



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300期(決算日2022年12月26日) 第301期(決算日2023年1月25日) 第302期(決算日2023年2月27日)
第303期(決算日2023年3月27日) 第304期(決算日2023年4月25日) 第305期(決算日2023年5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305期の決算を行いました。

ここに、第300期から第305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 額
		税 分	込 配	み 金		期 騰	落 率			
	円	円	円	%		%	%	%	百万円	
276期(2020年12月25日)	5,931		3	0.3	409.574	0.3	102.6	△4.4	1,995	
277期(2021年1月25日)	5,929		3	0.0	409.349	△0.1	103.5	△1.2	1,989	
278期(2021年2月25日)	5,964		3	0.6	411.134	0.4	101.9	△8.8	1,984	
279期(2021年3月25日)	6,004		3	0.7	415.991	1.2	103.2	△22.6	1,992	
280期(2021年4月26日)	6,007		3	0.1	416.828	0.2	103.6	△24.8	1,978	
281期(2021年5月25日)	6,072		3	1.1	420.648	0.9	99.8	△18.4	1,985	
282期(2021年6月25日)	6,150		3	1.3	426.447	1.4	101.0	△12.1	2,000	
283期(2021年7月26日)	6,156		3	0.1	428.113	0.4	101.0	△12.4	1,993	
284期(2021年8月25日)	6,119		3	△0.6	425.795	△0.5	101.1	△17.5	1,968	
285期(2021年9月27日)	6,117		3	0.0	425.242	△0.1	99.3	△14.9	1,965	
286期(2021年10月25日)	6,204		3	1.5	431.726	1.5	100.4	△14.6	1,987	
287期(2021年11月25日)	6,201		3	0.0	432.965	0.3	99.1	△18.6	1,973	
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	

(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。

当運用報告書で使用している指数等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 騰 落 率	参 考 指 数 率 騰 落 率	債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率		
						円	%
第300期	(期 首) 2022年11月25日	6,211	—	440.986	—	101.9	△ 8.9
	11月末	6,166	△0.7	436.184	△1.1	101.6	△ 9.5
	(期 末) 2022年12月26日	5,935	△4.4	422.550	△4.2	101.4	△10.3
第301期	(期 首) 2022年12月26日	5,932	—	422.550	—	101.4	△10.3
	12月末	5,935	0.1	422.527	△0.0	101.4	△ 9.2
	(期 末) 2023年 1月25日	6,030	1.7	427.245	1.1	101.0	△ 7.1
第302期	(期 首) 2023年 1月25日	6,027	—	427.245	—	101.0	△ 7.1
	1月末	6,007	△0.3	426.216	△0.2	101.6	△ 7.0
	(期 末) 2023年 2月27日	6,052	0.4	430.723	0.8	103.2	△ 0.3
第303期	(期 首) 2023年 2月27日	6,049	—	430.723	—	103.2	△ 0.3
	2月末	6,064	0.2	430.565	△0.0	102.6	△ 0.4
	(期 末) 2023年 3月27日	6,002	△0.8	428.146	△0.6	102.5	△11.1
第304期	(期 首) 2023年 3月27日	5,999	—	428.146	—	102.5	△11.1
	3月末	6,109	1.8	432.863	1.1	105.5	△11.1
	(期 末) 2023年 4月25日	6,156	2.6	439.045	2.5	103.6	△ 7.3
第305期	(期 首) 2023年 4月25日	6,153	—	439.045	—	103.6	△ 7.3
	4月末	6,135	△0.3	437.846	△0.3	103.9	△ 4.1
	(期 末) 2023年 5月25日	6,227	1.2	445.887	1.6	103.7	0.6

(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。

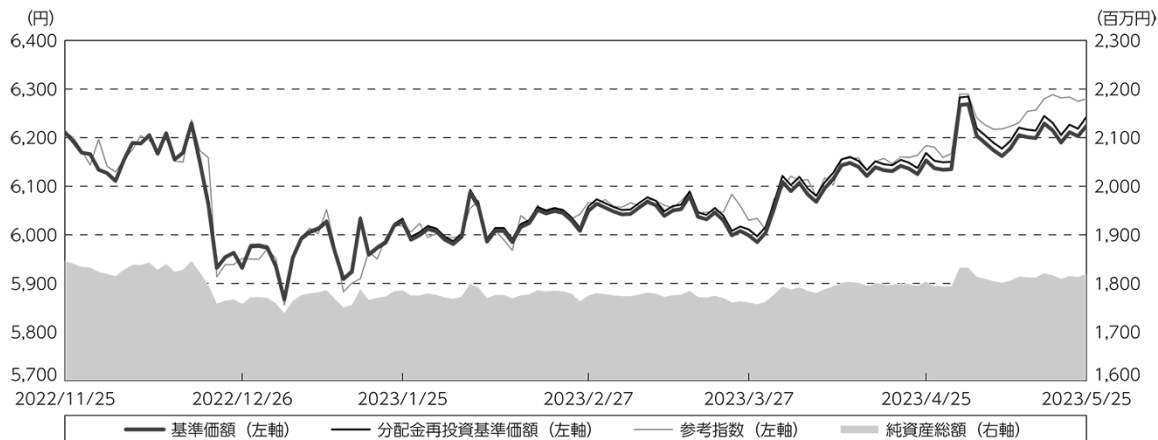
(注) 月末は、各月の最終営業日です。

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

(2022年11月26日～2023年5月25日)



第300期首：6,211円

第305期末：6,224円 (既払分配金(税込み)：18円)

騰落率：0.5% (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(2022年11月25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
- ・保有しているモーゲージ証券の価格上昇

下落要因

- ・保有しているイギリスおよび欧州の国債の価格下落
- ・保有している金融関連や情報・テクノロジー関連の投資適格社債の価格下落

投資環境

(2022年11月26日～2023年5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下落した一方、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。

