



# 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306期(決算日2023年6月26日) 第307期(決算日2023年7月25日) 第308期(決算日2023年8月25日)  
第309期(決算日2023年9月25日) 第310期(決算日2023年10月25日) 第311期(決算日2023年11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311期の決算を行いました。

ここに、第306期から第311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)	基準価額			参考	指数		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		税金	込み	期中		期騰	中率			
	円	円	円	円		%	%	%	%	百万円
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
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

(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 円	騰 落 率 %	参 考 指 数 騰 落 率 %	債 券 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
第306期	(期 首) 2023年 5月25日	6,224	—	445.887	103.7	0.6
	5月末	6,244	0.3	448.890	104.0	△ 0.5
	(期 末) 2023年 6月26日	6,421	3.2	463.445	106.4	△ 0.2
第307期	(期 首) 2023年 6月26日	6,418	—	463.445	106.4	△ 0.2
	6月末	6,435	0.3	464.052	105.3	△ 0.2
	(期 末) 2023年 7月25日	6,372	△0.7	458.638	103.6	△ 4.2
第308期	(期 首) 2023年 7月25日	6,369	—	458.638	103.6	△ 4.2
	7月末	6,317	△0.8	454.653	103.5	△ 4.2
	(期 末) 2023年 8月25日	6,395	0.4	462.133	107.9	△10.7
第309期	(期 首) 2023年 8月25日	6,392	—	462.133	107.9	△10.7
	8月末	6,442	0.8	465.496	107.8	△10.8
	(期 末) 2023年 9月25日	6,409	0.3	463.373	108.9	△ 8.8
第310期	(期 首) 2023年 9月25日	6,406	—	463.373	108.9	△ 8.8
	9月末	6,361	△0.7	461.760	107.9	△ 5.0
	(期 末) 2023年10月25日	6,338	△1.1	460.637	108.0	△ 2.0
第311期	(期 首) 2023年10月25日	6,335	—	460.637	108.0	△ 2.0
	10月末	6,313	△0.3	458.013	108.2	△ 3.6
	(期 末) 2023年11月27日	6,557	3.5	475.792	108.2	△ 6.0

(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。

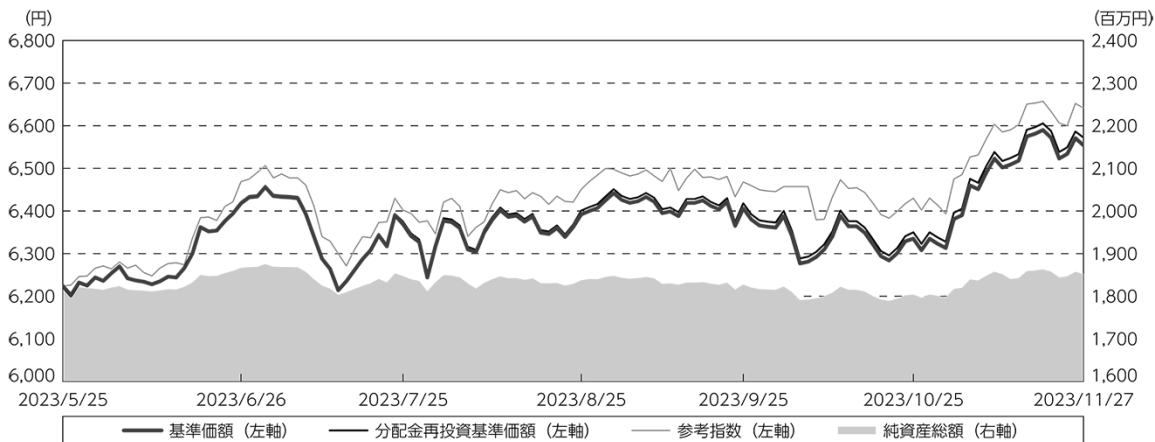
(注) 月末は、各月の最終営業日です。

## 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5月26日～2023年11月27日)



- (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(2023年5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や金融関連の投資適格社債の価格上昇

## 下落要因

- ・保有している日本、イギリスおよび欧州の国債の価格下落
- ・保有している小売関連や自動車関連の投資適格社債の価格下落

## 投資環境

(2023年5月26日～2023年11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。

### 【債券市場】

**米国国債金利**は上昇(価格は下落)しました。

2023年10月中旬にかけては、堅調な米国経済や米連邦準備理事会(FRB)のタカ派姿勢を背景に、金利はおおむね上昇基調で推移しました。その後中東地域での地政学リスクの高まりや、FRBの政策金利据え置きを受けて、金利はやや低下しました。

**ドイツ国債金利**はやや上昇(価格は下落)しました。

2023年10月初めにかけては、米国長期金利の上昇や欧州中央銀行(ECB)のタカ派姿勢の維持を背景に、金利はおおむね上昇基調で推移しました。その後中東地域での地政学リスクの高まりや、ECBの政策金利据え置きを背景に、金利は低下基調となりました。

**投資適格社債市場**は2023年10月中旬にかけては、欧米の長期金利の上昇基調から、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、欧米の金融当局が金利据え置きを決定し、利上げ終了観測が広がったことから、上昇基調で推移しました。

### 【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。日本銀行(日銀)による為替介入への警戒感から一時的に円高米ドル安が進行する局面があったものの、米国の政策金利見通しの引き上げや日銀の金融緩和の維持を背景に日米の金利差が意識され、当作成期を通じておおむね円安米ドル高基調で推移しました。

