



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318期(決算日2024年6月25日) 第319期(決算日2024年7月25日) 第320期(決算日2024年8月26日)
第321期(決算日2024年9月25日) 第322期(決算日2024年10月25日) 第323期(決算日2024年11月25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323期の決算を行いました。

ここに、第318期から第323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 (分配落)	価 額			参 考	指 数		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金 騰 落	期 中 率		期 中 騰 落	中 率			
	円	円	%		%	%	%	%	百万円	
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	
318期(2024年6月25日)	7,115	3	2.2	521.359	2.4	109.3	△9.7		1,954	
319期(2024年7月25日)	6,896	3	△3.0	505.288	△3.1	112.9	△17.9		1,885	
320期(2024年8月26日)	6,711	3	△2.6	498.172	△1.4	112.2	△20.0		1,833	
321期(2024年9月25日)	6,761	5	0.8	499.138	0.2	112.3	1.0		1,845	
322期(2024年10月25日)	6,924	5	2.5	511.451	2.5	113.1	△2.3		1,885	
323期(2024年11月25日)	6,896	5	△0.3	512.277	0.2	112.9	△1.3		1,863	

(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	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		円	騰 落 率			
第318期	(期 首) 2024年 5月27日	6,966	—	509.054	109.9	△ 6.9
	5月末	6,929	△0.5	506.325	110.7	△ 7.0
	(期 末) 2024年 6月25日	7,118	2.2	521.359	109.3	△ 9.7
第319期	(期 首) 2024年 6月25日	7,115	—	521.359	109.3	△ 9.7
	6月末	7,144	0.4	522.133	109.4	△ 9.7
	(期 末) 2024年 7月25日	6,899	△3.0	505.288	112.9	△17.9
第320期	(期 首) 2024年 7月25日	6,896	—	505.288	112.9	△17.9
	7月末	6,896	0.0	512.137	112.5	△21.4
	(期 末) 2024年 8月26日	6,714	△2.6	498.172	112.2	△20.0
第321期	(期 首) 2024年 8月26日	6,711	—	498.172	112.2	△20.0
	8月末	6,730	0.3	496.706	112.0	△10.8
	(期 末) 2024年 9月25日	6,766	0.8	499.138	112.3	1.0
第322期	(期 首) 2024年 9月25日	6,761	—	499.138	112.3	1.0
	9月末	6,729	△0.5	496.855	111.2	△ 1.0
	(期 末) 2024年10月25日	6,929	2.5	511.451	113.1	△ 2.3
第323期	(期 首) 2024年10月25日	6,924	—	511.451	113.1	△ 2.3
	10月末	6,952	0.4	514.061	113.2	△ 1.4
	(期 末) 2024年11月25日	6,901	△0.3	512.277	112.9	△ 1.3

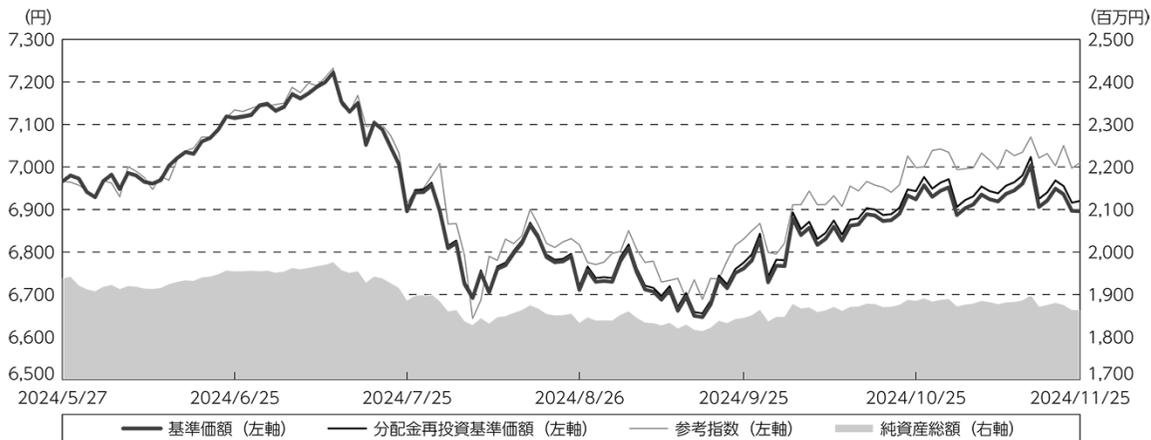
(注) 各期末基準価額は分配金込み、各騰落率は期首比です。
(注) 債券組入比率には、新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。
(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。
(注) 月末は、各月の最終営業日です。

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

(2024年5月28日～2024年11月25日)



第318期首：6,966円

第323期末：6,896円 (既払分配金(税込み)：24円)

騰落率：△ 0.7% (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。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(2024年5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、前作成期末比で下落しました。

○基準価額の主な変動要因

上昇要因

- ・保有債券の利息収入
- ・保有している債券の価格上昇

下落要因

- ・円高米ドル安および円高ユーロ安

投資環境

(2024年5月28日～2024年11月25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比で上昇しました。投資適格社債の価格は上昇しました。また、為替市場では円高米ドル安、円高ユーロ安となりました。