米国国債金利

当作成期初から2023年3月初旬にかけては、インフレへの警戒感とそれに伴う金融政策への思惑に左右される展開となりました。その後4月上旬にかけては、利上げペースの減速期待が高まったことや、中堅銀行をめぐる金融不安などから、金利は低下(価格は上昇)しました。当作成期末にかけては、金融引き締め長期化への思惑から金利は上昇(価格は下落)に転じました。

ドイツ国債金利

当作成期初から2023年3月初旬にかけては、利上げペースを緩める可能性が意識される局面があったものの、欧州中央銀行(ECB)がインフレ抑制のための利上げ継続を表明したことから金利は上昇基調で推移しました。3月半ばから4月上旬にかけては、金融不安の高まりから金利は低下基調だったものの、4月半ば以降当作成期末にかけては、ECBの利上げが続くと観測から再び上昇基調となりました。

投資適格社債市場

当作成期初から2023年3月初旬にかけては、世界的な金融引締めに伴う景気後退リスクが意識されて下落する場面もあったものの、おおむね堅調に推移しました。その後当作成期末にかけても、利上げペース減速期待の高まりからリスクオンとなり、おおむね上昇基調で推移しました。

為替市場

米ドル/円：前作成期末並みとなりました。2023年1月末にかけては、米国長期金利が低下したことや、日本銀行(日銀)の為替介入および長期金利の許容変動幅の拡大決定などを背景に円高米ドル安基調となりました。2月以降当作成期末にかけては、米国長期金利の上昇や日銀の緩和政策維持姿勢を背景に円安米ドル高基調となりました。

ユーロ/円：前作成期末比で円安ユーロ高となりました。当作成期初から2023年1月末にかけては、ECBが利上げペースを緩める可能性が意識されたことや、日銀の金融緩和政策の修正を受けて円高ユーロ安となりました。2月以降当作成期末にかけては、ECBの利上げ姿勢が変わらないとの観測の中、日銀の緩和政策維持も材料となり、円安ユーロ高基調となりました。

運用概況

(2022年11月26日～2023年5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・政府機関債の組入れは低下した一方、社債券等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(2022年11月25日現在)

セクター	比率
国債・政府機関債	59.6%
社債券等	30.5%
モーゲージ証券	11.7%
現金等	-1.8%



当作成期末(2023年5月25日現在)

セクター	比率
国債・政府機関債	57.4%
社債券等	33.0%
モーゲージ証券	13.3%
現金等	-3.7%

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

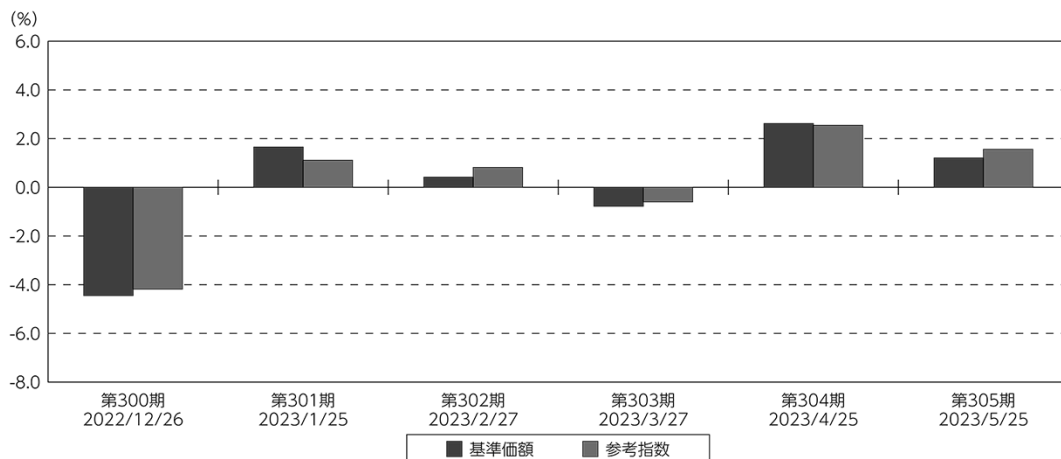
(注) 小数第2位を四捨五入。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2022年11月26日～2023年5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

(2022年11月26日～2023年5月25日)

当作成期間の収益分配については、基準価額水準や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。（当期作成期間合計：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、1万口当たり、税込み)

項 目	第300期	第301期	第302期	第303期	第304期	第305期
	2022年11月26日～ 2022年12月26日	2022年12月27日～ 2023年1月25日	2023年1月26日～ 2023年2月27日	2023年2月28日～ 2023年3月27日	2023年3月28日～ 2023年4月25日	2023年4月26日～ 2023年5月25日
当期分配金 (対基準価額比率)	3 0.051%	3 0.050%	3 0.050%	3 0.050%	3 0.049%	3 0.048%
当期の収益	2	3	3	3	3	3
当期の収益以外	0	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	212	222	229	231	241	252

(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

2023年の世界経済は、前年からの減速が続くものの、プラス成長を維持すると予想しています。ただし、欧米の金融不安から与信市場がタイト化することが予想される中、インフレの高止まりから各国中央銀行が利上げを継続すれば、景気後退に陥る可能性があります。その場合は、成長率が下方に修正される可能性があります。

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。

※上記は当作成期末時点での見通しおよび運用方針であり、今後予告なしに変更することがあります。また、市況の変動等により方針どおりの運用が行われない場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年11月26日～2023年5月25日)

項 目	第300期～第305期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	51	0.845	(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 ）	(25)	(0.409)	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 ）	(25)	(0.409)	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	7	0.115	(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)	(0.054)	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)	(0.008)	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 ）	(3)	(0.053)	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	58	0.963	
作成期間中の平均基準価額は、6,069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。

