



ALLIANCEBERNSTEIN®

運用報告書(全体版)

AB米国不動産好利回り債券ファンド(為替ヘッジなし)

愛称：イーグル・ハウス

追加型投信／内外／債券

第9期(決算日2023年5月15日)

●受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあすかり厚くお礼申し上げます。

さて、「AB米国不動産好利回り債券ファンド(為替ヘッジなし)」は、このたび第9期の決算を行いました。ここに、当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。

●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	2023年11月15日まで(信託設定日：2018年11月30日)	
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ AB FCP I -モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ(為替ヘッジなし)(以下、主要投資対象ファンドといえます。)への投資を通じて、米国の不動産関連債券*等を中心に投資し機動的に資産配分を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。 ・ *当ファンドにおいて「不動産関連債券」とは、住宅ローン担保証券(RMBS)や商業用不動産担保証券(CMBS)等、一般に不動産担保融資債権(住宅ローン等)を裏づけとして発行された債券のことをいいます。また、資産担保証券(ABS)、債務担保証券(CDO)、金融デリバティブ商品などにも投資します。 ・ 主要投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。 ・ 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 	
主要運用対象	AB米国不動産好利回り債券ファンド(為替ヘッジなし) AB FCP I -モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ(為替ヘッジなし) アライアンス・バーンスタイン・日本債券インテックス・マザーファンド	ルクセンブルグ籍円建外国投資信託「AB FCP I -モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ(為替ヘッジなし)」を主要投資対象とします。このほか、「アライアンス・バーンスタイン・日本債券インテックス・マザーファンド」の受益証券にも投資を行います。なお、短期有価証券および短期金融商品等に直接投資する場合があります。 米ドル建てのモーゲージ関連証券や資産担保証券等。 主としてわが国の国債および国内外の主要取引所に上場する債券先物に投資。
組入制限	AB米国不動産好利回り債券ファンド(為替ヘッジなし) AB FCP I -モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ(為替ヘッジなし) アライアンス・バーンスタイン・日本債券インテックス・マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> ・ 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ・ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ・ 株式への直接投資は行いません。 ・ 流動性の低い資産への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。 ・ ファンドの借入総額は、純資産総額の10%を上限とします。 ・ 株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ・ 外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎決算時(毎年5月15日および11月15日。休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 <ul style="list-style-type: none"> ・ 分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当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。 ・ 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。 ・ 留利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。 	

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>

当ファンドは、2023年11月15日に信託期間が終了し、償還を迎える予定です。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額		債権組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率	純資産総額
		税金	達配				
	円	円	円	%	%	%	百万円
5期(2021年5月17日)	9,914		0	8.5	0.1	99.0	13
6期(2021年11月15日)	10,424		0	5.1	0.1	98.8	14
7期(2022年5月16日)	11,379		0	9.2	0.0	98.6	17
8期(2022年11月15日)	11,993		0	5.4	0.1	95.5	8
9期(2023年5月15日)	12,433		0	3.7	0.2	102.5	4

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	標準価額		債権組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率
		騰落	騰落率			
	円	円	%	%	%	%
(期首) 2022年11月15日	11,993		—	0.1	0.1	95.5
11月末	12,011		0.2	0.1	0.2	70.9
12月末	11,714		△2.3	0.2	0.3	96.6
2023年1月末	11,731		△2.2	0.2	0.3	93.8
2月末	12,351		3.0	0.2	0.3	97.1
3月末	11,972		△0.2	0.2	0.3	95.2
4月末	12,277		2.4	0.2	0.3	97.1
(期末) 2023年5月15日	12,433		3.7	0.2	0.2	102.5

(注) 各騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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。

※ベンチマークおよび参考指数について
当ファンドの運用方針と類似した適切な指標が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

運用経過

AB米国不動産好利回り債券ファンド（為替ヘッジなし）（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。

期中の基準価額等の推移

（2022年11月16日～2023年5月15日）



期首：11,993円

期末：12,433円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率： 3.7%（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は、期首（2022年11月15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。

○基準価額等の推移

当ファンドの基準価額（分配金（税込み）再投資）は前期末比で上昇しました。

○基準価額の主な変動要因

ルクセンブルグ籍円建外国投資信託「AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1 シェアーズ（為替ヘッジなし）」への投資を通じて、住宅ローン等を裏づけとして発行された米国の不動産関連債券を中心に投資を行います。当期における基準価額の主な変動要因は、次のとおりです。

上昇要因：保有している信用リスク移転証券（クレジット・リスク・トランスファー証券、CRT）やローン担保証券（CLO）の価格上昇

下落要因：円高米ドル安の進行

投資環境

（2022年11月16日～2023年5月15日）

【債券市場】

当期の債券市場では、米国国債金利は、2023年3月上旬にかけて米連邦準備理事会（FRB）の利上げ停止時期をめぐる思惑に左右される展開となりました。3月中旬にシリコンバレー銀行の経営破綻やクレディ・スイスの経営不安を受け金融不安が高まると、金利は低下（価格は上昇）しました。その後過度な金融不安が和らぐと金利はやや上昇（価格は下落）しました。

証券化商品市場はおおむね上昇基調で推移しました。

【外国為替】

当期の米ドル円相場は、円高米ドル安となりました。2023年1月半ばにかけては米国長期金利の低下や、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で推移しました。その後3月上旬にかけては、米国長期金利の上昇を受け米ドルが上昇したものの、欧米の金融不安が広がると再び円高米ドル安となりました。3月末以降は金融不安が和らいだことや、日銀が緩和政策を維持したことから円安米ドル高となりました。

運用概況

（2022年11月16日～2023年5月15日）

【当ファンド】

当ファンドは、ルクセンブルグ籍円建外国投資信託「AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1 シェアーズ（為替ヘッジなし）」を主要投資対象とし、投資割合はおおむね90%以上を維持しました。

また、「アライアンス・バーンスタイン・日本債券インデックス・マザーファンド」にも投資を行いました。

【AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1 シェアーズ（為替ヘッジなし）】

主として、住宅ローン等を裏づけとして発行された米国の不動産関連債券を中心に投資を行い、機動的に資産配分を行うことで、中長期的な成長を享受することを目指しました。

期を通じて、ファンダメンタルズが良好な信用リスク移転証券（クレジット・リスク・トランスファー証券、CRT）を選好しました。

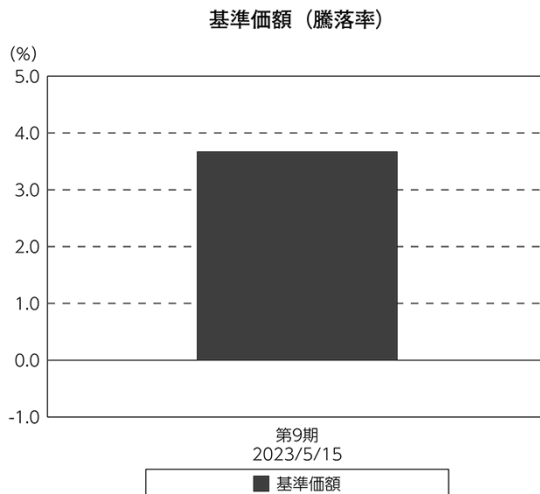
【アライアンス・バーンスタイン・日本債券インデックス・マザーファンド】

主としてわが国の国債および国内外の主要取引所に上場する債券先物に投資することにより、信託財産の成長を図ることを目標とし、日本国債の長期国債先物への投資を行いました。

当ファンドのベンチマークとの差異

（2022年11月16日～2023年5月15日）

当ファンドはベンチマークおよび参考指数を設けておりません。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

（2022年11月16日～2023年5月15日）

当期の収益分配は、長期的な信託財産の成長を目指す観点から、見送ることとしました。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9期
	2022年11月16日～ 2023年5月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,432

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の当期末基準価額（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

【当ファンド】

ルクセンブルグ籍円建外国投資証券「AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1 シェアーズ（為替ヘッジなし）」を主要投資対象とし、投資割合は高位を維持します。

【AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1 シェアーズ（為替ヘッジなし）】

米国の住宅市場は、ミレニアル世代の住宅購入や在宅勤務などによる需要はあるものの、住宅価格と住宅ローン金利の上昇を受けて需要が緩やかに低下することで、在庫は徐々に積み上がっていきとみています。住宅価格の変動は、地域や価格帯によって大きく異なる可能性があり、住宅市場は依然低迷しているものの、30年固定型住宅ローン金利がわずかに低下したことで安定の兆しも出てきています。

パンデミック時に、住宅ローンの借り手を評価する基準はさらに厳しくなり、最近発行されたCRTは、より厳しい信用環境の下で組成された住宅ローンを参照しているため、以前にも増してCRTのファンダメンタルズは良好であるとみています。

引き続き、米国の不動産関連債券を中心に投資を行い、機動的な資産配分を通じて、金利上昇などリスクに対応しつつ高い利回りと安定したリターンを獲得をめざします。

【アライアンス・バーンスタイン・日本債券インデックス・マザーファンド】

引き続き、主としてわが国の国債および国内外の主要取引所に上場する債券先物に投資を行います。

※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

（2022年11月16日～2023年5月15日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	41	0.341	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(3)	(0.027)	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 ）	(36)	(0.300)	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)	(0.014)	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	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.000)	売買委託手数料は、組入金融商品等の売買の際に売買仲介人に支払う手数料
(c) そ の 他 費 用	6	0.052	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ そ の 他 ）	(6)	(0.052)	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	47	0.393	
期中の平均基準価額は、12,009円です。			

(注) 期中の費用（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) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）が支払った費用を含みません。

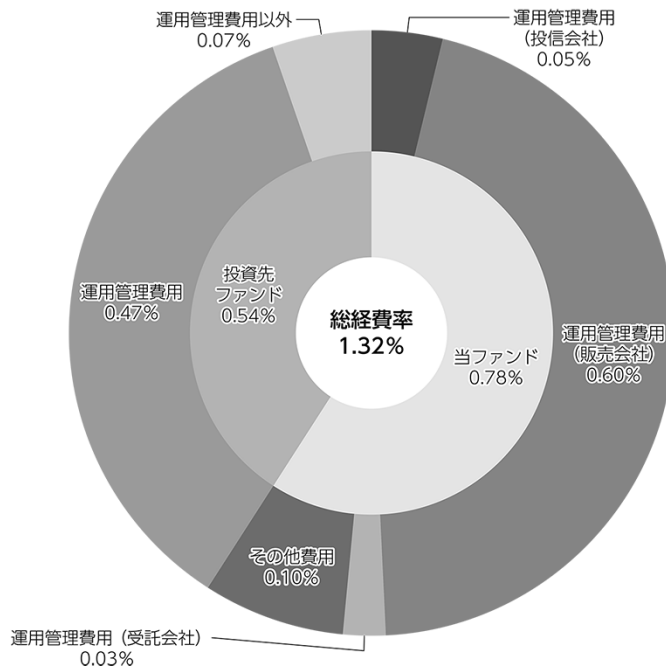
(注) 組入投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入ファンドの概要」に表示することとしております。

(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）を期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

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.32%です。



(単位:%)

総経費率(①+②+③)	1.32
①当ファンドの費用の比率	0.78
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.47
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.07

(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) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(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16日～2023年5月15日）

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ（為替ヘッジなし）	口 272	千円 3,430	口 555	千円 6,960

（注）金額は受け渡し代金。

（注）金額の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16日～2023年5月15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15日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		
		口数	口数	評価額	比率
		口	口	千円	%
	AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ（為替ヘッジなし）	618	334	4,344	102.5
	合 計	618	334	4,344	102.5

（注）評価額の単位未満は切り捨て。

（注）比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

親投資信託残高

銘柄		期首(前期末)	当 期 末	
		口数	口数	評価額
		千口	千口	千円
	アライアンス・バーンスタイン・日本債券インデックス・マザーファンド	8	8	10

（注）単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

（2023年5月15日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 4,344	% 93.7
アライアンス・バーンスタイン・日本債券インデックス・マザーファンド	10	0.2
コール・ローン等、その他	284	6.1
投資信託財産総額	4,638	100.0

（注）評価額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年5月15日現在）

○損益の状況（2022年11月16日～2023年5月15日）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,638,854
コール・ローン等	284,120
投資信託受益証券(評価額)	4,344,714
アライアンス・バーンスタイン・ 日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	10,020
(B) 負債	399,819
未払金	370,000
未払解約金	14,406
未払信託報酬	13,500
その他未払費用	1,913
(C) 純資産総額(A－B)	4,239,035
元本	3,409,639
次期繰越損益金	829,396
(D) 受益権総口数	3,409,639口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,433円

（注）期首元本額6,739,093円、期中追加設定元本額2,492,779円、期中一部解約元本額5,822,233円。当期末現在における1口当たり純資産額1,2433円。

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 77
支払利息	△ 77
(B) 有価証券売買損益	138,050
売買益	190,843
売買損	△ 52,793
(C) 信託報酬等	△ 15,413
(D) 当期損益金(A+B+C)	122,560
(E) 前期繰越損益金	△ 35,417
(F) 追加信託差損益金	742,253
(配当等相当額)	(531,807)
(売買損益相当額)	(210,446)
(G) 計(D+E+F)	829,396
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	829,396
追加信託差損益金	742,253
(配当等相当額)	(531,807)
(売買損益相当額)	(210,446)
分配準備積立金	87,220
繰越損益金	△ 77

（注）損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

（注）損益の状況の中で(C)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）損益の状況の中で(F)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）第9期計算期間末における費用控除後の配当等収益額(0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(56,337円)、収益調整金額(742,176円)および分配準備積立金額(30,883円)より分配対象収益額は829,396円(10,000口当たり2,432円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	0円
-----------------	----

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2023年5月15日現在）

<アライアンス・バーンスタイン・日本債券インデックス・マザーファンド>

下記は、アライアンス・バーンスタイン・日本債券インデックス・マザーファンド全体（114,479,481千口）の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 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	106,900,000 (106,900,000)	106,929,458 (106,929,458)	77.9 (77.9)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	77.9 (77.9)
合 計	106,900,000 (106,900,000)	106,929,458 (106,929,458)	77.9 (77.9)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	77.9 (77.9)

(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) 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。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 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1088回国庫短期証券	—	36,700,000	36,706,312	2023/6/20
第1095回国庫短期証券	—	36,100,000	36,111,552	2023/7/20
第1151回国庫短期証券	—	34,100,000	34,111,594	2023/7/24
合 計		106,900,000	106,929,458	

(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			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国 内	債券先物取引	10年国債標準物	百万円 136,952	百万円 —

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) 一印は該当なし。

AB FCP I -モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ(為替ヘッジなし)

2022年8月31日決算

(計算期間：2021年9月1日～2022年8月31日)

形 態	ルクセンブルグ籍円建外国投資信託
投 資 目 的	ファンドは、高いリスク調整後トータル・リターン ^① の獲得を目指します。
主 要 投 資 対 象	米ドル建てのモーゲージ関連証券や資産担保証券等
運 用 の 基 本 方 針	<p>①ファンドは、主として、変動利付証券を含めた、米ドル建てのモーゲージ証券(MBS)、資産担保証券(ABS)、商業用不動産ローン担保証券(CMS)、債務担保証券(CDO)等を中心に投資を行い、機動的に資産配分を行うことで、投資目的の達成を目指します。</p> <p>②モーゲージ関連証券への投資割合は、資産総額の3分の2以上とします。</p> <p>③通常の市場環境下では、取得時において、投資適格級以上が付与されている資産[*]への投資割合を純資産総額の50%以上とします。</p> <p>④通常の市場環境下では、ポートフォリオ構築において、加重平均実効デュレーションは8年以下とします。</p> <p>⑤非米ドル建て資産への投資は、純資産額の5%を上限とします。</p> <p>⑥金融デリバティブ商品(金利スワップ、トータル・リターン・スワップ、クレジット・デフォルト・スワップ等)への投資は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>[*]S&PまたはムーディーズのいずれかからBBB-またはBaa3以上(各格付会社から異なる格付が付与されている場合は、下位の格付による)が付与されている証券</p>
ベンチマーク	ありません。
主 な 投 資 制 限	<p>①流動性の低い資産への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。</p> <p>②ファンドの借り入れ総額は、純資産総額の10%を上限とします。</p>
決 算 日	年1回決算(8月31日)
分 配 方 針	原則として、分配を行いません。
投 資 顧 問 会 社	アライアンス・バーンスタイン・エル・ピー