【債券市場】

米国国債金利は前作成期末比で低下(価格は上昇)しました。

2024年9月半ばにかけては、利下げ観測が高まったことを受けて金利は低下しました。その後、米連邦準備理事会(FRB)が0.5%の大幅利下げを決定したものの、今後の利下げペースは緩やかとの示唆がなされたことから金利は上昇(価格は下落)に転じました。当作成期末にかけても、景気の底堅さを背景に利下げペースが鈍化するとの見方が強まったほか、米国大統領選挙でトランプ氏が勝利したことで、インフレの再燃や財政赤字の拡大を招く可能性が意識され、金利の上昇基調が続きました。

ドイツ国債金利は前作成期末比で低下しました。

2024年9月にかけては、欧州中央銀行(ECB)による追加利下げ期待が高まったことから、金利は低下基調で推移しました。欧州政治への警戒感も低下の要因となりました。10月は、米国国債金利につられる形で上昇しましたが、11月にはECBによる12月の利下げ観測が台頭し、低下基調となりました。

投資適格社債市場は前作成期末比で上昇しました。

2024年9月中旬にかけては、米国国債金利の低下や堅調な株式市場が後押しし上昇しました。その後当作成期末にかけては、好調な経済指標を受けて米国の積極的な利下げ観測が後退したことなどから、やや軟調に推移しました。

【為替市場】

米ドル円は、前作成期末比で円高米ドル安となりました。当作成期初から2024年7月上旬にかけては、日本銀行(日銀)が緩和的な金融環境維持を示したことを背景に、おおむね円安米ドル高基調で推移しました。その後9月中旬にかけては、日銀が追加利上げを決定した一方で、FRBが利下げに踏み切るとの観測が高まったことから、急速に円高米ドル安が進行しました。しかしFRBの利下げ決定後は、米国長期金利が上昇に転じたことから円安米ドル高に転じました。ユーロ円は、前作成期末比で円高ユーロ安となりました。

運用概況

(2024年5月28日～2024年11月25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・政府機関債やモーゲージ証券の組入れは上昇した一方、社債券等の組入れは低下しました。

< 公社債のセクター別組入比率 >

前作成期末(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%



当作成期末(2024年11月25日現在)

セクター	比率
国債・政府機関債	60.8%
社債券等	28.5%
モーゲージ証券	23.5%
現金等	-12.9%

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

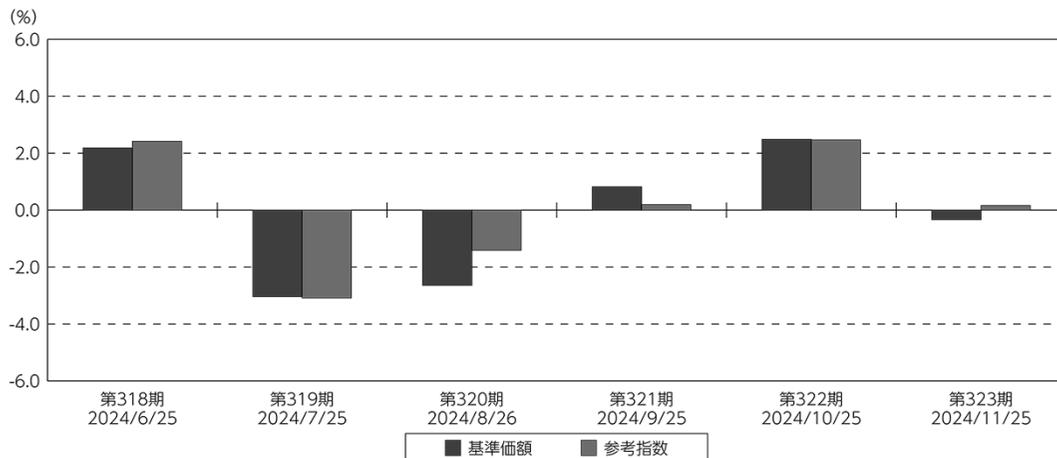
(注) 小数第2位を四捨五入。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2024年5月28日～2024年11月25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

(2024年5月28日～2024年11月25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：24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、1万口当たり、税込み)

項 目	第318期	第319期	第320期	第321期	第322期	第323期
	2024年5月28日～ 2024年6月25日	2024年6月26日～ 2024年7月25日	2024年7月26日～ 2024年8月26日	2024年8月27日～ 2024年9月25日	2024年9月26日～ 2024年10月25日	2024年10月26日～ 2024年11月25日
当期分配金	3	3	3	5	5	5
(対基準価額比率)	0.042%	0.043%	0.045%	0.074%	0.072%	0.072%
当期の収益	3	3	3	5	5	5
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	392	398	405	416	430	435

(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、プラス成長を予想しています。予想以上に底堅く推移しているものの、中国の過剰生産の影響で回復ペースにはやや遅れが生じています。各国の中央銀行による利下げ効果が顕在化する2025年以降の回復基調が期待されます。一方、弱含みの中国経済などから影響を受ける国やセクターへの向かい風が懸念されます。

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

(2024年5月28日～2024年11月25日)

項 目	第318期～第323期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬	59	0.850	(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)	(0.411)	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)	(0.411)	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	0.003	(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)	(0.003)	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	5	0.075	(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 ）	(4)	(0.056)	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 ）	(1)	(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 ）	(1)	(0.011)	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	64	0.928	
作成期間中の平均基準価額は、6,896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。