ユーロ/円：前作成期末比で円安ユーロ高となりました。米ドル同様、日銀による為替介入への警戒感から円高ユーロ安になる局面があったものの、ECBによるタカ派姿勢の維持を背景に、当作成期を通じておおむね円安ユーロ高基調で推移しました。

**運用概況**

(2023年5月26日～2023年11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(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%



当作成期末(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%

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

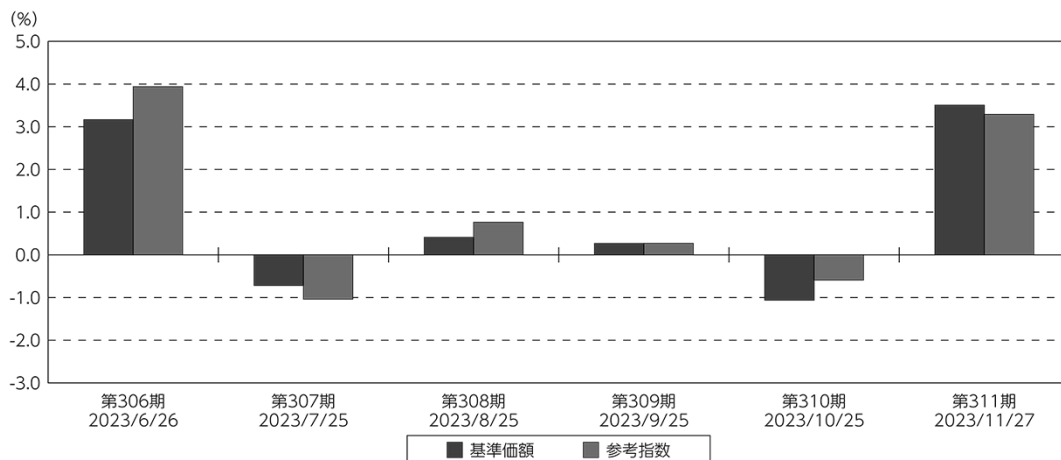
(注) 小数第2位を四捨五入。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

(2023年5月26日～2023年11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5月26日～2023年11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、1万口当たり、税込み)

項 目	第306期	第307期	第308期	第309期	第310期	第311期
	2023年5月26日～ 2023年6月26日	2023年6月27日～ 2023年7月25日	2023年7月26日～ 2023年8月25日	2023年8月26日～ 2023年9月25日	2023年9月26日～ 2023年10月25日	2023年10月26日～ 2023年11月27日
当期分配金	3	3	3	3	3	3
(対基準価額比率)	0.047%	0.047%	0.047%	0.047%	0.047%	0.046%
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	265	269	278	286	291	306

(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年の世界経済はプラス成長を維持、2024年も力強さにかけるもののプラス成長が続くと予想しています。ただし、金融機関への規制強化から与信市場がタイト化することが予想される中、金利水準が高位に推移し、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5月26日～2023年11月27日)

項 目	第306期～第311期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	55	0.866	(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 ）	(27)	(0.419)	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 ）	(27)	(0.419)	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 )	(0.028)	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	3	0.054	(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 )	(0.046)	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 ）	( 0 )	(0.000)	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	0.923	
作成期間中の平均基準価額は、6,352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。

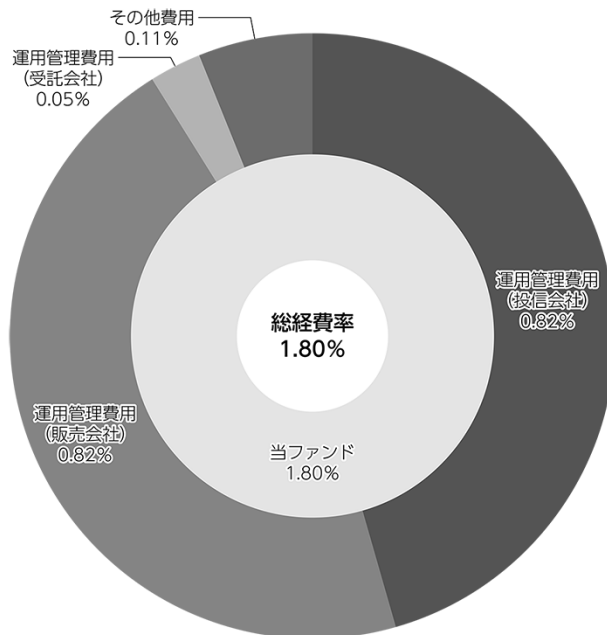
(注) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。ただし、平均基準価額は円未満切り捨て。

(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1.80%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5月26日～2023年11月27日)

公社債

		第306期～第311期	
		買付額	売付額
国内	国債証券	千円	千円
		188,307	106,359
外国	アメリカ	千米ドル	千米ドル
		国債証券 1,781	2,130
		地方債証券 37	—
		特殊債証券 8,675	8,166 ( 7)
	社債証券 796	509 ( 52)	
	カナダ	千カナダドル	千カナダドル
		国債証券 629	444
		地方債証券 —	97
		特殊債証券 84	—
	社債証券 67	26	
	メキシコ	千メキシコペソ	千メキシコペソ
	国債証券 1,488	3,800	
	ペルー	千ペルーソル	千ペルーソル
	国債証券 322	872	
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 95	—
	イタリア	国債証券 172	—
	フランス	国債証券 31	—
		社債証券 88	191
	スペイン	国債証券 —	95
	ベルギー	国債証券 —	74
	フィンランド	国債証券 190	—
		社債証券 —	98
	その他	国債証券 30	—
特殊債証券 —		37	
社債証券 405		733	
イギリス	千英ポンド	千英ポンド	
	国債証券 44	69	
社債証券 —	41		
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 573	—		
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	
	国債証券 110	110	
	地方債証券 225	366	
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 —	595		