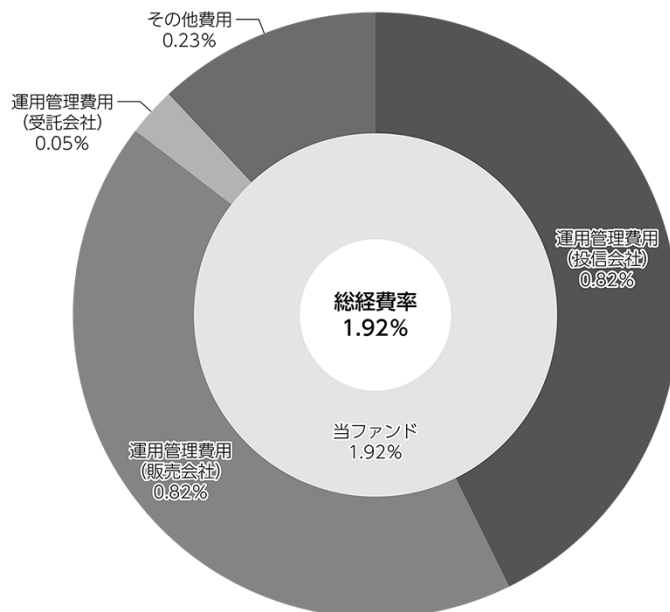
(注) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。ただし、平均基準価額は円未満切り捨て。

(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1.92%です。



(注) 当ファンドの費用は1万円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

(2022年11月26日～2023年5月25日)

公社債

			第300期～第305期	
			買付額	売付額
国内	国債証券		千円 137,216	千円 131,307
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 2,243	千米ドル 2,764
		地方債証券	31	—
		特殊債証券	5,766	5,552 (6)
		社債証券	987	938 (119)
	カナダ	国債証券	千カナダドル 421	千カナダドル 569
		社債証券	484	—
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 10,650	千メキシコペソ 7,458
	ペルー	国債証券	千ペルーソル 908	千ペルーソル 401
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	456	708
		社債証券	6	21
	イタリア	国債証券	45	—
	フランス	国債証券	43	—
		社債証券	102	—
	オランダ	社債証券	199	281
	スペイン	国債証券	110	—
		社債証券	—	88
	フィンランド	国債証券	44	—
	アイルランド	国債証券	43	43
	その他	国債証券	25	97
		特殊債証券	99	138
		社債証券	299	265
	イギリス	国債証券	千英ポンド 179	千英ポンド 121
社債証券		46	60 (50)	
オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 350	千オーストラリアドル 692	
	地方債証券	216	—	
ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランドドル 264	千ニュージーランドドル 263	

(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) -印は該当なし。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		第300期～第305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 14	百万円 44
外国	債券先物取引	941	850	786	839

(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) -印は該当なし。

直物為替先渡取引状況

種 類 別		第300期～第305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)	265	306	259	306
	(コロンビアペソ)	4	4	4	4
	(インドネシアルピア)	6	6	6	6
	(インドルピー)	310	258	275	258
	(韓国ウォン)	268	304	267	304
	(新台湾ドル)	204	43	205	43

(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

(2022年11月26日～2023年5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

(2023年5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305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	77,800	76,162	4.2	—	3.4	0.8	—
合 計	77,800	76,162	4.2	—	3.4	0.8	—

(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305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156回利付国債 (5年)	0.2	13,650	13,721	2027/12/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	8,100	6,794	2049/3/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	3,050	2,572	2050/9/20
第74回利付国債 (30年)	1.0	14,250	13,270	2052/3/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	5,950	5,815	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	12,550	12,394	2036/12/20
第183回利付国債 (20年)	1.4	20,250	21,593	2042/12/20
合 計		77,800	76,162	

(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305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 7,066	千米ドル 6,284	千円 876,949	% 48.2	% 0.0	% 30.8	% 15.6	% 1.8
カナダ	千カナダドル 787	千カナダドル 721	73,998	4.1	—	3.6	0.5	—
メキシコ	千メキシコペソ 3,598	千メキシコペソ 3,242	25,382	1.4	—	1.4	—	—
ペルー	千ペルーソル 526	千ペルーソル 517	19,539	1.1	—	1.1	—	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	147	97	14,661	0.8	—	0.5	0.3	—
イタリア	85	83	12,538	0.7	—	0.7	—	—
フランス	550	524	78,693	4.3	—	1.2	1.6	1.6
オランダ	200	184	27,642	1.5	—	1.5	—	—
スペイン	211	202	30,389	1.7	—	1.7	—	—
ベルギー	141	121	18,155	1.0	—	1.0	—	—
オーストリア	459	376	56,530	3.1	—	3.1	—	—
フィンランド	156	143	21,499	1.2	—	0.4	0.8	—
その他	2,181	2,004	300,562	16.5	—	5.6	10.2	0.8
イギリス	千英ポンド 554	千英ポンド 427	73,785	4.1	—	3.6	0.5	—
オーストラリア	千オーストラリアドル 815	千オーストラリアドル 755	68,918	3.8	—	1.1	1.9	0.8
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 643	千ニュージーランドドル 610	51,924	2.9	—	1.2	—	1.6
中国	千中国元 2,170	千中国元 2,237	44,141	2.4	—	1.1	1.3	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 241	千マレーシアリンギット 252	7,630	0.4	—	0.4	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 715,000	千インドネシアルピア 718,932	6,757	0.4	—	0.4	—	—
合 計	—	—	1,809,700	99.5	0.0	60.3	32.6	6.6