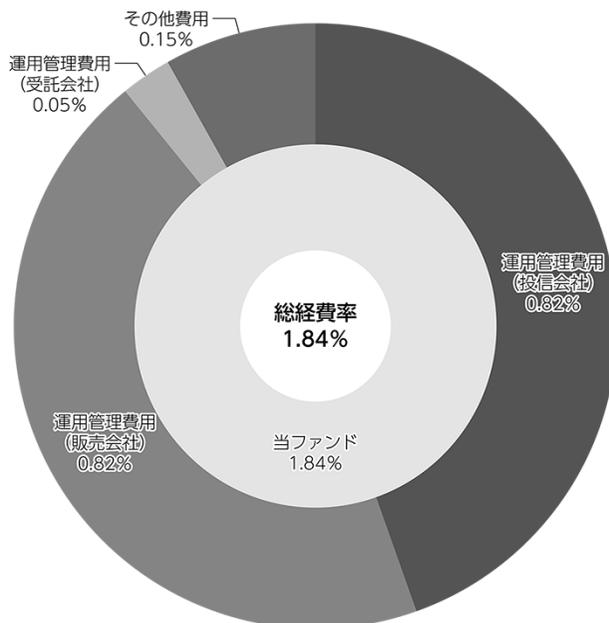
(注) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。ただし、平均基準価額は円未満切り捨て。

(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1.84%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。

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318期～第323期	
			買付額	売付額
外	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 427
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 234	千オーストラリアドル 241
		地方債証券	54	255
		特殊債券	—	299
社債券		197	—	
国	中国	国債証券	千中国元 2,640	千中国元 —
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリングギット 271	千マレーシアリングギット —
	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 1,987,371

- (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318期～第323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 173	百万円 115
外国	債券先物取引	882	743	1,095	1,098

- (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。

先物為替先渡取引状況

種 類 別		第318期～第323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)	47	37	42	37
	(コロンビアペソ)	106	117	119	117
	(インドネシアルピア)	71	95	63	95
	(インドルピー)	51	56	66	56
	(韓国ウォン)	40	55	60	55
	(マレーシアリングギット)	16	23	25	23
	(ペルーソル)	53	59	48	59
	(新台幣ドル)	4	4	4	4

- (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

(2024年5月28日～2024年11月25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11月25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323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	110,100	96,957	5.2	—	5.2	—	—	
合 計	110,100	96,957	5.2	—	5.2	—	—	

(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323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4回利付国債(40年)	2.2	12,300	12,382	2051/3/20
第16回利付国債(40年)	1.3	14,400	10,209	2063/3/20
第62回利付国債(30年)	0.5	8,100	5,663	2049/3/20
第68回利付国債(30年)	0.6	2,250	1,563	2050/9/20
第82回利付国債(30年)	1.8	41,850	37,887	2054/3/20
第159回利付国債(20年)	0.6	10,950	10,118	2036/12/20
第183回利付国債(20年)	1.4	20,250	19,132	2042/12/20
合 計		110,100	96,957	

(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323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 7,829	千米ドル 7,256	千円 1,119,257	% 60.1	% 0.8	% 35.5	% 21.0	% 3.6
カナダ	千カナダドル 1,067	千カナダドル 851	94,309	5.1	0.2	4.9	0.2	—
メキシコ	千メキシコペソ 472	千メキシコペソ 371	2,815	0.2	—	0.2	—	—
コロンビア	千コロンビアペソ 618,800	千コロンビアペソ 639,725	22,332	1.2	—	1.2	—	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	128	128	20,708	1.1	—	1.1	—	—
イタリア	225	233	37,703	2.0	—	2.0	—	—
フランス	866	864	139,841	7.5	—	5.9	1.6	—
オランダ	100	104	16,893	0.9	—	—	0.9	—
スペイン	111	118	19,176	1.0	—	1.0	—	—
ベルギー	46	51	8,280	0.4	—	0.4	—	—
オーストリア	179	154	24,982	1.3	—	1.3	—	—
フィンランド	141	141	22,900	1.2	—	1.2	—	—
その他	1,462	1,473	238,253	12.8	—	5.7	5.3	1.7
イギリス	千英ポンド 534	千英ポンド 462	89,966	4.8	—	4.8	—	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 360	千スウェーデンクローナ 502	7,069	0.4	—	—	0.4	—
オーストラリア	千オーストラリアドル 411	千オーストラリアドル 361	36,536	2.0	—	0.7	0.9	0.3
中国	千中国元 3,790	千中国元 3,891	82,875	4.4	—	3.0	1.4	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 260	千マレーシアリンギット 269	9,323	0.5	—	0.3	0.2	—
インドネシア	千インドネシアルピア 1,364,000	千インドネシアルピア 1,367,797	13,404	0.7	—	—	0.7	—
合 計	—	—	2,006,632	107.7	1.0	69.4	32.7	5.6