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306期～第311期	
			買付額	売付額
外国	マレーシア	国債証券	千マレーシアリングgit -	千マレーシアリングgit 247
	タイ	国債証券	千タイバツ 1,593	千タイバツ 1,481
	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 691,683

(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306期～第311期			
		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	債券先物取引	百万円 818	百万円 877	百万円 1,171	百万円 1,119

(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。

直物為替先渡取引状況

種類別		第306期～第311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)	18	34	17	34
	(コロンビアペソ)	17	18	18	18
	(インドネシアルピア)	13	7	7	7
	(インドルピー)	-	125	-	125
	(韓国ウォン)	34	70	31	70
	(マレーシアリングgit)	6	-	-	-
	(ペルーソル)	17	8	16	8
	(新台幣ドル)	-	171	-	171

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2023年5月26日～2023年11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

(2023年11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311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	158,950 ( 8,100)	155,040 ( 8,104)	8.4 (0.4)	— (—)	2.8 (—)	5.2 (—)	0.4 (0.4)	
合 計	158,950 ( 8,100)	155,040 ( 8,104)	8.4 (0.4)	— (—)	2.8 (—)	5.2 (—)	0.4 (0.4)	

(注) ( )内は非上場債で内書きです。

(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) 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311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1196回国庫短期証券	—	8,100	8,104	2024/2/26
第161回利付国債(5年)	0.3	96,000	95,977	2028/6/20
第371回利付国債(10年)	0.4	5,750	5,568	2033/6/20
第62回利付国債(30年)	0.5	8,100	6,172	2049/3/20
第68回利付国債(30年)	0.6	2,250	1,724	2050/9/20
第158回利付国債(20年)	0.5	5,950	5,580	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	12,550	11,874	2036/12/20
第183回利付国債(20年)	1.4	20,250	20,038	2042/12/20
合 計		158,950	155,040	

(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311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 7,321	千米ドル 6,549	千円 979,296	% 52.9	% 0.0	% 34.3	% 17.2	% 1.4
カナダ	千カナダドル 934	千カナダドル 919	100,790	5.4	0.2	2.4	3.0	—
メキシコ	千メキシコペソ 1,087	千メキシコペソ 1,007	8,808	0.5	—	0.5	—	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	266	189	30,985	1.7	—	1.3	0.3	—
イタリア	260	258	42,202	2.3	—	2.3	—	—
フランス	485	452	74,019	4.0	—	1.4	2.6	—
オランダ	200	186	30,400	1.6	—	0.9	0.8	—
スペイン	111	109	17,889	1.0	—	1.0	—	—
ベルギー	56	45	7,412	0.4	—	0.4	—	—
オーストリア	459	378	61,908	3.3	—	3.3	—	—
フィンランド	248	236	38,652	2.1	—	2.1	—	—
その他	1,773	1,685	275,473	14.9	—	7.6	7.3	—
イギリス	千英ポンド 467	千英ポンド 359	67,660	3.7	—	2.7	0.9	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 435	千スウェーデンクローナ 575	8,219	0.4	—	0.1	0.3	—
オーストラリア	千オーストラリアドル 685	千オーストラリアドル 600	59,059	3.2	—	1.2	2.0	—
中国	千中国元 2,170	千中国元 2,251	47,092	2.5	—	1.2	1.4	—
合 計	—	—	1,849,870	99.9	0.2	62.7	35.8	1.4