(注) 邦貨換算金額は、第305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305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	国債証券	US TREASURY	2.5	64	63	8,796	2024/5/31
		US TREASURY	0.375	28	27	3,779	2024/9/15
		US TREASURY	0.25	16	14	2,056	2025/5/31
		US TREASURY	1.25	220	200	28,006	2026/11/30
		US TREASURY	2.25	242	228	31,892	2027/2/15
		US TREASURY	0.5	275	238	33,330	2027/8/31
		US TREASURY	0.75	435	378	52,752	2028/1/31
		US TREASURY	2.875	180	172	24,061	2028/5/15
		US TREASURY	2.875	126	118	16,520	2032/5/15
		US TREASURY	4.125	117	120	16,831	2032/11/15
		US TREASURY	3.5	32	32	4,478	2033/2/15
		US TREASURY	4.5	10	10	1,494	2039/8/15
		US TREASURY	1.125	642	406	56,774	2040/8/15
		US TREASURY	1.75	36	25	3,575	2041/8/15
		US TREASURY	3.0	9	7	1,045	2045/11/15
		US TREASURY	1.25	239	130	18,219	2050/5/15
		US TREASURY	2.0	162	107	15,067	2051/8/15
		US TSY INFL IX N/B	0.125	402	420	58,683	2026/10/15
		US TSY INFL IX N/B	1.125	135	132	18,470	2033/1/15
	地方債証券	CMWLTH FING AUTH PA	4.144	5	4	629	2038/6/1
FLORIDA ST BRD OF ADM		2.154	20	16	2,321	2030/7/1	
NJ ST TRANSN-BAB-C		5.754	10	10	1,419	2028/12/15	
特殊債券 (除く金融債)	FNMA 30 YR CA 2370	4.5	35	34	4,818	2048/9/1	
	GNMAII 30 YR MA 8428	5.0	73	72	10,117	2052/11/20	
	GNMAII30YR TBA 4.5 JUN23	4.5	182	175	24,532	2053/6/1	
	GNMAII30YR TBA 5.0 JUN23	5.0	194	190	26,589	2053/6/1	
	UMBS 30 YR RA 1419	3.5	34	31	4,422	2049/9/1	
	UMBS 30YR TBA 2.5 JUN23	2.5	126	107	14,960	2053/6/1	
	UMBS 30YR TBA 3.0 JUN23	3.0	171	150	21,019	2053/6/1	
	UMBS 30YR TBA 3.5 JUN23	3.5	80	73	10,274	2053/6/1	
	UMBS 30YR TBA 4.5 JUN23	4.5	109	105	14,727	2053/6/1	
	UMBS 30YR TBA 5.5 JUN23	5.5	66	65	9,168	2053/6/1	
普通社債券	AHT1 2018-ASHF A	6.132	74	72	10,103	2035/4/15	
	AIRCASTLE LTD	5.25	22	21	2,984	2025/8/11	
	AMERISOURCE BERGEN CORP	2.7	7	5	827	2031/3/15	
	AVIATION CAPITAL GROUP	4.125	16	15	2,097	2025/8/1	
	AVIATION CAPITAL GROUP	1.95	10	8	1,244	2026/1/30	
	AVIATION CAPITAL GROUP	1.95	14	12	1,691	2026/9/20	
	BANCO DE CREDITO DEL PER	3.125	45	41	5,726	2030/7/1	
	BANK OF AMERICA CORP	3.559	60	56	7,935	2027/4/23	
	BANK OF AMERICA CORP	3.974	6	5	771	2030/2/7	
	BANK OF AMERICA CORP	3.194	6	5	734	2030/7/23	
	BANK OF AMERICA CORP	2.884	6	5	715	2030/10/22	

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305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					
	BP CAP MARKETS AMERICA	4.893	15	14	2,062	2033/9/11
	BX 2019-1MC A	6.107	100	98	13,776	2034/4/15
	CAPITAL ONE FINANCIAL CO	5.48198	15	14	2,050	2024/12/6
	CAS 2014-C03 2M2	7.92043	3	3	508	2024/7/25
	CAS 2014-C04 2M2	10.02043	1	1	169	2024/11/25
	CAS 2016-C01 1M2	11.77043	8	8	1,226	2028/8/25
	CAS 2016-C01 2M2	11.97043	6	6	947	2028/8/25
	CAS 2016-C02 1M2	11.02043	17	18	2,572	2028/9/25
	CAS 2021-R01 1M1	5.56533	2	2	329	2041/10/25
	CAS 2021-R01 1M2	6.36533	10	10	1,439	2041/10/25
	CAS 2021-R03 1M1	5.66533	55	55	7,727	2041/12/25
	CAS 2021-R03 1M2	6.46533	100	96	13,500	2041/12/25
	CAS 2022-R01 1M2	6.71533	100	97	13,583	2041/12/25
	CAS 2023-R02 1M1	7.12367	48	48	6,803	2043/1/25
	CBS CORP	5.5	20	17	2,447	2033/5/15
	CHARLES SCHWAB CORP	4.0	46	37	5,204	2099/12/1
	CHARTER COMM OPT LLC/CAP	5.375	30	23	3,278	2047/5/1
	CITIGROUP INC	6.123149	9	9	1,260	2025/5/24
	CONTINENTAL RESOURCES	5.75	17	16	2,241	2031/1/15
	CONTINENTAL RESOURCES	2.875	26	19	2,754	2032/4/1
	CORNING INC	5.45	20	17	2,417	2079/11/15
	COX COMMUNICATIONS INC	1.8	37	28	4,019	2030/10/1
	DISCOVER FINANCIAL SVS	6.7	11	11	1,569	2032/11/29
	DISCOVERY COMMUNICATIONS	4.125	9	8	1,138	2029/5/15
	DISCOVERY COMMUNICATIONS	5.2	19	14	2,061	2047/9/20
	DISCOVERY COMMUNICATIONS	4.65	9	6	908	2050/5/15
	EATON CORP	4.35	16	15	2,208	2028/5/18
	EIDP INC	4.8	18	17	2,460	2033/5/15
	ERAC USA FINANCE LLC	4.6	21	20	2,863	2028/5/1
	FCAT 2018-3 D	4.15	15	15	2,197	2024/12/16
	FLORIDA POWER & LIGHT CO	4.8	17	16	2,346	2033/5/15
	FOX CORP	5.476	20	18	2,557	2039/1/25
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	6.196829	10	10	1,399	2024/3/15
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	1.542	47	41	5,775	2027/9/10
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	3.615	6	5	788	2028/3/15
	GRUPO TELEVISIA SAB	8.5	22	25	3,618	2032/3/11
	HARLEY-DAVIDSON FINL SER	3.35	3	2	396	2025/6/8
	HARLEY-DAVIDSON FINL SER	3.05	27	24	3,368	2027/2/14
	HP INC	5.5	30	29	4,072	2033/1/15
	HSBC HOLDINGS PLC	4.755	207	200	27,934	2028/6/9
	HYUNDAI CAPITAL AMERICA	1.8	20	16	2,367	2028/1/10
	HYUNDAI CAPITAL AMERICA	2.1	14	11	1,643	2028/9/15
	IHSFR 2018-SFR4 A	6.208	87	87	12,183	2038/1/17
	JPMBB 2014-C21 B	4.3413	17	15	2,148	2047/8/15