(注) 邦貨換算金額は、第323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	第323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		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券	US TREASURY	3.75	286	283	43,746	2026/8/31
		US TREASURY	0.5	163	147	22,729	2027/8/31
		US TREASURY	2.875	180	171	26,480	2028/5/15
		US TREASURY	3.625	213	208	32,146	2028/5/31
		US TREASURY	1.125	289	257	39,770	2028/8/31
		US TREASURY	4.0	344	339	52,430	2029/1/31
		US TREASURY	3.5	592	571	88,193	2029/9/30
		US TREASURY	4.125	72	71	11,036	2029/10/31
		US TREASURY	4.375	106	106	16,407	2034/5/15
		US TREASURY	1.125	637	388	59,950	2040/8/15
		US TREASURY	1.75	23	15	2,408	2041/8/15
		US TREASURY	3.0	88	68	10,536	2045/11/15
		US TREASURY	2.0	128	76	11,725	2051/8/15
		US TREASURY	4.125	22	20	3,221	2053/8/15
		US TSY INFL IX N/B	1.375	150	148	22,892	2033/7/15
地方債証券	CMWLTH FING AUTH PA	FL ST BRD ADMIN FIN-A	4.144	5	4	713	2038/6/1
		FLORIDA ST BRD OF ADM	5.526	11	11	1,714	2034/7/1
		NJ ECON-SER A	2.154	20	17	2,647	2030/7/1
		NJ ST TRANSN-BAB-C	7.425	14	14	2,286	2029/2/15
			5.754	10	10	1,568	2028/12/15
特殊債券 (除く金融債)	GNMAII 30 YR MA 8428	GNMAII30YR TBA 2.5 DEC24	5.0	64	63	9,744	2052/11/20
		GNMAII30YR TBA 3.0 DEC24	2.5	159	134	20,741	2054/12/1
		GNMAII30YR TBA 4.0 DEC24	3.0	140	122	18,895	2054/12/1
		GNMAII30YR TBA 4.5 DEC24	4.0	35	33	5,111	2054/12/1
		GNMAII30YR TBA 5.0 DEC24	4.5	451	429	66,279	2054/12/1
		GNMAII30YR TBA 5.5 DEC24	5.0	496	483	74,653	2054/12/1
		GNMAII30YR TBA 6.0 DEC24	5.5	540	537	82,903	2054/12/1
		UMBS 30YR TBA 2.0 DEC24	6.0	188	189	29,233	2054/12/1
		UMBS 30YR TBA 5.5 DEC24	2.0	149	117	18,154	2054/12/1
			5.5	62	61	9,465	2054/12/1
普通社債券	AFFRM 2024-B A	AHT1 2018-ASHF A	4.62	100	99	15,284	2029/9/15
		AMERICAN HONDA FINANCE	5.682	74	74	11,427	2035/4/15
		AMGEN INC	5.05	33	32	5,079	2031/7/10
		ATHENE GLOBAL FUNDING	5.15	32	32	4,984	2028/3/2
		ATHENE GLOBAL FUNDING	5.960199	14	13	2,156	2026/5/8
		AVIATION CAPITAL GROUP	5.526	29	29	4,534	2031/7/11
		AVIATION CAPITAL GROUP	4.125	16	15	2,449	2025/8/1
		AVIATION CAPITAL GROUP	1.95	10	9	1,484	2026/1/30
		AVIATION CAPITAL GROUP	1.95	14	13	2,037	2026/9/20
		BANK OF AMERICA CORP	3.559	60	58	9,082	2027/4/23
		BANK OF AMERICA CORP	3.846	23	20	3,171	2037/3/8
		BOEING CO	3.25	8	7	1,157	2028/2/1
		BOEING CO	6.298	6	6	956	2029/5/1

アラリアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

銘柄	銘柄	第323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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	普通社債券					
	BOEING CO	5.15	17	16	2,584	2030/5/1
	BOEING CO	3.625	7	6	971	2031/2/1
	BROADCOM INC	4.15	10	9	1,510	2028/2/15
	BROADRIDGE FINANCIAL SOL	2.6	40	34	5,293	2031/5/1
	BVABS 2023-CAR3 A2	6.291	10	10	1,671	2032/7/26
	BX 2019-IMC A	5.6553	47	46	7,196	2034/4/15
	CAS 2016-C01 1M2	11.7213	4	4	738	2028/8/25
	CAS 2016-C01 2M2	11.9213	3	3	548	2028/8/25
	CAS 2016-C02 1M2	10.9713	7	8	1,242	2028/9/25
	CAS 2021-R01 1M2	6.40682	8	8	1,364	2041/10/25
	CAS 2021-R03 1M1	5.70682	24	24	3,817	2041/12/25
	CAS 2021-R03 1M2	6.50682	100	100	15,540	2041/12/25
	CAS 2022-R01 1M2	6.75682	100	101	15,627	2041/12/25
	CAS 2022-R07 1M1	7.80682	8	9	1,410	2042/6/25
	CAS 2023-R02 1M1	7.15682	37	38	5,895	2043/1/25
	CAS 2024-R06 1M1	5.90682	14	14	2,192	2044/9/25
	CBS CORP	5.5	20	18	2,922	2033/5/15
	CODELCO INC	5.625	35	34	5,309	2035/9/21
	COMMONSPIRIT HEALTH	5.318	32	31	4,928	2034/12/1
	CONTINENTAL RESOURCES	5.75	8	7	1,232	2031/1/15
	CONTINENTAL RESOURCES	2.875	35	28	4,471	2032/4/1
	COX COMMUNICATIONS INC	5.45	7	7	1,095	2028/9/15
	COX COMMUNICATIONS INC	1.8	37	30	4,701	2030/10/1
	COX COMMUNICATIONS INC	5.7	5	4	770	2033/6/15
	CVS HEALTH CORP	1.75	14	11	1,776	2030/8/21
	CVS HEALTH CORP	5.7	25	25	3,865	2034/6/1
	DELL INT LLC / EMC CORP	8.1	32	38	5,902	2036/7/15
	DEVON ENERGY CORP	7.95	18	20	3,152	2032/4/15
	DLAA 2023-1A A2	5.93	7	7	1,106	2026/7/20
	ERAC USA FINANCE LLC	4.9	24	23	3,636	2033/5/1
	FISERV INC	5.625	37	37	5,838	2033/8/21
	GENERAL MOTORS FINL CO	2.4	42	38	5,869	2028/10/15
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	6.158177	26	25	4,009	2026/12/9
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	1.542	47	44	6,823	2027/9/10
	GRUPO TELEVISIA SAB	8.5	22	24	3,758	2032/3/11
	GWT 2024-WOLF A	6.15129	23	23	3,551	2039/3/15
	HARLEY-DAVIDSON FINL SER	3.35	3	2	457	2025/6/8
	HARLEY-DAVIDSON FINL SER	3.05	17	16	2,477	2027/2/14
	HARLEY-DAVIDSON FINL SER	5.95	17	17	2,629	2029/6/11
	HASBRO INC	3.55	27	26	4,059	2026/11/19
	HASBRO INC	6.05	11	11	1,719	2034/5/14
	HINTT 2024-A A	5.49	39	40	6,185	2043/3/15
	HSBC HOLDINGS PLC	4.755	207	205	31,661	2028/6/9
	HYUNDAI CAPITAL AMERICA	1.8	20	18	2,796	2028/1/10