(注) 邦貨換算金額は、第311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) —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	銘柄	利率	額面金額	第311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	2.25	242	225	33,692	2027/2/15	
	US TREASURY	0.5	163	140	21,024	2027/8/31	
	US TREASURY	1.25	325	283	42,322	2028/3/31	
	US TREASURY	2.875	180	167	25,101	2028/5/15	
	US TREASURY	3.625	213	205	30,727	2028/5/31	
	US TREASURY	1.125	642	370	55,360	2040/8/15	
	US TREASURY	1.75	23	14	2,231	2041/8/15	
	US TREASURY	3.0	9	6	1,007	2045/11/15	
	US TREASURY	1.25	262	125	18,810	2050/5/15	
	US TREASURY	2.0	128	75	11,278	2051/8/15	
	US TREASURY	4.125	60	55	8,321	2053/8/15	
	US TSY INFL IX N/B	0.125	402	422	63,227	2026/10/15	
	US TSY INFL IX N/B	1.375	298	279	41,850	2033/7/15	
	地方債証券	CMWLTH FING AUTH PA	4.144	5	4	655	2038/6/1
		CONNECTICUT ST-A-TXBL	4.648	10	9	1,414	2033/5/15
FLORIDA ST BRD OF ADM		2.154	20	16	2,442	2030/7/1	
NEW YORK ST THRUWAY AUTH		2.9	15	12	1,858	2035/1/1	
NJ ECON-SER A		7.425	14	14	2,207	2029/2/15	
NJ ST TRANSN-BAB-C		5.754	10	10	1,511	2028/12/15	
特殊債券 (除く金融債)	GNMAII 30 YR MA 8428	5.0	71	68	10,258	2052/11/20	
	GNMAII30YR TBA 4.5 DEC23	4.5	182	170	25,441	2053/12/1	
	GNMAII30YR TBA 5.0 DEC23	5.0	194	186	27,882	2053/12/1	
	GNMAII30YR TBA 5.5 DEC23	5.5	293	289	43,268	2053/12/1	
	GNMAII30YR TBA 6.0 DEC23	6.0	116	116	17,447	2053/12/1	
	UMBS 30YR TBA 3.5 DEC23	3.5	77	67	10,088	2053/12/1	
	UMBS 30YR TBA 4.0 DEC23	4.0	28	25	3,756	2053/12/1	
	UMBS 30YR TBA 4.5 DEC23	4.5	94	87	13,147	2053/12/1	
	UMBS 30YR TBA 5.5 DEC23	5.5	66	64	9,637	2053/12/1	
	UMBS 30YR TBA 6.0 DEC23	6.0	265	264	39,528	2053/12/1	
	UMBS 30YR TBA 6.5 DEC23	6.5	121	122	18,278	2053/12/1	
	普通社債券	AHT1 2018-ASHF A	6.395	74	72	10,876	2035/4/15
AIRCASTLE LTD		5.25	15	14	2,188	2025/8/11	
AIRCASTLE LTD		2.85	3	2	385	2028/1/26	
AMERISOURCE BERGEN CORP		2.7	7	5	868	2031/3/15	
AMGEN INC		5.15	32	31	4,753	2028/3/2	
AT&T INC		2.25	2	1	234	2032/2/1	
AT&T INC		5.4	9	8	1,312	2034/2/15	
AT&T INC		4.5	4	3	532	2035/5/15	
AUTOZONE INC		6.55	23	24	3,619	2033/11/1	
AVIATION CAPITAL GROUP		4.125	16	15	2,289	2025/8/1	
AVIATION CAPITAL GROUP		1.95	10	9	1,355	2026/1/30	
AVIATION CAPITAL GROUP		1.95	14	12	1,843	2026/9/20	
BANCO DE CREDITO DEL PER		3.125	45	41	6,227	2030/7/1	

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311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					
	BANK OF AMERICA CORP	3.559	60	56	8,490	2027/4/23
	BANK OF AMERICA CORP	3.846	23	19	2,861	2037/3/8
	BP CAP MARKETS AMERICA	4.893	15	14	2,155	2033/9/11
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5.75	24	24	3,681	2031/2/1
	BROADRIDGE FINANCIAL SOL	2.6	40	32	4,840	2031/5/1
	BVABS 2023-CAR3 A2	6.291	16	16	2,525	2032/7/26
	BX 2019-IMC A	6.3693	100	99	14,847	2034/4/15
	CAPITAL ONE FINANCIAL CO	5.88849	15	14	2,222	2024/12/6
	CAS 2014-C03 2M2	8.3351	2	3	450	2024/7/25
	CAS 2014-C04 2M2	10.4351	0.00349	0.00348	0.52	2024/11/25
	CAS 2016-C01 1M2	12.1851	6	7	1,096	2028/8/25
	CAS 2016-C01 2M2	12.3851	5	5	823	2028/8/25
	CAS 2016-C02 1M2	11.4351	13	14	2,174	2028/9/25
	CAS 2021-R01 1M1	6.07062	0.89396	0.89295	133	2041/10/25
	CAS 2021-R01 1M2	6.87062	10	10	1,563	2041/10/25
	CAS 2021-R03 1M1	6.17062	44	44	6,598	2041/12/25
	CAS 2021-R03 1M2	6.97062	100	98	14,766	2041/12/25
	CAS 2022-R01 1M2	7.22062	100	99	14,823	2041/12/25
	CAS 2022-R07 1M1	8.27064	11	11	1,710	2042/6/25
	CAS 2023-R02 1M1	7.62062	44	45	6,754	2043/1/25
	CBS CORP	5.5	20	17	2,679	2033/5/15
	CHARLES SCHWAB CORP	4.0	46	39	5,920	2099/12/1
	CHARTER COMM OPT LLC/CAP	5.375	20	15	2,370	2047/5/1
	CITIGROUP INC	6.717008	9	9	1,347	2025/5/24
	CITIGROUP INC	2.014	26	24	3,692	2026/1/25
	CNH INDUSTRIAL CAP LLC	5.5	34	33	5,007	2029/1/12
	CONTINENTAL RESOURCES	5.75	8	7	1,144	2031/1/15
	CONTINENTAL RESOURCES	2.875	35	27	4,046	2032/4/1
	COX COMMUNICATIONS INC	5.45	7	6	1,037	2028/9/15
	COX COMMUNICATIONS INC	1.8	37	28	4,277	2030/10/1
	COX COMMUNICATIONS INC	5.7	5	4	734	2033/6/15
	CVS HEALTH CORP	5.0	14	13	2,058	2029/1/30
	DELL INT LLC / EMC CORP	8.1	11	12	1,896	2036/7/15
	DEVON ENERGY CORP	7.875	10	11	1,648	2031/9/30
	DEVON ENERGY CORP	7.95	18	20	3,008	2032/4/15
	DLAA 2023-1A A2	5.93	14	14	2,094	2026/7/20
	ELEVANCE HEALTH INC	5.85	29	29	4,350	2036/1/15
	ERAC USA FINANCE LLC	4.6	13	12	1,877	2028/5/1
	ERAC USA FINANCE LLC	4.9	24	22	3,385	2033/5/1
	FCAT 2018-3 D	4.15	2	2	323	2024/12/16
	FISERV INC	5.625	37	36	5,480	2033/8/21
	FOX CORP	5.476	20	17	2,663	2039/1/25
	GILEAD SCIENCES INC	5.25	37	36	5,478	2033/10/15
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	6.608527	10	10	1,497	2024/3/15