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305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	JPMORGAN CHASE & CO	5.671149	8	7	1,115	2026/2/24
		JPMORGAN CHASE & CO	6.148587	3	3	420	2026/4/26
		JPMORGAN CHASE & CO	4.851	20	19	2,764	2028/7/25
		KYNDRYL HOLDINGS INC	2.05	26	22	3,102	2026/10/15
		LADAR 2023-2A A2	5.93	17	16	2,368	2027/6/15
		LEAR CORP	3.5	33	28	4,033	2030/5/30
		MARRIOTT INTERNATIONAL	2.85	10	8	1,161	2031/4/15
		MDC HOLDINGS INC	6.0	30	26	3,641	2043/1/15
		META PLATFORMS INC	4.65	16	13	1,845	2062/8/15
		NEW YORK LIFE GLOBAL FDG	4.8527	21	20	2,851	2026/6/9
		NIAGARA MOHAWK POWER	4.278	39	36	5,128	2028/12/15
		NIAGARA MOHAWK POWER	1.96	5	4	560	2030/6/27
		OMNICOM GROUP INC	2.45	14	11	1,641	2030/4/30
		ONEOK INC	6.35	20	20	2,858	2031/1/15
		ONEOK INC	6.1	5	5	702	2032/11/15
		PAYPAL HOLDINGS INC	5.25	14	12	1,777	2062/6/1
		PNC FINANCIAL SERVICES	5.354	40	39	5,544	2028/12/2
		PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5.625	20	19	2,785	2043/6/15
		QUALCOMM INC	6.0	20	21	2,957	2053/5/20
		ROSS STORES INC	1.875	35	27	3,846	2031/4/15
		SANTANDER HOLDINGS USA	2.49	43	37	5,204	2028/1/6
		SANTANDER HOLDINGS USA	6.499	14	13	1,953	2029/3/9
		SBA TOWER TRUST	3.869	25	24	3,387	2049/10/15
		SOUTHWEST AIRLINES CO	2.625	32	26	3,741	2030/2/10
		STACR 2021-DNA3 M2	6.91533	20	19	2,777	2033/10/25
		STACR 2021-DNA5 M2	6.46533	11	11	1,553	2034/1/25
		STACR 2021-HQA4 M1	5.76533	45	44	6,151	2041/12/25
		SUNCOR ENERGY INC	6.85	15	15	2,211	2039/6/1
		SURA ASSET MANAGEMENT	4.875	100	98	13,738	2024/4/17
		SYNCHRONY FINANCIAL	3.95	10	8	1,186	2027/12/1
		SYNCHRONY FINANCIAL	2.875	32	22	3,162	2031/10/28
		T-MOBILE USA INC	3.875	19	17	2,441	2030/4/15
		T-MOBILE USA INC	5.05	17	16	2,315	2033/7/15
		THOMSON REUTERS CORP	5.5	26	25	3,582	2035/8/15
TRUIST FINANCIAL CORP	5.122	19	17	2,492	2034/1/26		
US BANCORP	5.3	30	24	3,355	2099/10/15		
VF CORP	2.95	47	38	5,386	2030/4/23		
WARNERMEDIA HOLDINGS INC	3.755	14	13	1,819	2027/3/15		
WESTERN DIGITAL CORP	2.85	25	19	2,788	2029/2/1		
WESTERN DIGITAL CORP	3.1	18	13	1,871	2032/2/1		
WRKCO INC	4.9	20	19	2,715	2029/3/15		
小	計				876,949		
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	2.25	44	41	4,248	2029/12/1