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323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		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	普通社債券	HYUNDAI CAPITAL AMERICA	2.1	26	23	3,593	2028/9/15
		INTEL CORP	1.6	10	8	1,360	2028/8/12
		INTERPUBLIC GROUP COS	5.375	15	14	2,297	2033/6/15
		KYNDRYL HOLDINGS INC	2.05	26	24	3,793	2026/10/15
		LADAR 2023-2A A2	5.93	4	4	685	2027/6/15
		MDC HOLDINGS INC	6.0	20	20	3,127	2043/1/15
		NEW YORK LIFE GLOBAL FDG	5.8482	21	21	3,240	2026/6/9
		NIAGARA MOHAWK POWER	4.278	19	18	2,841	2028/12/15
		NIAGARA MOHAWK POWER	5.29	19	18	2,889	2034/1/17
		ONEOK INC	4.4	8	7	1,199	2029/10/15
		PULTE GROUP INC	7.875	33	38	5,870	2032/6/15
		ROSS STORES INC	1.875	35	28	4,463	2031/4/15
		RYDER SYSTEM INC	6.6	36	38	6,014	2033/12/1
		SANTANDER HOLDINGS USA	6.174	8	8	1,262	2030/1/9
		SBALT 2023-A A2	6.27	11	11	1,765	2026/4/20
		STACR 2021-DNA5 M2	6.50682	6	6	1,053	2034/1/25
		STACR 2021-HQA4 M1	5.80682	33	33	5,232	2041/12/25
		STACR 2022-DNA1 M1A	5.85682	6	6	1,020	2042/1/25
		STACR 2024-DNA3 M1	6.02688	10	10	1,550	2044/10/25
		SUTTER HEALTH	5.164	9	9	1,391	2033/8/15
		THOMSON REUTERS CORP	5.5	16	16	2,496	2035/8/15
		WARNERMEDIA HOLDINGS INC	4.279	14	12	1,918	2032/3/15
		WARNERMEDIA HOLDINGS INC	5.141	16	12	1,915	2052/3/15
		XCAP 2023-1A A2	6.18	79	80	12,358	2028/12/15
小	計					1,119,257	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT I/L	4.0	20	41	4,548	2031/12/1
	地方債証券	CALGARY (CITY OF)	4.2	8	8	888	2034/6/1
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	7	878	2036/12/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	7	857	2037/6/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	7	828	2037/12/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	7	812	2038/6/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	7	792	2038/12/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	6	773	2039/6/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	6	740	2040/6/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	6	720	2040/12/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	6	708	2041/6/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	6	691	2041/12/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	6	675	2042/6/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	5	643	2043/6/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	5	576	2045/12/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	5	566	2046/6/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	103	39	4,321	2046/12/2
		ONTARIO PROV GEN STRIP	—	13	4	544	2047/6/2