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311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					
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	1.542	47	41	6,217	2027/9/10
	GRUPO TELEVISIVA SAB	8.5	22	24	3,704	2032/3/11
	HARLEY-DAVIDSON FINL SER	3.35	3	2	428	2025/6/8
	HARLEY-DAVIDSON FINL SER	3.05	27	24	3,622	2027/2/14
	HASBRO INC	3.55	44	40	6,096	2026/11/19
	HSBC HOLDINGS PLC	4.755	207	198	29,681	2028/6/9
	HUMANA INC	5.95	38	38	5,747	2034/3/15
	HYUNDAI CAPITAL AMERICA	1.8	20	16	2,531	2028/1/10
	HYUNDAI CAPITAL AMERICA	2.1	26	21	3,258	2028/9/15
	IHSFR 2018-SFR4 A	6.53748	85	85	12,774	2038/1/17
	INTERPUBLIC GROUP COS	5.375	23	21	3,278	2033/6/15
	JPMBB 2014-C21 B	4.3413	17	15	2,315	2047/8/15
	KYNDRYL HOLDINGS INC	2.05	26	23	3,451	2026/10/15
	LADAR 2023-2A A2	5.93	13	13	2,064	2027/6/15
	LEAR CORP	3.5	33	28	4,221	2030/5/30
	MARRIOTT INTERNATIONAL	2.85	10	8	1,227	2031/4/15
	MCKESSON CORP	4.9	15	14	2,203	2028/7/15
	MDC HOLDINGS INC	6.0	20	17	2,563	2043/1/15
	META PLATFORMS INC	4.65	11	9	1,383	2062/8/15
	NEW YORK LIFE GLOBAL FDG	5.6819	21	20	3,100	2026/6/9
	NIAGARA MOHAWK POWER	4.278	39	36	5,486	2028/12/15
	NIAGARA MOHAWK POWER	1.96	5	3	592	2030/6/27
	OMNICOM GROUP INC	2.45	14	11	1,733	2030/4/30
	ONEOK INC	6.35	20	20	3,048	2031/1/15
	ONEOK INC	6.1	5	5	750	2032/11/15
	ORACLE CORP	2.875	38	32	4,808	2031/3/25
	PNC FINANCIAL SERVICES	5.354	30	29	4,390	2028/12/2
	PULTE GROUP INC	7.875	33	36	5,521	2032/6/15
	ROSS STORES INC	1.875	35	27	4,058	2031/4/15
	RYDER SYSTEM INC	6.6	10	10	1,547	2033/12/1
	S&P GLOBAL INC	5.25	26	25	3,857	2033/9/15
	SANTANDER HOLDINGS USA	2.49	43	38	5,700	2028/1/6
	SANTANDER HOLDINGS USA	6.499	11	10	1,643	2029/3/9
	SANTANDER HOLDINGS USA	6.565	2	1	297	2029/6/12
	SBA TOWER TRUST	3.869	25	24	3,657	2049/10/15
	SBALT 2023-A A2	6.27	23	23	3,447	2026/4/20
	STACR 2021-DNA3 M2	7.42062	20	20	3,030	2033/10/25
	STACR 2021-DNA5 M2	6.97062	9	9	1,438	2034/1/25
	STACR 2021-HQA4 M1	6.27062	41	40	6,091	2041/12/25
	SUNCOR ENERGY INC	6.85	15	15	2,311	2039/6/1
	SURA ASSET MANAGEMENT	4.875	100	98	14,781	2024/4/17
	SUTTER HEALTH	5.164	9	8	1,302	2033/8/15
	SYNCHRONY FINANCIAL	3.95	10	8	1,331	2027/12/1
	SYNCHRONY FINANCIAL	2.875	22	16	2,413	2031/10/28