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305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		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	110	77	7,988	2053/12/1	
地方債証券	PROVINCE OF ONTARIO	2.7	105	98	10,124	2029/6/2	
	PROVINCE OF QUEBEC	3.65	26	25	2,609	2032/5/20	
普通社債券	407 INTERNATIONAL INC	5.75	43	45	4,624	2036/2/14	
	BANK OF MONTREAL	3.19	39	36	3,764	2028/3/1	
	BELL CANADA	4.55	3	2	300	2030/2/9	
	BELL CANADA	3.0	5	4	447	2031/3/17	
	BELL CANADA	5.85	21	22	2,268	2032/11/10	
	BELL CANADA	5.15	28	26	2,745	2053/2/9	
	CU INC	5.183	35	36	3,708	2035/11/21	
	ELECTRICITE DE FRANCE SA	5.993	27	26	2,755	2030/5/23	
	ENBRIDGE INC	6.1	14	14	1,516	2032/11/9	
	ENBRIDGE PIPELINES INC	2.82	14	11	1,226	2031/5/12	
	METRO INC	4.657	37	36	3,710	2033/2/7	
	SAPUTO INC	2.297	41	36	3,712	2028/6/22	
	TELUS CORP	3.15	30	26	2,751	2030/2/19	
	TELUS CORP	5.25	26	26	2,675	2032/11/15	
	TORONTO-DOMINION BANK	1.896	63	54	5,562	2028/9/11	
	TRANSCANADA PIPELINES	5.33	26	25	2,665	2032/5/12	
	VERIZON COMMUNICATIONS	2.375	50	44	4,590	2028/3/22	
小計					73,998		
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ			
国債証券	MEXICAN BONOS	8.5	835	817	6,397	2029/5/31	
	MEXICAN BONOS	8.0	2,763	2,424	18,984	2053/7/31	
小計					25,382		
ペルー			千ペルーソル	千ペルーソル			
国債証券	REPUBLIC OF PERU	6.95	526	517	19,539	2031/8/12	
小計					19,539		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	79	40	6,065	2050/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8	24	20	3,084	2053/8/15
	普通社債券	VOLKSWAGEN FIN SERV AG	0.875	43	36	5,511	2028/1/31
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.4	45	45	6,818	2033/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	40	38	5,720	2035/4/30
フランス	国債証券	FRENCH TREASURY	2.5	50	43	6,497	2043/5/25
	特殊債券 (除く金融債)	CAISSE FRANCAISE DE FIN	3.125	100	99	14,862	2027/11/16
	普通社債券	CIE FINANCEMENT FONCIER	0.01	100	90	13,499	2026/7/15
		DEXIA CREDIT LOCAL	0.5	200	190	28,536	2025/1/17
	SUEZ	4.625	100	101	15,297	2028/11/3	
オランダ	特殊債券 (除く金融債)	BNG BANK NV	—	100	84	12,743	2028/8/31
	普通社債券	ING GROEP NV	4.5	100	99	14,898	2029/5/23
スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	3.9	111	110	16,599	2039/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	3.45	100	91	13,789	2043/7/30

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305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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	1.45	44	34	5,188	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	25	20	3,081	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.75	72	65	9,884	2039/4/22
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	—	64	52	7,888	2030/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	140	111	16,672	2031/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.9	255	213	31,969	2032/2/20
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	—	56	45	6,789	2030/9/15
	普通社債券	NORDEA KIINNITSLUOTTO	2.625	100	98	14,709	2025/12/1
その他	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT	5.0	38	38	5,728	2027/2/22
		REPUBLIC OF INDONESIA	1.0	100	82	12,427	2029/7/28
		ROMANIA	6.625	25	25	3,827	2029/9/27
		UNITED MEXICAN STATES	3.375	134	123	18,487	2031/2/23
	地方債証券	JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	0.01	100	85	12,784	2028/2/2
		PROVINCE OF QUEBEC	0.875	100	90	13,639	2027/5/4
	特殊債券 (除く金融債)	DEVELOPMENT BK OF JAPAN	3.125	100	98	14,820	2028/4/13
		EXPORT DEVELOPMNT CANADA	0.5	100	90	13,596	2027/2/25
		INTL BK RECON & DEVELOP	—	41	36	5,493	2027/1/15
		INTL BK RECON & DEVELOP	0.01	43	36	5,545	2028/4/24
	普通社債券	ALTRIA GROUP INC	3.125	100	84	12,721	2031/6/15
		CADENT FINANCE PLC	0.625	100	79	11,938	2030/3/19
		CK HUTCHISON FINANCE 16	0.875	100	95	14,335	2024/10/3
		CREDIT SUISSE AG LONDON	0.25	100	89	13,398	2026/1/5
		DNB BOLIGKREDITT AS	0.625	100	94	14,132	2025/6/19
		EXXON MOBIL CORP	0.835	100	76	11,469	2032/6/26
		FIDELITY NATIONAL INFORM	0.625	100	91	13,741	2025/12/3
		HONEYWELL INTERNATIONAL	4.125	100	99	14,961	2034/11/2
		MET LIFE GLOB FUNDING I	4.0	100	100	15,005	2028/4/5
MORGAN STANLEY		4.656	100	100	15,127	2029/3/2	
NATIONAL AUSTRALIA BANK		2.25	100	97	14,574	2025/6/6	
ROYAL BANK OF CANADA		0.625	100	92	13,816	2026/3/23	
STADSHYPOTEK AB		0.5	100	93	14,074	2025/7/11	
SUMITOMO MITSUI TR BK LT		3.629	100	99	14,915	2026/4/6	
小計						560,672	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
国債証券	UK TREASURY	0.125	60	49	8,591	2028/1/31	
	UK TREASURY	3.25	78	72	12,491	2033/1/31	
	UK TREASURY	3.75	23	21	3,784	2038/1/29	
	UK TREASURY	1.25	63	37	6,501	2041/10/22	
	UK TREASURY	0.875	91	44	7,638	2046/1/31	
	UK TREASURY	1.25	11	5	980	2051/7/31	
	UK TREASURY	1.5	71	36	6,297	2053/7/31	
普通社債券	ANGLIAN WATER SERV FIN	6.293	30	31	5,416	2030/7/30	
	E. ON INTL FINANCE BV	6.25	40	41	7,077	2030/6/3	
	ELECTRICITE DE FRANCE SA	5.875	15	14	2,482	2031/7/18	