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323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		
地方債証券	PROVINCE OF ONTARIO	3.5	49	43	4,841	2043/6/2	
	PROVINCE OF ONTARIO	3.45	50	43	4,856	2045/6/2	
	PROVINCE OF ONTARIO	2.9	86	68	7,570	2046/12/2	
	PROVINCE OF ONTARIO	4.6	26	27	3,029	2055/12/2	
	QHEL GENERIC STRIP	—	13	7	797	2038/8/15	
	QHEL GENERIC STRIP	—	13	6	695	2041/8/15	
	QHEL GENERIC STRIP	—	13	6	678	2042/2/15	
	QHEL GENERIC STRIP	—	13	5	663	2042/8/15	
	QHEL GENERIC STRIP	—	13	5	650	2043/2/15	
	QHEL GENERIC STRIP	—	13	5	621	2044/2/15	
	QHEL GENERIC STRIP	—	13	5	608	2044/8/15	
	QHEL GENERIC STRIP	—	13	5	569	2046/2/15	
	特殊債券 (除く金融債)	CANADA HOUSING TRUST	4.25	25	25	2,864	2034/3/15
	普通社債券	AIR LEASE CORP	5.4	22	22	2,517	2028/6/1
ALTALINK LP		3.99	11	10	1,114	2042/6/30	
BELL CANADA		4.55	3	3	334	2030/2/9	
BELL CANADA		3.0	5	4	509	2031/3/17	
BELL CANADA		5.85	21	22	2,490	2032/11/10	
BELL CANADA		5.15	44	42	4,691	2053/2/9	
CU INC		5.183	35	36	4,058	2035/11/21	
ELECTRICITE DE FRANCE SA		5.993	27	28	3,161	2030/5/23	
ENBRIDGE INC		6.1	47	51	5,723	2032/11/9	
ENBRIDGE PIPELINES INC		2.82	14	12	1,418	2031/5/12	
GENERAL MOTORS FINL CO		5.1	3	3	340	2028/7/14	
LOBLAW COMPANIES LIMITED		6.54	46	51	5,658	2033/2/17	
METRO INC		4.657	37	37	4,148	2033/2/7	
TELUS CORP		3.15	30	28	3,137	2030/2/19	
TELUS CORP	5.25	26	26	2,971	2032/11/15		
TRANSCANADA PIPELINES	5.33	26	27	3,017	2032/5/12		
小計					94,309		
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ			
国債証券	MEXICAN BONOS	8.0	472	371	2,815	2053/7/31	
小計					2,815		
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	541,395	18,899	2033/2/9	
REPUBLIC OF COLOMBIA	6.25	32,100	22,563	787	2036/7/9		
REPUBLIC OF COLOMBIA	7.25	114,400	75,766	2,644	2050/10/26		
小計					22,332		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.2	106	106	17,231	2034/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	21	21	3,477	2054/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	96	98	15,930	2031/2/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2	69	73	11,899	2034/3/1

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		銘柄	第323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	
			千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ							
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.05	43	44	7,250	2037/10/30
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	17	16	2,622	2038/3/1
フランス	国債証券	FRENCH TREASURY	2.75	274	276	44,644	2030/2/25
		FRENCH TREASURY	3.5	98	102	16,541	2033/11/25
		FRENCH TREASURY	3.0	185	184	29,783	2034/11/25
		FRENCH TREASURY	2.5	8	7	1,217	2043/5/25
	普通社債券	CIE FINANCEMENT FONCIER	0.01	100	92	15,032	2027/10/25
		SNCF RESEAU	0.875	100	92	14,939	2029/1/22
		SUEZ	5.0	100	109	17,681	2032/11/3
オランダ	普通社債券	ING GROEP NV	4.5	100	104	16,893	2029/5/23
スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	3.9	111	118	19,176	2039/7/30
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	2.85	13	13	2,247	2034/10/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	33	37	6,032	2041/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	—	39	34	5,570	2030/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	140	120	19,412	2031/2/20
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	2.5	141	141	22,900	2030/4/15
その他	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT	4.0	29	29	4,754	2029/7/25
		POLAND GOVERNMENT	3.125	8	7	1,291	2031/10/22
		POLAND GOVERNMENT	2.75	33	31	5,149	2032/5/25
		REPUBLIC OF INDONESIA	1.0	100	89	14,500	2029/7/28
		ROMANIA	5.125	29	28	4,648	2031/9/24
	地方債証券	JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	0.01	100	92	14,944	2028/2/2
	特殊債券 (除く金融債)	DEVELOPMENT BK OF JAPAN	3.125	100	102	16,503	2028/4/13
	EUROPEAN UNION	3.375	63	63	10,325	2054/10/5	
	普通社債券	BOOKING HOLDINGS INC	4.75	100	110	17,905	2034/11/15
		CITIGROUP INC	4.112	100	104	16,955	2033/9/22
		CREDIT SUISSE AG LONDON	0.25	100	97	15,727	2026/1/5
JPMORGAN CHASE & CO		4.457	100	107	17,347	2031/11/13	
KOOKMIN BANK		2.75	100	100	16,243	2028/1/21	
MOLSON COORS BEVERAGE		3.8	100	102	16,564	2032/6/15	
MORGAN STANLEY		4.656	100	105	17,007	2029/3/2	
SUMITOMO MITSUI TR BK LT	3.629	100	101	16,386	2026/4/6		
TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	3.386	100	101	16,360	2030/3/18		
WESTPAC BANKING CORP	1.079	100	96	15,635	2027/4/5		
小計						528,740	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
国債証券	UK TREASURY	3.25	36	33	6,574	2033/1/31	
	UK TREASURY	4.25	81	80	15,645	2034/7/31	
	UK TREASURY	3.75	10	10	1,952	2038/1/29	
	UK TREASURY	4.375	11	10	2,132	2040/1/31	
	UK TREASURY	1.25	28	17	3,327	2041/10/22	
	UK TREASURY	4.75	131	130	25,426	2043/10/22	
	UK TREASURY	0.875	91	43	8,536	2046/1/31	
	UK TREASURY	1.25	11	5	1,064	2051/7/31	