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311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	T-MOBILE USA INC	5.05	17	16	2,434	2033/7/15	
		T-MOBILE USA INC	5.75	14	14	2,097	2034/1/15	
		THOMSON REUTERS CORP	5.5	26	25	3,757	2035/8/15	
		US BANCORP	5.3	30	25	3,740	2099/10/15	
		VF CORP	2.95	28	22	3,337	2030/4/23	
小	計					979,296		
カナダ	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	3.5	261	256	28,159	2028/3/1	
		CANADIAN GOVERNMENT I/L	4.0	20	39	4,374	2031/12/1	
	地方債証券	PROVINCE OF QUEBEC	3.65	26	24	2,712	2032/5/20	
	特殊債券 (除く金融債)	CANADA HOUSING TRUST	3.95	85	84	9,266	2028/6/15	
	普通社債券	407 INTERNATIONAL INC	5.75	51	52	5,771	2036/2/14	
		BANK OF MONTREAL	3.19	39	36	3,989	2028/3/1	
		BELL CANADA	4.55	3	2	316	2030/2/9	
		BELL CANADA	3.0	5	4	470	2031/3/17	
		BELL CANADA	5.85	21	21	2,358	2032/11/10	
		BELL CANADA	5.15	27	25	2,758	2053/2/9	
		CU INC	5.183	35	35	3,860	2035/11/21	
		ELECTRICITE DE FRANCE SA	5.993	27	26	2,958	2030/5/23	
		ENBRIDGE INC	6.1	47	48	5,301	2032/11/9	
		ENBRIDGE PIPELINES INC	2.82	14	11	1,292	2031/5/12	
		METRO INC	4.657	37	35	3,883	2033/2/7	
		SAPUTO INC	2.297	41	36	3,969	2028/6/22	
		TELUS CORP	3.15	30	26	2,904	2030/2/19	
		TELUS CORP	5.25	26	25	2,780	2032/11/15	
		TORONTO-DOMINION BANK	1.896	63	54	5,984	2028/9/11	
	TRANSCANADA PIPELINES	5.33	26	25	2,789	2032/5/12		
VERIZON COMMUNICATIONS	2.375	50	44	4,888	2028/3/22			
小	計					100,790		
メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS	8.5	835	796	6,961	2029/5/31	
		MEXICAN BONOS	8.0	252	211	1,846	2047/11/7	
小	計					8,808		
ユーロ	ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	1.0	89	69	11,428	2038/5/15
		BUNDESREP. DEUTSCHLAND	—	79	38	6,286	2050/8/15	
		BUNDESREP. DEUTSCHLAND	1.8	54	43	7,137	2053/8/15	
	普通社債券	VOLKSWAGEN FIN SERV AG	0.875	43	37	6,133	2028/1/31	
	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	175	174	28,453	2031/10/30
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.4	45	45	7,449	2033/5/1	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	40	38	6,298	2035/4/30	
	フランス	国債証券	FRENCH TREASURY	2.5	85	72	11,803	2043/5/25
特殊債券 (除く金融債)		CAISSE FRANCAISE DE FIN	3.125	100	98	16,141	2027/11/16	

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311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	
フランス	普通社債券	CIE FINANCEMENT FONCIER	0.01	100	91	14,912	2026/7/15
		SNCF RESEAU	0.875	100	88	14,432	2029/1/22
		SUEZ	4.625	100	102	16,729	2028/11/3
オランダ	特殊債券 (除く金融債)	BNG BANK NV	—	100	86	14,071	2028/8/31
	普通社債券	ING GROEP NV	4.5	100	99	16,328	2029/5/23
スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	3.9	111	109	17,889	2039/7/30
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	1.45	31	24	4,075	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	25	20	3,336	2038/6/22
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	—	64	53	8,662	2030/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	140	112	18,318	2031/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.9	255	213	34,927	2032/2/20
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	2.875	192	190	31,191	2029/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	—	56	45	7,461	2030/9/15
その他	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT	5.0	38	38	6,279	2027/2/22
		POLAND GOVERNMENT	2.75	33	30	5,005	2032/5/25
		REPUBLIC OF INDONESIA	1.0	100	83	13,657	2029/7/28
		ROMANIA	6.625	25	25	4,233	2029/9/27
		UNITED MEXICAN STATES	3.375	134	124	20,282	2031/2/23
	地方債証券	JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	0.01	100	86	14,165	2028/2/2
		PROVINCE OF QUEBEC	0.875	100	91	15,030	2027/5/4
	特殊債券 (除く金融債)	DEVELOPMENT BK OF JAPAN	3.125	100	98	16,138	2028/4/13
		EXPORT DEVELOPMNT CANADA	0.5	100	91	14,978	2027/2/25
		INTL BK RECON & DEVELOP	0.01	43	37	6,135	2028/4/24
	普通社債券	ALTRIA GROUP INC	3.125	100	86	14,072	2031/6/15
		BOOKING HOLDINGS INC	4.75	100	104	17,122	2034/11/15
		CARGILL INC	3.875	100	99	16,288	2030/4/24
		COMMONWEALTH BANK AUSTRA	3.768	100	100	16,398	2027/8/31
		CREDIT SUISSE AG LONDON	0.25	100	91	15,004	2026/1/5
HONEYWELL INTERNATIONAL		4.125	100	99	16,177	2034/11/2	
JPMORGAN CHASE & CO		4.457	100	101	16,511	2031/11/13	
MORGAN STANLEY		4.656	100	101	16,523	2029/3/2	
ROYAL BANK OF CANADA		0.625	100	93	15,243	2026/3/23	
SUMITOMO MITSUI TR BK LT		3.629	100	99	16,223	2026/4/6	
小計					578,944		
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
国債証券	UK TREASURY	0.125	83	70	13,197	2028/1/31	
	UK TREASURY	3.25	36	33	6,399	2033/1/31	
	UK TREASURY	3.75	23	21	4,077	2038/1/29	
	UK TREASURY	1.25	28	16	3,142	2041/10/22	
	UK TREASURY	4.75	24	24	4,654	2043/10/22	
	UK TREASURY	0.875	91	43	8,130	2046/1/31	
	UK TREASURY	1.25	11	5	1,032	2051/7/31	
	UK TREASURY	1.5	52	25	4,888	2053/7/31	