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305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	普通社債券	HEATHROW FUNDING LTD	6.45	50	51	8,938	2031/12/10
		THAMES WATER UTIL FIN	6.75	20	20	3,584	2028/11/16
小	計					73,785	
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	BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.25	160	159	14,588	2024/11/27	
	NEW S WALES TREASURY CRP	2.0	269	217	19,893	2033/3/8	
特殊債券 (除く金融債)	BNG BANK NV	3.5	101	98	8,985	2027/7/19	
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1.8	25	23	2,113	2027/1/19	
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	0.75	35	30	2,803	2027/7/15	
	INTER-AMERICAN DEVEL BK	4.25	33	33	3,037	2026/6/11	
	INTL BK RECON & DEVELOP	3.0	18	17	1,594	2026/10/19	
	INTL FINANCE CORP	4.45	48	48	4,454	2027/5/14	
KFW	4.1	96	96	8,802	2026/2/20		
普通社債券	VODAFONE GROUP PLC	4.2	30	28	2,644	2027/12/13	
小	計				68,918		
ニュージーランド				千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.75	365	351	29,903	2025/4/15	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.5	278	258	22,020	2033/4/14	
小	計				51,924		
中国				千中国元	千中国元		
国債証券	CHINA GOVERNMENT	3.01	1,200	1,228	24,230	2028/5/13	
	CHINA GOVERNMENT	3.39	970	1,009	19,911	2050/3/16	
小	計				44,141		
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	4.498	241	252	7,630	2030/4/15	
小	計				7,630		
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	6.5	715,000	718,932	6,757	2031/2/15	
小	計				6,757		
合	計				1,809,700		

(注) 邦貨換算金額は、第305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。

※償還日が「2099年」の証券は永久債であり、永久債には償還日がないため、仮置きの日付けを入れております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			第305期末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	債券先物取引	2YR T-NOTES	百万円 28	百万円 —
		5YR T-NOTES	106	—
		SFE 3YR TBON	—	29
		CAN5YR BOND	—	22
		EUR-SCHATZ	—	189
		3YR KTB	121	—
		LONG GILT	33	—
		EURO-OAT	—	38

(注) 邦貨換算金額は、第305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305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)	129	18	124	17
	(コロンビアペソ)	10	1	—	—
	(インドネシアルピア)	25	3	—	—
	(インドルピー)	867	120	866	120
	(韓国ウォン)	369	51	271	37
	(新台幣ドル)	1,191	166	1,191	166

(注) 邦貨換算金額は、第305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

(2023年5月25日現在)

項 目	第305期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 1,885,863	% 94.6
コール・ローン等、その他	106,598	5.4
投資信託財産総額	1,992,461	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注) 第305期末における外貨建純資産 (1,728,315千円) の投資信託財産総額 (1,992,461千円) に対する比率は86.7%です。

(注) 外貨建資産は、第305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=139.54円、1カナダドル=102.63円、1メキシコペソ=7.8287円、1ペルーソル=37.7723円、1ユーロ=149.98円、1英ポンド=172.49円、1オーストラリアドル=91.26円、1ニュージーランドドル=85.06円、1中国元=19.73円、1マレーシアリンギット=30.2466円、100インドネシアルピア=0.94円、100韓国ウォン=10.60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

アラリアンス・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2022年11月26日から2023年5月25日までの間で直物為替先渡取引（以下「NDF」といいます。）119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300期末	第301期末	第302期末	第303期末	第304期末	第305期末
	2022年12月26日現在	2023年1月25日現在	2023年2月27日現在	2023年3月27日現在	2023年4月25日現在	2023年5月25日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	4,711,529,272	4,523,031,750	4,852,758,736	5,008,342,830	5,627,761,717	4,376,005,074
コール・ローン等	47,141,936	52,004,371	42,892,681	83,222,034	27,124,166	31,415,956
公社債(評価額)	1,782,962,091	1,803,530,142	1,831,705,491	1,805,222,694	1,869,186,676	1,885,863,834
未収入金	2,852,454,629	2,642,933,338	2,955,486,101	3,092,290,779	3,700,678,574	2,429,429,727
未収利息	9,720,934	11,181,512	8,810,670	9,886,768	10,406,044	10,339,282
前払費用	1,669,625	2,183,386	3,116,040	1,626,315	2,856,794	3,337,366
その他未収収益	1,911,715	2,142,139	2,357,724	2,602,586	2,805,893	3,011,445
差入委託証拠金	15,668,342	9,056,862	8,390,029	13,491,654	14,703,570	12,607,464
(B) 負債	2,953,623,846	2,737,016,921	3,077,526,812	3,247,569,577	3,824,313,935	2,556,959,666
未払金	2,950,073,269	2,733,457,189	3,064,338,653	3,244,348,666	3,820,994,010	2,553,525,443
未払収益分配金	889,076	888,989	880,452	880,488	879,329	876,814
未払解約金	—	170,000	9,543,507	—	—	—
未払信託報酬	2,638,091	2,478,015	2,739,257	2,319,197	2,418,543	2,534,064
未払利息	67	138	94	142	74	60
その他未払費用	23,343	22,590	24,849	21,084	21,979	23,285
(C) 純資産総額(A-B)	1,757,905,426	1,786,014,829	1,775,231,924	1,760,773,253	1,803,447,782	1,819,045,408
元本	2,963,588,580	2,963,298,882	2,934,842,989	2,934,962,750	2,931,097,301	2,922,715,202
次期繰越損益金	△1,205,683,154	△1,177,284,053	△1,159,611,065	△1,174,189,497	△1,127,649,519	△1,103,669,794
(D) 受益権総口数	2,963,588,580口	2,963,298,882口	2,934,842,989口	2,934,962,750口	2,931,097,301口	2,922,715,202口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,932円	6,027円	6,049円	5,999円	6,153円	6,224円