*作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

「AB米国不動産好利回り債券ファンド (為替ヘッジなし)」が投資している「AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1 シェアーズ (為替ヘッジなし)」は、「AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ」のシェアクラスの1つです。

以下は「AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ」の直近の決算日である2022年8月31日現在の財務書類を、アライアンス・バーンスタイン株式会社において抜粋・翻訳したものでありますが、あくまで参考和訳であり、正確性を保証するものではありません。

財務書類に含まれる「投資明細表」については、原文どおり英語表記で記載しております。また同ファンドの財務書類は現地での法律に基づいて監査を受けております。

(1) 貸借対照表 (2022年8月31日現在)

	MORTGAGE INCOME PORTFOLIO (USD)
資 産	
投資有価証券一時価	\$ 800,380,237
投資有価証券売却未収金	1,070,191
定期預金	34,708,221
未収配当金および未収利息	4,766,611
先物為替予約未実現評価益	3,593
保管受託銀行およびブローカー預託金	8,611,630
ファンド証券売却未収金	777,223
スワップ契約の前払プレミアム	-0-
スワップに係る未収利息	298,510
スワップ未実現評価益	804,963
金融先物契約未実現評価益	-0-
貸付証券収益の未収金	-0-
その他未収金	52,585
	851,473,764
負 債	
投資有価証券購入未払金	6,225,900
スワップ未実現評価損	3,938,736
先物為替予約未実現評価損	1,569,722
スワップ契約の前受プレミアム	2,518,357
未払分配金	2,141,606
保管受託銀行およびブローカーへの未払金	1,825,181
ファンド証券買戻未払金	1,529,030
金融先物契約未実現評価損	-0-
スワップに係る未払利息	540,275
売建オプション一時価	321,300
未払費用その他債務	1,150,361
	21,760,468
純資産額	\$ 829,713,296

(2) 損益計算書 (2021年9月1日～2022年8月31日)

	MORTGAGE INCOME PORTFOLIO (USD)
投資収益	
利息	\$ 83,138,392
スワップ収益	1,741,104
配当金、純額	-0-
貸付証券収益、純額	-0-
	84,879,496
費用	
管理報酬	8,713,870
スワップに係る費用	564,370
管理会社報酬	413,629
名義書換代行報酬	400,992
税金	395,900
販売報酬	1,865
専門家報酬	312,141
保管報酬	178,449
会計および管理事務代行報酬	136,890
印刷費	10,931
その他	138,582
	11,267,619
費用払戻または権利放棄	(1,977)
純費用	11,265,642
投資純 (損) 益	73,613,854
実現 (損) 益	
投資有価証券、先物為替予約、スワップ、金融先物契約、 オプションおよび通貨	(66,940,168)
源泉税	-0-
未実現利益(損)益の変動	
投資有価証券	(43,994,147)
金融先物契約	-0-
先物為替予約	(2,382,470)
スワップ	5,753,275
売建オプション	(44,715)
運用実績	(33,994,371)
ファンド証券取引	
増 (減) 額	(595,593,445)
分配金	(34,471,801)
純資産額	
期首	1,493,772,913
通貨換算調整	-0-
期末	\$ 829,713,296

(3) 投資明細表 (2022年8月31日現在)

	Rate	Date	Principal (000)	Value (USD)	Net Assets %
TRANSFERABLE SECURITIES QUOTED ON A STOCK EXCHANGE OR DEALT IN ON ANOTHER REGULATED MARKET					
COLLATERALIZED MORTGAGE OBLIGATIONS					
RISK SHARE FLOATING RATE					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2021-1A, Class MIC(a)	5.13%	03/25/2031	USD 3,000	\$ 2,940,730	0.4%
Series 2021-1A, Class M2(a)	7.03%	03/25/2031	1,000	970,462	0.1
Series 2022-1, Class M2(a)	6.78%	01/26/2032	500	480,760	0.1
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2018-R07, Class 1B1(a)	6.79%	04/25/2031	2,000	1,991,177	0.2
Series 2019-R04, Class 2B1(a)	7.51%	06/25/2039	2,697	2,767,334	0.3
Series 2019-R06, Class 2B1(a)	6.19%	09/25/2039	3,500	3,432,333	0.4
Series 2020-R02, Class 2B1(a)	5.44%	01/25/2040	4,000	3,736,720	0.5
Series 2020-SBT1, Class 1B1(a)	9.19%	02/25/2040	1,000	943,218	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2B1(a)	9.04%	02/25/2040	1,000	903,262	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2M2(a)	6.09%	02/25/2040	2,840	2,875,139	0.3
Series 2021-R01, Class 1B2(a)	8.16%	10/25/2041	500	465,542	0.1
Series 2022-R01, Class 1B2(a)	8.18%	12/25/2041	2,500	2,229,091	0.3
Series 2022-R01, Class 1M2(a)	4.08%	12/25/2041	7,215	6,898,424	0.8
Series 2022-R02, Class 2B1(a)	6.68%	01/25/2042	2,000	1,894,997	0.2
Series 2022-R02, Class 2B2(a)	9.83%	01/25/2042	1,000	947,606	0.1
Series 2022-R05, Class 2B2(a)	9.18%	04/25/2042	2,000	1,977,291	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Series 2018-HQA2, Class B2(a)	13.44%	10/25/2048	7,550	8,427,842	1.0
Series 2019-DNA4, Class B2(a)	8.69%	10/25/2049	3,850	3,742,105	0.5
Series 2019-HQA2, Class B2(a)	13.69%	04/25/2049	1,900	2,073,837	0.3
Series 2019-HQA3, Class B2(a)	9.94%	09/25/2049	5,650	5,622,669	0.7
Series 2020-DNA1, Class B2(a)	7.69%	01/25/2050	7,500	6,907,254	0.8
Series 2020-DNA2, Class B2(a)	7.24%	02/25/2050	8,651	7,648,106	0.9
Series 2020-DNA5, Class B2(a)	13.68%	10/25/2050	3,000	3,595,791	0.4
Series 2020-HQA1, Class B2(a)	7.54%	01/25/2050	6,000	5,377,057	0.7
Series 2020-HQA2, Class B2(a)	10.04%	03/25/2050	6,000	5,899,006	0.7
Series 2020-HQA3, Class M2(a)	6.04%	07/25/2050	1	942	0.0
Series 2021-DNA1, Class B1(a)	4.83%	01/25/2051	4,400	4,080,824	0.5
Series 2021-DNA1, Class B2(a)	6.93%	01/25/2051	2,000	1,674,915	0.2
Series 2021-DNA3, Class B2(a)	8.43%	10/25/2033	1,000	912,265	0.1
Series 2021-DNA5, Class B1(a)	5.23%	01/25/2034	4,000	3,691,395	0.4
Series 2021-DNA5, Class B2(a)	7.68%	01/25/2034	3,000	2,567,777	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency					
Credit Risk Debt Notes					
Series 2015-DNA1, Class B(a)	11.64%	10/25/2027	7,247	7,416,947	0.9
Series 2015-DNA1, Class M3(a)	5.74%	10/25/2027	1,533	1,555,022	0.2
Series 2015-DNA2, Class B(a)	9.99%	12/25/2027	7,297	7,497,529	0.9
Series 2015-DNA3, Class B(a)	11.79%	04/25/2028	6,435	6,836,110	0.8
Series 2015-HQ1, Class B(a)	13.19%	03/25/2025	2,327	2,327,737	0.3
Series 2015-HQ2, Class B(a)	10.39%	05/25/2025	2,839	2,884,725	0.4
Series 2015-HQA1, Class B(a)	11.24%	03/25/2028	3,455	3,487,451	0.4
Series 2015-HQA2, Class B(a)	12.94%	05/25/2028	3,600	3,790,117	0.5
Series 2016-DNA1, Class B(a)	12.26%	07/25/2028	1,916	2,008,558	0.2
Series 2016-DNA2, Class B(a)	12.94%	10/25/2028	6,756	7,168,666	0.9
Series 2016-DNA3, Class B(a)	13.69%	12/25/2028	1,481	1,609,660	0.2
Series 2016-DNA4, Class B(a)	11.04%	03/25/2029	990	988,889	0.1
Series 2016-HQA1, Class B(a)	15.19%	09/25/2028	2,487	2,709,740	0.3
Series 2016-HQA2, Class B(a)	13.94%	11/25/2028	497	547,858	0.1
Series 2018-HQA2, Class B1(a)	6.69%	10/25/2048	2,000	2,063,269	0.3
Series 2018-SP11, Class B(b)	3.76%	02/25/2048	1,250	986,441	0.1
Series 2018-SP12, Class B(b)	3.84%	05/25/2048	1,579	1,222,492	0.1
Series 2018-SP13, Class B(b)	4.16%	08/25/2048	1,730	594,632	0.1
Series 2018-SP14, Class B(b)	4.51%	11/25/2048	1,907	1,491,109	0.2
Series 2019-DNA1, Class B2(a)	13.19%	01/25/2049	3,500	3,893,582	0.5
Series 2019-DNA3, Class B1(a)	5.69%	07/25/2049	2,000	1,958,737	0.2
Series 2021-DNA2, Class B1(a)	5.58%	08/25/2033	2,000	1,850,526	0.2
Series 2021-DNA2, Class B2(a)	8.18%	08/25/2033	1,250	1,133,903	0.1
Series 2021-DNA2, Class M2(a)	4.48%	08/25/2033	2,000	1,969,929	0.2
Series 2021-DNA3, Class B1(a)	5.68%	10/25/2033	4,000	3,701,900	0.4
Series 2021-DNA6, Class B1(a)	5.58%	10/25/2041	1,000	946,230	0.1
Series 2021-DNA6, Class B2(a)	9.68%	10/25/2041	1,500	1,417,434	0.2
Series 2021-DNA6, Class M2(a)	3.68%	10/25/2041	4,700	4,441,502	0.5
Series 2021-DNA7, Class B1(a)	5.83%	11/25/2041	2,000	1,896,100	0.2
Series 2021-DNA7, Class B2(a)	9.98%	11/25/2041	1,000	930,628	0.1
Series 2021-DNA7, Class M2(a)	3.98%	11/25/2041	4,650	4,370,993	0.5
Series 2021-HQA3, Class B1(a)	5.53%	09/25/2041	2,000	1,814,937	0.2
Series 2021-HQA3, Class M1(a)	3.03%	09/25/2041	2,819	2,738,124	0.3
Series 2021-HQA4, Class B1(a)	5.93%	12/25/2041	1,967	1,760,264	0.2
Series 2022-DNA1, Class B1(a)	5.58%	01/25/2042	1,000	912,550	0.1

AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ (為替ヘッジなし)

	Rate	Date	Principal (000)	Value (USD)	Net Assets %
Series 2022-DNA1, Class B2(a)	9.28%	01/25/2042	USD 1,500	\$ 1,332,462	0.2%
Series 2022-DNA1, Class M1B(a)	4.03%	01/25/2042	7,812	7,439,925	0.9
Series 2022-DNA2, Class B1(a)	6.93%	02/25/2042	1,000	950,513	0.1
Series 2022-DNA2, Class B2(a)	10.68%	02/25/2042	500	467,965	0.1
Series 2022-DNA2, Class M1B(a)	4.58%	02/25/2042	5,000	4,855,298	0.6
Series 2022-HQA1, Class M1A(a)	4.28%	03/25/2042	2,651	2,654,147	0.3
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2013-C01, Class M2(a)	7.69%	10/25/2023	465	478,559	0.1
Series 2014-C04, Class 1M2(a)	7.34%	11/25/2024	459	479,827	0.1
Series 2015-C04, Class 1M2(a)	8.14%	04/25/2028	4,625	4,856,815	0.6
Series 2015-C04, Class 2M2(a)	7.99%	04/25/2028	2,248	2,320,995	0.3
Series 2016-C01, Class 1B(a)	14.19%	08/25/2028	2,685	2,969,927	0.4
Series 2016-C01, Class 2M2(a)	9.39%	08/25/2028	541	561,195	0.1
Series 2016-C02, Class 1B(a)	14.69%	09/25/2028	6,066	6,813,054	0.8
Series 2016-C02, Class 1M2(a)	8.44%	09/25/2028	645	676,279	0.1
Series 2016-C03, Class 1B(a)	14.19%	10/25/2028	3,478	3,849,196	0.5
Series 2016-C03, Class 2B(a)	15.19%	10/25/2028	3,220	3,662,089	0.4
Series 2016-C04, Class 1B(a)	12.69%	01/25/2029	3,215	3,453,205	0.4
Series 2016-C05, Class 2B(a)	13.19%	01/25/2029	4,921	5,300,416	0.6
Series 2016-C06, Class 1B(a)	11.69%	04/25/2029	5,046	5,265,704	0.6
Series 2016-C07, Class 2B(a)	11.94%	05/25/2029	3,558	3,718,738	0.5
Series 2017-C04, Class 2M2(a)	5.29%	11/25/2029	264	270,491	0.0
Series 2021-R02, Class 2B1(a)	5.48%	11/25/2041	3,000	2,833,711	0.3
Series 2021-R02, Class 2B2(a)	8.38%	11/25/2041	1,000	903,745	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-2R, Class A(a)	5.24%	05/27/2023	4,800	4,705,155	0.6
Series 2019-3R, Class A(a)	5.19%	10/27/2022	945	941,396	0.1
Radnor Re Ltd., Series 2021-2, Class M2(a)	7.16%	11/25/2031	4,000	3,715,371	0.5
STACR Trust, Series 2018-DNA3, Class B2(a)	10.19%	09/25/2048	3,015	3,088,446	0.4
Triangle Re Ltd., Series 2021-3, Class M1B(a)	5.08%	02/25/2034	1,500	1,444,326	0.2
				<u>270,609,112</u>	<u>32.6</u>
NON-AGENCY FIXED RATE					
Alternative Loan Trust					
Series 2005-50CB, Class 1A1	5.50%	11/25/2035	833	715,238	0.1
Series 2006-11CB, Class 1A2	6.00%	05/25/2036	829	535,833	0.1
Series 2006-28CB, Class A14	6.25%	10/25/2036	399	241,900	0.0
Series 2006-28CB, Class A18	6.00%	10/25/2036	676	397,743	0.0
Angel Oak Mortgage Trust, Series 2021-2, Class A1	0.99%	04/25/2066	3,462	3,097,247	0.4
BCAP LLC Trust, Series 2008-IND2, Class A2	3.05%	04/25/2038	775	622,976	0.1
Brean Asset Backed Securities Trust					
Series 2021-RM2, Class A	1.75%	10/25/2061	5,446	4,833,348	0.6
Series 2021-RM2, Class M2	1.75%	10/25/2061	1,524	1,213,783	0.1
Series 2022-RM3, Class M2	1.75%	02/25/2062	2,475	1,825,624	0.2
Chase Mortgage Finance Trust, Series 2007-S5, Class 1A17	6.00%	07/25/2037	1,563	808,709	0.1
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2006-10, Class 1A8	6.00%	05/25/2036	1,165	619,484	0.1
CitiMortgage Alternative Loan Trust, Series 2007-A6, Class 1A11	6.00%	06/25/2037	106	94,306	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
Series 2005-FA8, Class 1A12	5.50%	11/25/2035	88	49,840	0.0
Series 2006-FA2, Class 1A3	6.00%	05/25/2036	174	88,300	0.0
Flagstar Mortgage Trust, Series 2017-1, Class B3	3.62%	03/25/2047	1,615	1,464,437	0.2
JPMorgan Mortgage Trust					
Series 2017-2, Class B3	3.65%	05/25/2047	1,722	1,564,165	0.2
Series 2017-4, Class B3	3.88%	11/25/2048	1,999	1,817,607	0.2
Series 2017-6, Class B3	3.77%	12/25/2048	1,350	1,221,881	0.1
Series 2018-3, Class B2	3.71%	09/25/2048	2,569	2,318,703	0.3
Series 2018-6, Class B2	3.89%	12/25/2048	1,612	1,460,375	0.2
Series 2018-9, Class B2	4.23%	02/25/2049	2,422	2,194,784	0.3
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust,					
Series 2006-7, Class 4A4	6.00%	06/25/2036	434	262,222	0.0
Shellpoint Co-Originator Trust,					
Series 2017-1, Class B3	3.60%	04/25/2047	1,883	1,699,138	0.2
				<u>29,147,643</u>	<u>3.5</u>
NON-AGENCY FLOATING RATE					
Alternative Loan Trust, Series 2005-19CB, Class A2(a) (c)	11.56%	06/25/2035	66	57,081	0.0
Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust					
Series 2005-AC7, Class A2(a) (c)	13.16%	10/25/2035	239	195,716	0.0
Series 2005-AC9, Class A4(a) (c)	13.05%	12/25/2035	259	160,839	0.0
Chase Mortgage Finance Corp.					
Series 2016-SH1, Class M4(b)	3.75%	04/25/2045	1,129	1,003,497	0.1
Series 2016-SH2, Class M4(b)	3.75%	12/25/2045	495	447,156	0.1
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates,					
Series 2005-9, Class 4A1(a) (c)	12.80%	10/25/2035	59	57,102	0.0
Lehman Mortgage Trust, Series 2007-1, Class 3A2(a) (c)	4.81%	02/25/2037	888	115,560	0.0

AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ (為替ヘッジなし)

	Rate	Date	Principal (000)	Value (USD)	Net Assets %
RALI Trust, Series 2006-QO3, Class A1(a)	2.86%	04/25/2046	USD 2,333	\$ 718,048	0.1%
Sequoia Mortgage Trust, Series 2018-7, Class B2(b)	4.25%	09/25/2048	2,347	2,175,537	0.3
Structured Asset Securities Corp Trust, Series 2006-11, Class A3(a)	2.63%	10/28/2035	6,658	<u>4,544,279</u>	<u>0.6</u>
				<u>9,474,815</u>	<u>1.2</u>
AGENCY FLOATING RATE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 3928, Class SE(a) (c)	4.19%	09/15/2041	3,754	511,582	0.1
Series 4416, Class BS(a) (c)	3.71%	12/15/2044	1,564	182,749	0.0
Series 4719, Class JS(a) (c)	3.76%	09/15/2047	2,830	356,290	0.0
Series 4767, Class SB(a) (c)	3.81%	03/15/2048	3,144	398,275	0.0
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2011-131, Class ST(a) (c)	4.10%	12/25/2041	4,122	566,795	0.1
Series 2012-122, Class MS(a) (c)	3.66%	11/25/2042	1,591	219,587	0.0
Series 2013-15, Class SA(a) (c)	3.71%	03/25/2043	3,735	482,544	0.1
Series 2014-40, Class HS(a) (c)	4.26%	07/25/2044	2,262	398,378	0.1
Series 2015-90, Class SL(a) (c)	3.71%	12/25/2045	4,457	560,655	0.1
Series 2016-106, Class ES(a) (c)	3.56%	01/25/2047	1,538	192,484	0.0
Series 2017-20, Class SJ(a) (c)	3.66%	04/25/2047	3,661	476,207	0.1
Series 2018-28, Class SB(a) (c)	3.76%	05/25/2048	3,951	524,213	0.1
Series 2018-30, Class SA(a) (c)	3.76%	05/25/2048	3,112	386,497	0.0
Series 2018-58, Class SA(a) (c)	3.76%	08/25/2048	1,932	283,303	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2014-181, Class TV(a) (c)	3.86%	02/16/2035	3,293	215,969	0.0
Series 2015-3, Class DS(a) (c)	3.23%	11/20/2041	2,643	<u>87,081</u>	<u>0.0</u>
				<u>5,842,609</u>	<u>0.7</u>
AGENCY FIXED RATE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs,					
Series 5040, Class AI(d)	3.50%	11/25/2050	2,730	460,650	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2015-30, Class EI(d)	5.00%	05/25/2045	518	88,660	0.0
Series 2016-64, Class BI(d)	5.00%	09/25/2046	4,544	699,009	0.1
Government National Mortgage Association,					
Series 2021-117, Class MI(d)	3.50%	05/20/2042	15,164	<u>2,098,591</u>	<u>0.2</u>
				<u>3,346,910</u>	<u>0.4</u>
				<u>318,421,089</u>	<u>38.4</u>
COMMERCIAL MORTGAGE-BACKED SECURITIES					
NON-AGENCY FIXED RATE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.80%	02/10/2036	2,000	1,772,397	0.2
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2013-WBRK, Class D	3.65%	03/10/2037	3,000	2,611,945	0.3
Banc of America Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-UBS7, Class AS	3.99%	09/15/2048	1,140	1,092,747	0.1
Series 2015-UBS7, Class XA(d)	0.90%	09/15/2048	64,794	1,216,209	0.1
BANK					
Series 2017-BNK5, Class AS	3.62%	06/15/2060	2,500	2,321,530	0.3
Series 2017-BNK6, Class AS	3.74%	07/15/2060	2,500	2,333,980	0.3
Series 2018-BN13, Class AS	4.47%	08/15/2061	5,000	4,794,139	0.6
BBCMS Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class AS	3.90%	02/15/2050	2,500	2,368,702	0.3
Benchmark Mortgage Trust, Series 2018-B2, Class AS	4.08%	02/15/2051	2,500	2,363,317	0.3
Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018-B1, Class AM					
	3.88%	01/15/2051	6,809	6,433,397	0.8
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(d)					
	1.17%	11/15/2050	13,743	468,969	0.1
CFCRE Commercial Mortgage Trust					
Series 2016-C4, Class AM	3.69%	05/10/2058	190	180,530	0.0
Series 2016-C7, Class A3	3.84%	12/10/2054	2,500	2,416,044	0.3
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-GC8, Class B	4.29%	09/10/2045	971	956,158	0.1
Series 2013-GC11, Class D	4.33%	04/10/2046	1,056	1,028,295	0.1
Series 2013-GC17, Class D	5.25%	11/10/2046	2,430	2,227,774	0.3
Series 2015-GC29, Class XA(d)	1.16%	04/10/2048	6,382	135,187	0.0
Series 2016-P6, Class AS	4.03%	12/10/2049	3,310	3,148,966	0.4
Series 2017-P8, Class XA(d)	1.02%	09/15/2050	43,253	1,481,662	0.2
Series 2018-C6, Class XA(d)	0.94%	11/10/2051	7,868	294,290	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2010-C1, Class D	5.99%	07/10/2046	2,365	2,315,153	0.3
Series 2010-C1, Class F	4.00%	07/10/2046	3,780	3,231,871	0.4
Series 2012-CR1, Class B	4.61%	05/15/2045	935	932,386	0.1
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	1,500	828,900	0.1
Series 2012-CR3, Class E	4.93%	10/15/2045	2,173	1,086,437	0.1
Series 2012-CR3, Class XA(d)	1.89%	10/15/2045	937	9	0.0
Series 2012-CR5, Class XA(d)	1.54%	12/10/2045	9,788	404	0.0

AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ (為替ヘッジなし)

	Rate	Date	Principal (000)	Value (USD)	Net Assets %
Series 2013-LC6, Class D	4.43%	01/10/2046	USD 640	\$ 622,389	0.1%
Series 2013-LC6, Class XA(d)	1.38%	01/10/2046	9,607	2,761	0.0
Series 2014-CR16, Class D	5.08%	04/10/2047	1,841	1,686,872	0.2
Series 2014-CR19, Class XA(d)	1.09%	08/10/2047	69,170	956,730	0.1
Series 2014-CR20, Class XA(d)	1.13%	11/10/2047	7,361	113,062	0.0
Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047	2,000	1,940,732	0.2
Series 2014-UBS2, Class D	5.15%	03/10/2047	1,250	1,171,183	0.1
Series 2014-UBS6, Class AM	4.05%	12/10/2047	190	184,390	0.0
Series 2015-CR22, Class XA(d)	0.96%	03/10/2048	13,715	234,269	0.0
Series 2015-LC19, Class XA(d)	1.24%	02/10/2048	46,207	910,823	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(d)	1.10%	02/10/2049	46,508	1,165,239	0.1
CSAIL Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C8, Class XA(d)	1.25%	06/15/2050	53,197	2,049,992	0.3
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class C	5.30%	08/10/2044	4,850	4,025,500	0.5
Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	493	209,836	0.0
Series 2013-GC12, Class C	4.18%	06/10/2046	5,540	5,443,795	0.7
Series 2013-GC13, Class C	4.21%	07/10/2046	4,537	4,162,260	0.5
Series 2013-GC13, Class D	4.21%	07/10/2046	2,190	953,745	0.1
Series 2014-GC18, Class D	5.23%	01/10/2047	621	256,358	0.0
Series 2014-GC22, Class A5	3.86%	06/10/2047	2,500	2,469,577	0.3
Series 2014-GC22, Class XA(d)	1.09%	06/10/2047	6,465	68,610	0.0
Series 2016-GS3, Class A4	2.85%	10/10/2049	2,500	2,342,451	0.3
Series 2017-GS5, Class XA(d)	0.99%	03/10/2050	52,377	1,634,810	0.2
Series 2017-GS6, Class AS	3.64%	05/10/2050	2,000	1,873,963	0.2
Series 2017-GS7, Class XA(d)	1.24%	08/10/2050	25,884	1,005,976	0.1
Series 2017-GS8, Class XA(d)	1.10%	11/10/2050	36,971	1,314,979	0.2
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2013-C14, Class D	4.70%	08/15/2046	3,425	2,015,375	0.2
Series 2013-C17, Class D	5.05%	01/15/2047	2,535	2,383,462	0.3
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	2,000	1,928,333	0.2
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.96%	09/15/2047	93,388	1,101,071	0.1
Series 2014-C24, Class C	4.53%	11/15/2047	6,000	5,234,474	0.6
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2011-C4, Class C	5.60%	07/15/2046	30	29,901	0.0
Series 2012-C6, Class E	5.11%	05/15/2045	2,250	1,744,019	0.2
Series 2012-C6, Class G	2.97%	05/15/2045	2,500	1,123,550	0.1
Series 2013-C10, Class B	3.67%	12/15/2047	2,213	2,179,105	0.3
Series 2013-C10, Class D	4.22%	12/15/2047	1,550	1,497,467	0.2
Series 2014-C20, Class XA(d)	0.96%	07/15/2047	9,572	77,865	0.0
Series 2016-JP2, Class XA(d)	1.93%	08/15/2049	39,642	2,105,929	0.3
Series 2016-JP3, Class B	3.40%	08/15/2049	2,000	1,809,108	0.2
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(d)	1.69%	07/12/2050	24,961	1,365,475	0.2
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2012-C6, Class E	4.76%	11/15/2045	425	414,450	0.1
Series 2012-C6, Class XA(d)	1.57%	11/15/2045	1,055	11	0.0
Series 2014-C18, Class C	4.65%	10/15/2047	1,333	1,261,064	0.2
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	1,225	1,069,486	0.1
Series 2014-C19, Class XA(d)	1.10%	12/15/2047	26,588	427,246	0.1
Series 2015-C20, Class XA(d)	1.40%	02/15/2048	55,131	1,137,293	0.1
Series 2015-C22, Class XA(d)	1.15%	04/15/2048	45,707	832,999	0.1
Series 2015-C25, Class XA(d)	1.20%	10/15/2048	29,412	670,489	0.1
Series 2017-C34, Class XA(d)	0.91%	11/15/2052	30,635	895,949	0.1
Morgan Stanley Capital I Trust					
Series 2011-C3, Class C	5.25%	07/15/2049	460	455,540	0.1
Series 2016-UBS9, Class XA(d)	1.27%	03/15/2049	55,990	1,658,819	0.2
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C1, Class D	6.66%	05/10/2045	360	327,965	0.0
Series 2017-C3, Class XA(d)	1.17%	08/15/2050	32,440	1,184,378	0.1
Series 2017-C4, Class XA(d)	1.16%	10/15/2050	17,987	740,246	0.1
Series 2017-C5, Class XA(d)	1.19%	11/15/2050	34,294	1,216,802	0.2
Series 2018-C10, Class XA(d)	1.04%	05/15/2051	73,355	2,940,837	0.4
Series 2018-C14, Class XA(d)	1.15%	12/15/2051	50,200	2,330,187	0.3
Series 2018-C15, Class XA(d)	1.15%	12/15/2051	24,351	1,150,709	0.1
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C4, Class C	4.53%	12/10/2045	7,000	6,911,459	0.8
Series 2012-C4, Class XA(d)	1.65%	12/10/2045	3,933	39	0.0
Series 2013-C6, Class D	4.44%	04/10/2046	3,618	3,090,689	0.4
Series 2013-C6, Class XA(d)	1.22%	04/10/2046	3,055	4,133	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-C27, Class XA(d)	0.97%	02/15/2048	125,109	2,063,523	0.3
Series 2015-C29, Class C	4.36%	06/15/2048	3,852	3,613,606	0.4
Series 2015-C31, Class A3	3.43%	11/15/2048	1,147	1,103,706	0.1
Series 2015-NXS3, Class A4	3.62%	09/15/2057	1,425	1,386,017	0.2
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	1,313	1,264,151	0.2

AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ (為替ヘッジなし)