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311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		
	普通社債券	ANGLIAN WATER SERV FIN	6.293	30	30	5,811	2030/7/30
		ELECTRICITE DE FRANCE SA	5.875	15	14	2,822	2031/7/18
		HEATHROW FUNDING LTD	6.45	50	52	9,800	2031/12/10
		THAMES WATER UTIL FIN	6.75	20	19	3,702	2028/11/16
小	計					67,660	
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	75	94	1,348	2026/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT I/L	0.150585	285	348	4,981	2027/12/1
		SWEDISH GOVERNMENT I/L	5.235125	75	132	1,889	2028/12/1
小	計					8,219	
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	214	164	16,218	2033/3/8
		TREASURY CORP VICTORIA	2.25	85	65	6,458	2033/9/15
	特殊債券 (除く金融債)	BNG BANK NV	3.5	101	96	9,468	2027/7/19
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1.8	25	22	2,248	2027/1/19
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	0.75	35	30	2,982	2027/7/15
		INTER-AMERICAN DEVEL BK	4.25	33	32	3,208	2026/6/11
		INTL BK RECON & DEVELOP	3.0	18	17	1,689	2026/10/19
		INTL FINANCE CORP	4.45	48	47	4,675	2027/5/14
		KFW	4.1	96	94	9,315	2026/2/20
	普通社債券	VODAFONE GROUP PLC	4.2	30	28	2,792	2027/12/13
小	計					59,059	
中国				千中国元	千中国元		
	国債証券	CHINA GOVERNMENT	3.01	1,200	1,223	25,589	2028/5/13
		CHINA GOVERNMENT	3.39	970	1,028	21,503	2050/3/16
小	計					47,092	
合	計					1,849,870	

(注) 邦貨換算金額は、第311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。ただし、金額が単位未満の場合は小数で記載。

※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311期末	
			買 建 額	売 建 額
外          国	債券先物取引	10 ULTRA FUT	百万円 —	百万円 33
		5YR T-NOTES	47	—
		SFE 10YR TBO	43	—
		SFE 3YR TBON	—	113
		CAN10YR BOND	12	—
		EUR-BOBL	—	57
		EUR-SCHATZ	—	120
		3YR KTB	130	—
		LONG GILT	18	—
		EURO-OAT	—	40

(注) 邦貨換算金額は、第311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) 一印は該当なし。

直物為替先渡取引残高

銘 柄 別		取引契約残高			
		第311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)	8	1	—	—	
(コロンビアペソ)	13	2	—	—	
(インドネシアルピア)	67	10	—	—	
(韓国ウォン)	119	17	—	—	
(マレーシアリンギット)	44	6	—	—	
(ペルーソル)	61	9	55	8	

(注) 邦貨換算金額は、第311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) 一印は該当なし。

## ○投資信託財産の構成

(2023年11月27日現在)

項 目	第311期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 2,004,910	% 95.5
コール・ローン等、その他	94,795	4.5
投資信託財産総額	2,099,705	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注) 第311期末における外貨建純資産 (1,692,236千円) の投資信託財産総額 (2,099,705千円) に対する比率は80.6%です。

(注) 外貨建資産は、第311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=149.52円、1カナダドル=109.62円、1メキシコペソ=8.7392円、1ユーロ=163.41円、1英ポンド=188.35円、1スウェーデンクローナ=14.28円、1オーストラリアドル=98.35円、1中国元=20.916円、100韓国ウォン=11.48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5月26日から2023年11月27日までの間で直物為替先渡取引（以下「NDF」といいます。）38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306期末	第307期末	第308期末	第309期末	第310期末	第311期末
	2023年6月26日現在	2023年7月25日現在	2023年8月25日現在	2023年9月25日現在	2023年10月25日現在	2023年11月27日現在
	円	円	円	円	円	円
<b>(A) 資産</b>	<b>3,877,733,761</b>	<b>3,635,841,643</b>	<b>2,889,631,362</b>	<b>2,965,300,590</b>	<b>2,935,702,080</b>	<b>3,035,238,184</b>
コール・ローン等	21,548,724	38,535,520	37,131,965	30,871,782	38,234,155	39,443,259
公社債(評価額)	1,986,334,883	1,913,536,076	1,982,903,167	1,989,870,555	1,947,846,322	2,004,910,880
未収入金	1,844,385,174	1,655,060,566	844,103,427	917,662,163	922,247,443	964,522,418
未収利息	10,849,212	11,999,275	11,823,510	13,528,690	13,799,487	12,591,438
前払費用	2,560,041	2,664,324	1,943,833	2,056,787	2,538,143	1,576,462
その他未収収益	429,330	676,791	898,130	1,138,964	1,379,764	1,603,247
差入委託証拠金	11,626,397	13,369,091	10,827,330	10,171,649	9,656,766	10,590,480
<b>(B) 負債</b>	<b>2,011,285,951</b>	<b>1,788,530,530</b>	<b>1,052,167,110</b>	<b>1,137,844,656</b>	<b>1,131,975,358</b>	<b>1,182,929,835</b>
未払金	2,007,667,382	1,785,149,041	1,046,044,578	1,134,316,822	1,128,574,704	1,179,034,231
未払収益分配金	872,392	870,200	862,446	855,820	854,210	847,866
未払解約金	—	—	2,587,692	—	—	199,999
未払信託報酬	2,722,092	2,489,271	2,649,201	2,648,825	2,523,955	2,823,059
未払利息	53	88	36	32	79	29
その他未払費用	24,032	21,930	23,157	23,157	22,410	24,651
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>1,866,447,810</b>	<b>1,847,311,113</b>	<b>1,837,464,252</b>	<b>1,827,455,934</b>	<b>1,803,726,722</b>	<b>1,852,308,349</b>
元本	2,907,975,748	2,900,668,343	2,874,821,886	2,852,735,795	2,847,367,836	2,826,221,353
次期繰越損益金	△1,041,527,938	△1,053,357,230	△1,037,357,634	△1,025,279,861	△1,043,641,114	△ 973,913,004
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>2,907,975,748口</b>	<b>2,900,668,343口</b>	<b>2,874,821,886口</b>	<b>2,852,735,795口</b>	<b>2,847,367,836口</b>	<b>2,826,221,353口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	6,418円	6,369円	6,392円	6,406円	6,335円	6,554円