(注) 第300期首元本額2,971,928,875円、第300～305期中追加設定元本額3,867,019円、第300～305期中一部解約元本額53,080,692円。第305期末現在における1口当たり純資産額0.6224円。

(注) 第305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△1,103,669,794円です。

○損益の状況

項 目	第300期	第301期	第302期	第303期	第304期	第305期
	2022年11月26日～ 2022年12月26日	2022年12月27日～ 2023年1月25日	2023年1月26日～ 2023年2月27日	2023年2月28日～ 2023年3月27日	2023年3月28日～ 2023年4月25日	2023年4月26日～ 2023年5月25日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	3,983,047	4,037,711	4,351,461	3,966,650	4,042,516	4,430,198
受取利息	3,748,434	3,789,485	4,116,905	3,701,719	3,816,157	4,207,209
その他収益金	237,293	251,062	237,203	266,534	227,633	224,390
支払利息	△ 2,680	△ 2,836	△ 2,647	△ 1,603	△ 1,274	△ 1,401
(B) 有価証券売買損益	△ 95,468,801	30,636,712	7,752,029	△ 14,389,186	42,298,877	23,026,513
売買益	149,976,034	132,009,600	115,462,887	114,483,690	134,386,054	121,309,686
売買損	△ 245,444,835	△ 101,372,888	△ 107,710,858	△ 128,872,876	△ 92,087,177	△ 98,283,173
(C) 先物取引等取引損益	12,883,372	△ 2,821,453	△ 1,928,223	△ 731,063	2,571,589	△ 3,103,315
取引益	21,591,522	14,404,335	11,184,129	10,519,038	10,816,684	7,780,978
取引損	△ 8,708,150	△ 17,225,788	△ 13,112,352	△ 11,250,101	△ 8,245,095	△ 10,884,293
(D) 信託報酬等	△ 3,309,224	△ 2,682,782	△ 2,927,234	△ 2,497,040	△ 3,040,107	△ 2,721,705
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 81,911,606	29,170,188	7,248,033	△ 13,650,639	45,872,875	21,631,691
(F) 前期繰越損益金	△ 176,790,281	△ 259,507,616	△ 228,955,622	△ 222,548,391	△ 236,715,008	△ 191,132,152
(G) 追加信託差損益金	△ 946,092,191	△ 946,057,636	△ 937,023,024	△ 937,109,979	△ 935,928,057	△ 933,292,519
(配当等相当額)	(3,669,379)	(3,682,280)	(3,660,451)	(3,674,563)	(3,683,909)	(3,687,748)
(売買損益相当額)	(△ 949,761,570)	(△ 949,739,916)	(△ 940,683,475)	(△ 940,784,542)	(△ 939,611,966)	(△ 936,980,267)
(H) 計(E+F+G)	△ 1,204,794,078	△ 1,176,395,064	△ 1,158,730,613	△ 1,173,309,009	△ 1,126,770,190	△ 1,102,792,980
(I) 収益分配金	△ 889,076	△ 888,989	△ 880,452	△ 880,488	△ 879,329	△ 876,814
次期繰越損益金(H+I)	△ 1,205,683,154	△ 1,177,284,053	△ 1,159,611,065	△ 1,174,189,497	△ 1,127,649,519	△ 1,103,669,794
追加信託差損益金	△ 946,092,191	△ 946,057,636	△ 937,023,024	△ 937,109,979	△ 935,928,057	△ 933,292,519
(配当等相当額)	(3,669,379)	(3,682,280)	(3,660,451)	(3,674,563)	(3,683,909)	(3,687,748)
(売買損益相当額)	(△ 949,761,570)	(△ 949,739,916)	(△ 940,683,475)	(△ 940,784,542)	(△ 939,611,966)	(△ 936,980,267)
分配準備積立金	59,377,033	62,166,514	63,775,028	64,352,790	67,165,920	70,017,773
繰越損益金	△ 318,967,996	△ 293,392,931	△ 286,363,069	△ 301,432,308	△ 258,887,382	△ 240,395,048

(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300期計算期間末における費用控除後の配当等収益額(673,823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(3,669,379円)および分配準備積立金額(59,592,286円)より分配対象収益額は63,935,488円(10,000口当たり215円)であり、うち889,076円(10,000口当たり3円)を分配金額としております。

* 第301期計算期間末における費用控除後の配当等収益額(3,697,534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(3,682,280円)および分配準備積立金額(59,357,969円)より分配対象収益額は66,737,783円(10,000口当たり225円)であり、うち888,989円(10,000口当たり3円)を分配金額としております。

* 第302期計算期間末における費用控除後の配当等収益額(3,099,483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(3,660,451円)および分配準備積立金額(61,555,997円)より分配対象収益額は68,315,931円(10,000口当たり232円)であり、うち880,452円(10,000口当たり3円)を分配金額としております。

* 第303期計算期間末における費用控除後の配当等収益額(1,469,610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(3,674,563円)および分配準備積立金額(63,763,668円)より分配対象収益額は68,907,841円(10,000口当たり234円)であり、うち880,488円(10,000口当たり3円)を分配金額としております。

* 第304期計算期間末における費用控除後の配当等収益額(3,791,403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(3,683,909円)および分配準備積立金額(64,253,846円)より分配対象収益額は71,729,158円(10,000口当たり244円)であり、うち879,329円(10,000口当たり3円)を分配金額としております。

* 第305期計算期間末における費用控除後の配当等収益額(3,935,120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(3,687,748円)および分配準備積立金額(66,959,467円)より分配対象収益額は74,582,335円(10,000口当たり255円)であり、うち876,814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300期	第301期	第302期	第303期	第304期	第305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。