	Rate	Date	Principal (000)	Value (USD)	Net Assets %
Series 2016-C32, Class XA(d)	1.37%	01/15/2059	USD 55,128	\$ 1,825,294	0.2%
Series 2016-C33, Class XA(d)	1.75%	03/15/2059	34,837	1,544,068	0.2
Series 2016-C35, Class A3	2.67%	07/15/2048	2,419	2,268,684	0.3
Series 2016-C35, Class B	3.44%	07/15/2048	2,500	2,280,068	0.3
Series 2016-C36, Class XA(d)	1.32%	11/15/2059	45,429	1,682,729	0.2
Series 2016-LC25, Class AS(b)	4.01%	12/15/2059	2,216	2,112,981	0.3
Series 2017-C38, Class XA(d)	1.12%	07/15/2050	28,603	1,046,051	0.1
Series 2017-C39, Class A5	3.42%	09/15/2050	2,500	2,379,176	0.3
Series 2018-C46, Class AS	4.38%	08/15/2051	4,500	4,297,973	0.5
Series 2018-C47, Class A4	4.44%	09/15/2061	5,000	4,960,288	0.6
Series 2018-C48, Class A5	4.30%	01/15/2052	2,000	1,969,178	0.2
Series 2018-C48, Class XA(d)	1.12%	01/15/2052	44,155	2,006,087	0.2
WF-RBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E	4.99%	06/15/2044	713	557,557	0.1
Series 2011-C5, Class E	5.70%	11/15/2044	968	965,122	0.1
Series 2012-C9, Class D	4.99%	11/15/2045	615	604,663	0.1
Series 2012-C9, Class XA(d)	1.84%	11/15/2045	1,212	12	0.0
Series 2012-C10, Class B	3.74%	12/15/2045	2,500	2,481,700	0.3
Series 2012-C10, Class XA(d)	1.59%	12/15/2045	13,536	135	0.0
Series 2013-C11, Class AS	3.31%	03/15/2045	2,000	1,986,456	0.2
Series 2013-C11, Class XA(d)	1.24%	03/15/2045	15,449	14,505	0.0
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.94%	09/15/2057	34,003	403,983	0.1
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	3,164	3,061,779	0.4
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	1,290	1,128,256	0.1
Series 2014-C25, Class XA(d)	0.94%	11/15/2047	22,198	316,419	0.0
				<u>187,481,791</u>	<u>22.6</u>
NON-AGENCY FLOATING RATE CMBS					
Ashford Hospitality Trust, Series 2018-KEYS, Class A(a)	3.39%	06/15/2035	3,000	2,920,233	0.3
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2017-SCH, Class AF(a)	3.39%	11/15/2033	3,000	2,833,894	0.3
Braemar Hotels & Resorts Trust, Series 2018-PRME,					
Class A(a)	3.21%	06/15/2035	5,000	4,799,954	0.6
BX Trust, Series 2018-EXCL, Class A(a)	3.48%	09/15/2037	815	1,10,969	0.1
DBWF Mortgage Trust, Series 2018-GLKS, Class E(a)	5.38%	12/19/2030	2,420	2,286,897	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp.,					
Series 2021-MN1, Class M2(a)	5.93%	01/25/2051	1,700	1,572,985	0.2
FS Rialto 2022-FI4 Issuer LLC, Series 2022-FL4, Class A(a)	3.93%	01/19/2039	5,000	4,861,736	0.6
HGI CRE CLO 2021-FL3 Ltd., Series 2022-FL3, Class A(a)	3.68%	04/20/2037	5,000	4,891,623	0.6
Morgan Stanley Capital I Trust					
Series 2019-BPR, Class D(a)	6.64%	05/15/2036	2,750	2,551,826	0.3
Series 2019-BPR, Class E(a)	7.39%	05/15/2036	2,250	1,760,945	0.2
Rial 2022-#8 A, Series 2022-FL8, Class A(a)	4.55%	01/19/2037	3,000	2,958,424	0.4
				<u>32,249,486</u>	<u>3.9</u>
				<u>219,731,277</u>	<u>26.5</u>
COLLATERALIZED LOAN OBLIGATIONS					
CLO - FLOATING RATE					
522 Funding CLO Ltd., Series 2021-7A, Class A(a)	3.85%	04/23/2034	7,000	6,796,083	0.8
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class D(a)	6.41%	01/20/2034	4,000	3,767,412	0.5
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class D(a)	5.41%	04/15/2034	3,500	3,130,928	0.4
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class E(a)	8.51%	04/15/2034	2,250	2,000,259	0.2
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class D(a)	5.66%	04/15/2034	3,000	2,723,601	0.3
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(a)	8.87%	04/15/2034	1,000	896,421	0.1
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class E(a)	8.86%	07/20/2034	3,250	2,881,115	0.4
AGL CLO 13 Ltd., Series 2021-13A, Class E(a)	9.21%	10/20/2034	4,000	3,581,356	0.4
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class D(a)	5.88%	01/25/2035	3,000	2,699,160	0.3
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class E(a)	9.24%	01/25/2035	3,400	3,065,814	0.4
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class D(a)	5.36%	04/20/2034	3,500	3,187,842	0.4
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(a)	8.46%	04/20/2034	3,250	2,943,597	0.4
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(a)	5.81%	10/20/2034	5,000	4,465,870	0.5
Ballyroock CLO Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	8.51%	04/20/2031	1,000	859,844	0.1
Ballyroock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class C(a)	6.31%	01/20/2034	2,000	1,867,364	0.2
Ballyroock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class D(a)	9.71%	01/20/2034	2,000	1,804,820	0.2
Ballyroock CLO Ltd., Series 2021-16A, Class D(a)	8.96%	07/20/2034	3,500	3,103,895	0.4
Ballyroock CLO Ltd., Series 2021-17A, Class D(a)	8.69%	10/20/2034	2,000	1,760,624	0.2
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(a)	4.52%	04/26/2031	5,000	4,751,100	0.6
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class B(a)	5.83%	07/23/2032	4,125	3,892,536	0.5
BlueMountain Fuji US CLO II Ltd., Series 2017-2A, Class D(a)	8.86%	10/20/2030	1,000	868,056	0.1
Carlyle US CLO Ltd., Series 2017-3A, Class D(a)	8.82%	07/20/2029	1,500	1,271,661	0.2
Cedar Funding IX CLO Ltd., Series 2018-9A, Class E(a)	8.06%	04/20/2031	875	767,968	0.1
Dryden 57 CLO Ltd., Series 2018-57A, Class E(a)	8.11%	05/15/2031	1,750	1,551,191	0.2
Dryden CLO Ltd., Series 2018-64A, Class B(a)	4.14%	04/18/2031	3,800	3,647,939	0.4
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(a)	5.56%	07/15/2030	1,500	1,375,452	0.2
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class D(a)	4.31%	04/22/2035	4,000	3,658,856	0.4
Galaxy XXIII CLO Ltd., Series 2017-23A, Class B1R(a)	4.13%	04/24/2029	1,350	1,299,740	0.2

AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ (為替ヘッジなし)

	Rate	Date	Principal (000)	Value (USD)	Net Assets %
Goldentree Loan Management US CLO 7 Ltd., Series 2020-7A, Class DR(a)	5.86%	04/20/2034	USD 1,000	\$ 936,999	0.1%
Goldentree Loan Opportunities XI Ltd., Series 2015-11A, Class BR2(a)	4.09%	01/18/2031	8,000	7,721,056	0.9
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A2(a)	4.40%	04/26/2031	5,000	4,814,380	0.6
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2018-1A, Class C(a)	5.91%	07/21/2031	2,000	1,740,688	0.2
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class B(a)	4.06%	04/15/2034	3,000	2,849,502	0.3
Investo CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	8.97%	04/15/2034	3,000	2,698,467	0.3
Jamestown CLO XI Ltd., Series 2018-11A, Class D(a)	8.50%	07/14/2031	1,500	1,292,901	0.2
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(a)	5.46%	10/20/2030	2,000	1,857,178	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-33A, Class DR(a)	5.64%	10/16/2033	1,875	1,743,051	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-33A, Class ER(a)	8.99%	10/16/2033	2,000	1,812,594	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class D(a)	6.31%	01/20/2032	1,250	1,202,305	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class E(a)	9.91%	01/20/2032	2,500	2,311,185	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-42A, Class E(a)	8.69%	07/16/2035	3,625	3,275,528	0.4
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-43A, Class D(a)	5.84%	07/17/2035	3,000	2,807,316	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-44A, Class E(a)	8.74%	10/16/2034	1,500	1,351,604	0.2
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class D(a)	6.06%	10/20/2034	5,000	4,486,225	0.5
OCP CLO Ltd., Series 2018-15A, Class D(a)	8.56%	07/20/2031	1,000	880,157	0.1
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	7.91%	01/20/2031	3,000	2,638,431	0.3
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class D(a)	8.04%	01/17/2031	1,750	1,374,625	0.2
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	8.71%	10/20/2034	2,830	2,565,624	0.3
Pikes Peak CLO 1, Series 2018-1A, Class E(a)	8.83%	07/24/2031	1,500	1,301,787	0.2
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class D(a)	6.40%	02/25/2034	5,000	4,618,520	0.6
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class A(a)	3.88%	07/20/2034	10,000	9,728,880	1.2
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class D(a)	5.81%	07/20/2034	5,000	4,515,495	0.5
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class D(a)	4.73%	04/22/2034	4,000	3,686,048	0.4
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class E(a)	9.24%	10/18/2034	1,400	1,183,735	0.1
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	8.46%	07/15/2031	3,000	2,357,949	0.3
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2017-3A, Class B(a)	4.18%	10/20/2030	3,000	2,884,161	0.4
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	5.98%	05/20/2031	3,450	3,149,791	0.4
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-2A, Class B(a)	4.51%	10/20/2031	7,000	6,750,310	0.8
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	9.07%	07/20/2034	3,000	2,686,860	0.3
TCW CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	8.83%	04/25/2031	2,250	1,984,754	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class AR(a)	3.91%	07/20/2031	2,000	1,959,062	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class B1R(a)	4.46%	07/20/2031	5,000	4,762,205	0.6
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class CR(a)	5.06%	07/20/2031	2,000	1,840,372	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class DR(a)	6.21%	07/20/2031	4,000	3,535,480	0.4
TRESTLES CLO Ltd., Series 2018-2A, Class A2(a)	4.45%	07/25/2031	3,000	2,887,920	0.4
Venture XXVII CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(a)	6.71%	07/20/2030	1,500	1,360,302	0.2
Wehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class D(a)	4.09%	04/21/2035	3,000	2,737,515	0.3
				<u>188,911,466</u>	<u>22.8</u>