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323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		
イギリス		%	千英ポンド	千英ポンド	千円		
	国債証券	UK TREASURY	4.375	61	57	11,089	2054/7/31
	普通社債券	ANGLIAN WATER SERV FIN	6.293	20	20	3,948	2030/7/30
		HEATHROW FUNDING LTD	6.45	50	52	10,268	2031/12/10
小	計					89,966	
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	0.160346	285	366	5,154	2027/12/1
		SWEDISH GOVERNMENT I/L	5.57445	75	136	1,914	2028/12/1
小	計					7,069	
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	TREASURY CORP VICTORIA	2.25	68	53	5,451	2033/9/15
		TREASURY CORP VICTORIA	2.25	73	55	5,621	2034/11/20
		TREASURY CORP VICTORIA	2.0	40	26	2,701	2037/11/20
	普通社債券	AT&T INC	4.1	60	59	6,000	2026/1/19
		LLOYDS BANKING GROUP PLC	4.25	40	38	3,932	2027/11/22
		MET LIFE GLOB FUNDING I	4.0	100	97	9,871	2027/7/13
		VODAFONE GROUP PLC	4.2	30	29	2,958	2027/12/13
小	計					36,536	
中国				千中国元	千中国元		
	国債証券	CHINA GOVERNMENT	3.01	1,200	1,257	26,786	2028/5/13
		CHINA GOVERNMENT	2.28	1,320	1,348	28,709	2031/3/25
		CHINA GOVERNMENT	2.12	1,270	1,285	27,380	2031/6/25
小	計					82,875	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.885	121	122	4,228	2029/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.642	139	147	5,095	2033/11/7
小	計					9,323	
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	1,364,000	1,367,797	13,404	2029/4/15
小	計					13,404	
合	計					2,006,632	

(注) 邦貨換算金額は、第323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323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 114
	債券先物取引	10 ULTRA FUT	—	69
外国		2YR T-NOTES	95	—
		30YR T-BOND	—	17
		5YR T-NOTES	16	—
		SFE 3YR TBON	—	10
		CAN5YR BOND	99	—
		CAN10YR BOND	—	26
		EUR-BOBL	77	—
		EUR-BUND	—	64
		EUR-SCHATZ	—	34
		10YR KTB	25	—

(注) 邦貨換算金額は、第323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323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)	66	10	28	4
	(コロンビアペソ)	26	4	173	26
	(インドネシアルピア)	93	14	67	10
	(インドルピー)	155	23	124	19
	(韓国ウォン)	127	19	91	14
	(マレーシアリングット)	—	—	14	2
	(ペルーソル)	30	4	23	3

(注) 邦貨換算金額は、第323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11月25日現在)

項 目	第323期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 2,103,589	% 95.4
コール・ローン等、その他	101,476	4.6
投資信託財産総額	2,205,065	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注) 第323期末における外貨建純資産 (1,739,763千円) の投資信託財産総額 (2,205,065千円) に対する比率は78.9%です。

(注) 外貨建資産は、第323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=154.25円、1カナダドル=110.73円、1メキシコペソ=7.585円、100コロンビアペソ=3.4909円、1ユーロ=161.73円、1英ポンド=194.36円、1スウェーデンクローナ=14.07円、1オーストラリアドル=100.99円、1中国元=21.2953円、1マレーシアリングgit=34.5734円、100インドネシアルピア=0.98円、100韓国ウォン=11.00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2024年5月28日から2024年11月25日までの間で直物為替先渡取引（以下「NDF」といいます。）126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318期末	第319期末	第320期末	第321期末	第322期末	第323期末
	2024年6月25日現在	2024年7月25日現在	2024年8月26日現在	2024年9月25日現在	2024年10月25日現在	2024年11月25日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	3,841,401,315	3,347,233,331	3,536,828,236	4,001,805,399	3,270,523,366	3,126,546,507
コール・ローン等	84,251,273	35,852,809	40,362,390	40,632,614	35,724,954	56,652,703
公社債(評価額)	2,135,317,733	2,128,274,325	2,056,243,482	2,071,225,177	2,131,421,907	2,103,589,581
未収入金	1,590,882,160	1,150,304,820	1,405,299,904	1,859,822,257	1,072,416,003	939,616,202
未收利息	14,724,812	14,981,522	12,587,610	13,194,726	14,788,101	14,721,757
前払費用	2,615,082	4,516,656	3,363,237	3,016,777	5,414,407	4,378,484
その他未収収益	507,543	740,734	989,481	1,242,664	1,476,176	1,713,846
差入委託証拠金	13,102,712	12,562,465	17,982,132	12,671,184	9,281,818	5,873,934
(B) 負債	1,886,887,500	1,461,802,071	1,703,557,258	2,156,628,779	1,385,455,197	1,263,033,356
未払金	1,882,699,998	1,458,222,966	1,699,928,544	2,152,672,966	1,381,456,950	1,257,834,961
未払収益分配金	824,124	820,215	819,520	1,364,512	1,361,211	1,351,061
未払解約金	731,734	—	—	—	—	1,100,869
未払信託報酬	2,609,749	2,736,240	2,785,034	2,568,651	2,614,386	2,723,060
その他未払費用	21,895	22,650	24,160	22,650	22,650	23,405
(C) 純資産総額(A-B)	1,954,513,815	1,885,431,260	1,833,270,978	1,845,176,620	1,885,068,169	1,863,513,151
元本	2,747,082,426	2,734,050,129	2,731,733,921	2,729,024,657	2,722,423,568	2,702,123,498
次期繰越損益金	△ 792,568,611	△ 848,618,869	△ 898,462,943	△ 883,848,037	△ 837,355,399	△ 838,610,347
(D) 受益権総口数	2,747,082,426口	2,734,050,129口	2,731,733,921口	2,729,024,657口	2,722,423,568口	2,702,123,498口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,115円	6,896円	6,711円	6,761円	6,924円	6,896円

