,241,220	△910,021,386	△887,883,389	△880,788,228	△843,977,539
追加信託差損益金	△899,815,059	△898,132,471	△894,825,052	△891,839,340	△888,986,911	△888,502,991
(配当等相当額)	( 3,667,723)	( 3,700,191)	( 3,703,961)	( 3,709,561)	( 3,717,604)	( 3,734,544)
(売買損益相当額)	(△903,482,782)	(△901,832,662)	(△898,529,013)	(△895,548,901)	(△892,704,515)	(△892,237,535)
分配準備積立金	83,540,260	86,929,542	90,665,517	93,936,406	96,392,610	101,000,780
繰越損益金	△159,350,297	△130,038,291	△105,861,851	△ 89,980,455	△ 88,193,927	△ 56,475,328

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は、売買による損益のほか、各期末における評価損益、外国為替の売買および期末評価換えによる損益を含んでおります。

(注) (D)信託報酬等には信託報酬、監査報酬などの諸費用とそれらに対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (G)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) 分配金計算過程は以下のとおりです。

\* 第312期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (1,804,719円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 (0円)、収益調整金額 (3,667,723円) および分配準備積立金額 (82,580,735円) より分配対象収益額は88,053,177円 (10,000口当たり312円) であり、うち845,194円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

\* 第313期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (4,431,876円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 (0円)、収益調整金額 (3,700,191円) および分配準備積立金額 (83,341,246円) より分配対象収益額は91,473,313円 (10,000口当たり325円) であり、うち843,580円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

\* 第314期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (4,914,829円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 (0円)、収益調整金額 (3,703,961円) および分配準備積立金額 (86,591,153円) より分配対象収益額は95,209,943円 (10,000口当たり339円) であり、うち840,465円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

\* 第315期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (4,429,339円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 (0円)、収益調整金額 (3,709,561円) および分配準備積立金額 (90,344,725円) より分配対象収益額は98,483,625円 (10,000口当たり352円) であり、うち837,658円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

\* 第316期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (3,611,436円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 (0円)、収益調整金額 (3,717,604円) および分配準備積立金額 (93,616,154円) より分配対象収益額は100,945,194円 (10,000口当たり362円) であり、うち834,980円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

\* 第317期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (5,513,953円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 (0円)、収益調整金額 (3,734,544円) および分配準備積立金額 (96,321,354円) より分配対象収益額は105,569,851円 (10,000口当たり379円) であり、うち834,527円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。



## ○分配金のお知らせ

	第312期	第313期	第314期	第315期	第316期	第317期
1万口当たり分配金（税込み）	3円	3円	3円	3円	3円	3円

◆分配金の内訳、税金の取扱いは、以下のとおりです。（各決算期ごとに計算されます。）

### ◇課税上の取扱い

#### ①分配金の課税について

- ・分配金は「普通分配金」と「元本払戻金（特別分配金）」に区分され、普通分配金に課税されます。
- ・分配落ち後の基準価額が受益者の個別元本と同額または受益者の個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が受益者の個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。ただし分配落ち後の基準価額が受益者の個別元本を下回り、かつ分配金と分配落ち後の基準価額を加えたものが受益者の個別元本と同額か下回る場合には、分配金の全額が元本払戻金（特別分配金）となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、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。

#### ②個人の課税上の取扱い

- ・元本払戻金（特別分配金）：元本払戻金（特別分配金）は、お客様の取得元本の一部の払い戻しに当たるため、課税されません。
- ・普通分配金：個人の受益者の源泉徴収時には、配当所得として以下のように課税されます。  
20.315%（所得税15.315%、地方税5%）  
※法人の場合は上記とは異なります。

※税法が改正された場合等には上記の内容が変更されることがあります。詳しくは販売会社へお問い合わせください。

※外国税額控除の適用となった場合には、普通分配金から源泉徴収される税額が上記と異なる場合があります。

※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご相談されることをお勧めします。

## ○お知らせ

2023年11月28日以降において、当ファンドの信託約款について、以下に掲げる事項を内容とする変更を行いました。

受益者に対して行う公告の方法を電子公告に変更したため、所要の変更を行いました。

（変更日：2024年3月1日）