(注) 第306期首元本額2,922,715,202円、第306～311期中追加設定元本額3,760,926円、第306～311期中一部解約元本額100,254,775円。第311期末現在における1口当たり純資産額0.6554円。

(注) 第311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△973,913,004円です。

○損益の状況

項 目	第306期	第307期	第308期	第309期	第310期	第311期
	2023年5月26日～ 2023年6月26日	2023年6月27日～ 2023年7月25日	2023年7月26日～ 2023年8月25日	2023年8月26日～ 2023年9月25日	2023年9月26日～ 2023年10月25日	2023年10月26日～ 2023年11月27日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	5,022,694	4,628,185	4,903,449	4,949,525	4,871,341	5,183,027
受取利息	4,778,052	4,343,083	4,654,396	4,677,841	4,582,451	4,922,374
その他収益金	246,876	286,771	251,560	272,863	291,429	262,938
支払利息	△ 2,234	△ 1,669	△ 2,507	△ 1,179	△ 2,539	△ 2,285
(B) 有価証券売買損益	56,724,543	△ 16,022,533	9,009,613	1,040,452	△ 19,376,615	56,453,539
売買益	130,781,057	41,840,213	75,747,993	32,734,380	24,990,305	75,380,432
売買損	△ 74,056,514	△ 57,862,746	△ 66,738,380	△ 31,693,928	△ 44,366,920	△ 18,926,893
(C) 先物取引等取引損益	△ 1,390,967	507,124	△ 3,595,923	1,774,544	△ 2,300,485	4,164,745
取引益	4,531,877	2,790,116	855,117	4,716,215	978,289	7,580,296
取引損	△ 5,922,844	△ 2,282,992	△ 4,451,040	△ 2,941,671	△ 3,278,774	△ 3,415,551
(D) 信託報酬等	△ 2,908,127	△ 2,688,931	△ 2,840,752	△ 2,801,375	△ 2,630,431	△ 2,975,565
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	57,448,143	△ 13,576,155	7,476,387	4,963,146	△ 19,436,190	62,825,746
(F) 前期繰越損益金	△ 169,482,067	△ 112,599,330	△ 125,887,390	△ 118,326,323	△ 113,980,507	△ 133,245,859
(G) 追加信託差損益金	△ 928,621,622	△ 926,311,545	△ 918,084,185	△ 911,060,864	△ 909,370,207	△ 902,645,025
(配当等相当額)	( 3,683,923)	( 3,689,833)	( 3,672,360)	( 3,663,935)	( 3,673,171)	( 3,662,404)
(売買損益相当額)	(△ 932,305,545)	(△ 930,001,378)	(△ 921,756,545)	(△ 914,724,799)	(△ 913,043,378)	(△ 906,307,429)
(H) 計(E+F+G)	△ 1,040,655,546	△ 1,052,487,030	△ 1,036,495,188	△ 1,024,424,041	△ 1,042,786,904	△ 973,065,138
(I) 収益分配金	△ 872,392	△ 870,200	△ 862,446	△ 855,820	△ 854,210	△ 847,866
次期繰越損益金(H+I)	△ 1,041,527,938	△ 1,053,357,230	△ 1,037,357,634	△ 1,025,279,861	△ 1,043,641,114	△ 973,913,006
追加信託差損益金	△ 928,621,622	△ 926,311,545	△ 918,084,185	△ 911,060,864	△ 909,370,207	△ 902,645,025
(配当等相当額)	( 3,683,923)	( 3,689,833)	( 3,672,360)	( 3,663,935)	( 3,673,171)	( 3,662,404)
(売買損益相当額)	(△ 932,305,545)	(△ 930,001,378)	(△ 921,756,545)	(△ 914,724,799)	(△ 913,043,378)	(△ 906,307,429)
分配準備積立金	73,558,228	74,427,281	76,439,511	78,140,350	79,363,893	82,858,701
繰越損益金	△ 186,464,544	△ 201,472,966	△ 195,712,960	△ 192,359,347	△ 213,634,800	△ 154,126,680

(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306期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (4,780,738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 (3,683,923円) および分配準備積立金額 (69,649,882円) より分配対象収益額は78,114,543円 (10,000口当たり268円) であり、うち872,392円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

\* 第307期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (1,939,254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 (3,689,833円) および分配準備積立金額 (73,358,227円) より分配対象収益額は78,987,314円 (10,000口当たり272円) であり、うち870,200円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

\* 第308期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (3,553,240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 (3,672,360円) および分配準備積立金額 (73,748,717円) より分配対象収益額は80,974,317円 (10,000口当たり281円) であり、うち862,446円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

\* 第309期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (3,163,648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 (3,663,935円) および分配準備積立金額 (75,832,522円) より分配対象収益額は82,660,105円 (10,000口当たり289円) であり、うち855,820円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

\* 第310期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (2,240,910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 (3,673,171円) および分配準備積立金額 (77,977,193円) より分配対象収益額は83,891,274円 (10,000口当たり294円) であり、うち854,210円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

\* 第311期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (4,948,552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 (3,662,404円) および分配準備積立金額 (78,758,015円) より分配対象収益額は87,368,971円 (10,000口当たり309円) であり、うち847,866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306期	第307期	第308期	第309期	第310期	第311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。