(注) 第318期首元本額2,781,758,348円、第318～323期中追加設定元本額5,443,839円、第318～323期中一部解約元本額85,078,689円。第323期末現在における1口当たり純資産額0.6896円。

(注) 第323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△838,610,347円です。

○損益の状況

項 目	第318期	第319期	第320期	第321期	第322期	第323期
	2024年5月28日～ 2024年6月25日	2024年6月26日～ 2024年7月25日	2024年7月26日～ 2024年8月26日	2024年8月27日～ 2024年9月25日	2024年9月26日～ 2024年10月25日	2024年10月26日～ 2024年11月25日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	5,500,093	5,544,922	5,614,383	5,224,424	5,515,470	5,615,064
受取利息	5,183,110	5,242,577	5,303,204	4,935,337	5,243,679	5,355,217
その他収益金	316,983	302,345	311,179	289,087	271,791	259,847
(B) 有価証券売買損益	38,996,217	△ 62,361,163	△ 47,102,904	13,467,407	40,811,566	△ 10,090,199
売買益	72,175,018	44,810,434	64,988,747	37,566,972	113,703,500	38,743,702
売買損	△ 33,178,801	△ 107,171,597	△ 112,091,651	△ 24,099,565	△ 72,891,934	△ 48,833,901
(C) 先物取引等取引損益	150,733	774,435	△ 5,326,879	△ 740,072	2,209,564	1,257,796
取引益	6,513,929	5,861,379	4,691,291	5,733,401	9,610,094	5,332,332
取引損	△ 6,363,196	△ 5,086,944	△ 10,018,170	△ 6,473,473	△ 7,400,530	△ 4,074,536
(D) 信託報酬等	△ 2,935,050	△ 2,948,070	△ 2,928,025	△ 2,863,457	△ 2,837,248	△ 2,930,462
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	41,711,993	△ 58,989,876	△ 49,743,425	15,088,302	45,699,352	△ 6,147,801
(F) 前期繰越損益金	43,961,899	84,431,012	24,595,161	△ 25,936,719	△ 12,172,836	31,914,738
(G) 追加信託差損益金	△ 877,418,379	△ 873,239,790	△ 872,495,159	△ 871,635,108	△ 869,520,704	△ 863,026,223
(配当等相当額)	(3,707,264)	(3,709,591)	(3,727,419)	(3,745,613)	(3,833,914)	(3,843,128)
(売買損益相当額)	(△ 881,125,643)	(△ 876,949,381)	(△ 876,222,578)	(△ 882,483,525)	(△ 873,354,618)	(△ 866,869,351)
(H) 計(E+F+G)	△ 791,744,487	△ 847,798,654	△ 897,643,423	△ 882,483,525	△ 835,994,188	△ 837,259,286
(I) 収益分配金	△ 824,124	△ 820,215	△ 819,520	△ 1,364,512	△ 1,361,211	△ 1,351,061
次期繰越損益金(H+I)	△ 792,568,611	△ 848,618,869	△ 898,462,943	△ 883,848,037	△ 837,355,399	△ 838,610,347
追加信託差損益金	△ 877,418,379	△ 873,239,790	△ 872,495,159	△ 871,635,108	△ 869,520,704	△ 863,026,223
(配当等相当額)	(3,707,264)	(3,709,591)	(3,727,419)	(3,745,613)	(3,833,914)	(3,843,128)
(売買損益相当額)	(△ 881,125,643)	(△ 876,949,381)	(△ 876,222,578)	(△ 875,380,721)	(△ 873,354,618)	(△ 866,869,351)
分配準備積立金	104,036,796	105,299,984	107,056,650	109,955,224	113,426,193	113,876,145
繰越損益金	△ 19,187,028	△ 80,679,063	△ 133,024,434	△ 122,168,153	△ 81,260,888	△ 89,460,269

(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をいいます。

(注) 分配金計算過程は以下のとおりです。

* 第318期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (5,138,495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 (3,707,264円) および分配準備積立金額 (99,722,425円) より分配対象収益額は108,568,184円 (10,000口当たり395円) であり、うち824,124円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

* 第319期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (2,596,852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 (3,709,591円) および分配準備積立金額 (103,523,347円) より分配対象収益額は109,829,790円 (10,000口当たり401円) であり、うち820,215円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

* 第320期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (2,686,358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 (3,727,419円) および分配準備積立金額 (105,189,812円) より分配対象収益額は111,603,589円 (10,000口当たり408円) であり、うち819,520円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

* 第321期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (4,391,158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 (3,745,613円) および分配準備積立金額 (106,928,578円) より分配対象収益額は115,065,349円 (10,000口当たり421円) であり、うち1,364,512円 (10,000口当たり5円) を分配金額としております。

* 第322期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (5,193,159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 (3,833,914円) および分配準備積立金額 (109,594,245円) より分配対象収益額は118,621,318円 (10,000口当たり435円) であり、うち1,361,211円 (10,000口当たり5円) を分配金額としております。

* 第323期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (2,684,602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 (3,843,128円) および分配準備積立金額 (112,542,604円) より分配対象収益額は119,070,334円 (10,000口当たり440円) であり、うち1,351,061円 (10,000口当たり5円) を分配金額としております。

○分配金のお知らせ

	第318期	第319期	第320期	第321期	第322期	第323期
1 万口当たり分配金 (税込み)	3円	3円	3円	5円	5円	5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。