MORTGAGE PASS-THROUGHS

AGENCY FIXED RATE 30-YEAR

Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold Pool, Series 2018	4.00%	10/01/2048	4,753	4,711,601	0.6
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.50%	10/01/2030	3	2,710	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.50%	06/01/2031	25	27,072	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2003	5.00%	11/01/2033	139	143,842	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2004	8.00%	09/01/2033	315	343,561	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.00%	07/01/2037	146	150,292	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.50%	05/01/2038	184	195,661	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	05/01/2039	73	75,652	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	02/01/2040	459	476,775	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	04/01/2040	620	644,209	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	12/01/2040	609	631,424	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2011	5.00%	04/01/2041	301	312,520	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/01/2044	734	765,943	0.1
Government National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	10/15/2039	142	147,450	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2012	5.50%	06/15/2038	46	48,206	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/20/2041	483	496,075	0.1
				<u>9,172,993</u>	<u>1.1</u>

AGENCY FIXED RATE 15-YEAR

Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2011	5.00%	07/01/2025	25	25,594	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2011	6.50%	03/01/2026	3	2,720	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold Pool, Series 2012	5.00%	06/01/2026	1	890	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold Pool, Series 2014	3.50%	02/01/2029	417	412,217	0.1
				<u>441,421</u>	<u>0.1</u>
				<u>9,614,414</u>	<u>1.2</u>

AB FCP I - モーゲージ・インカム・ポートフォリオ クラス S1 シェアーズ (為替ヘッジなし)

	Rate	Date	Contracts/Principal (-)/(000)	Value (USD)	Net Assets %
ASSET-BACKED SECURITIES					
OTHER ABS - FIXED RATE					
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust, Series 2018-P2, Class C	5.21%	10/15/2025	USD 101	\$ 100,812	0.0%
TGIF Funding LLC, Series 2017-1A, Class A2	6.20%	04/30/2047	5,343	5,133,430	0.6
				5,234,242	0.6
AUTOS - FIXED RATE					
Octane Receivables Trust 2022-1, Series 2022-1A, Class D	5.54%	02/20/2029	3,708	3,594,109	0.5
HOME EQUITY LOANS - FIXED RATE					
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-WF1, Class A5	5.01%	11/25/2034	0*	11	0.0
				8,828,362	1.1
CORPORATES - NON-INVESTMENT GRADE					
FINANCIAL INSTITUTIONS					
FINANCE					
Curo Group Holdings Corp.	7.50%	08/01/2028	5,323	3,229,262	0.4
Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025	1,002	934,434	0.1
				4,163,696	0.5
OPTIONS PURCHASED - PUTS					
OPTIONS ON EQUITIES INDICES					
S&P 500 Index Expiration: Oct 2022, Exercise Price: USD 3,700.00			170	946,900	0.1
				750,617,204	90.6
OTHER TRANSFERABLE SECURITIES					
ASSET-BACKED SECURITIES					
OTHER ABS - FIXED RATE					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-7, Class PT	9.35%	06/15/2043	USD 30	28,032	0.0
Series 2018-20, Class PT	11.60%	11/16/2043	98	93,772	0.0
Series 2019-24, Class PT	11.05%	08/15/2044	411	396,233	0.0
Series 2019-44, Class PT	10.95%	11/15/2044	441	427,991	0.1
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-3, Class PT	8.22%	03/16/2043	24	22,138	0.0
Series 2018-4, Class PT	10.72%	05/15/2043	22	21,176	0.0
Series 2018-12, Class PT	8.48%	06/15/2043	58	55,533	0.0
Series 2019-48, Class PT	10.32%	12/15/2044	413	398,784	0.0
Dragonfly Energy Corp., Series CLIP(e)	5.50%	11/15/2024	2,900	2,914,500	0.4
SMB Private Education Loan Trust					
Series 2021-A, Class R(e)	0.00%	01/15/2053	2	4,355,780	0.5
Series 2021-C, Class R(e)	0.00%	01/15/2053	14	7,155,000	0.9
Series 2022-A, Class R	0.00%	11/16/2054	3	2,999,584	0.4
SoFi Consumer Loan Program LLC, Series 2016-1, Class R(e)	0.00%	08/25/2025	61	58,459	0.0
				18,926,982	2.3
AUTOS - FIXED RATE					
Octane Receivables Trust					
Series 2020-1A, Class R1(e)	0.00%	03/20/2028	9	1,400,106	0.2
Series 2021-1A, Class R1(e)	0.00%	11/20/2028	5	1,286,072	0.1
Santander Consumer Auto Receivables Trust					
Series 2021-BA, Class R(e)	0.00%	03/15/2029	5	930,011	0.1
Series 2021-CA, Class R(e)	0.00%	06/15/2028	6	815,771	0.1
				4,431,960	0.5
				23,358,942	2.8
COLLATERALIZED MORTGAGE OBLIGATIONS					
RISK SHARE FLOATING RATE					
Bellemeade Re Ltd., Series 2020-4A, Class B1(a)	7.44%	06/25/2030	500	488,906	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019-FTR2, Class B2(a)	9.84%	11/25/2048	1,000	953,129	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2019-FTR3, Class B2(a)	7.06%	09/25/2047	6,980	5,940,112	0.7
Series 2019-HQA1, Class B2(a)	14.69%	02/25/2049	750	851,564	0.1
JPMorgan Madison Avenue Securities Trust					
Series 2014-CH1, Class M2(a)	6.69%	11/25/2024	582	557,159	0.1
Series 2015-CH1, Class M2(a)	7.94%	10/25/2025	1,351	1,316,631	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R, Class A(a)	4.84%	02/27/2023	1,342	1,325,867	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust, Series 2015-WF1, Class IM2(a)	7.69%	11/25/2025	645	590,743	0.1
				12,024,111	1.4

	Rate	Date	Shares/Principal (-)/(000)	Value (USD)	Net Assets %
COMMERCIAL MORTGAGE-BACKED SECURITIES					
NON-AGENCY FIXED RATE CMBS					
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(e)	0.00%	10/03/2047	USD 14	\$ 256,552	0.0%
Grantor Trust CSALL, Series 2015-C1(e)	4.00%	04/15/2050	226	3,338,448	0.4
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(e)	4.00%	11/15/2047	210	1,208,143	0.1
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(e)	3.40%	10/15/2057	217	5,291,344	0.7
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class XCP(d)	0.00%	04/15/2023	163,600	1,636	0.0
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust, Series 2013-C5, Class XA(d)	1.00%	03/10/2046	27,068	<u>13,036</u>	<u>0.0</u>
				<u>10,109,159</u>	<u>1.2</u>
COMMON STOCKS					
Mt. Logan Re Ltd. (Preference Shares) (Series 1)(e)			4,000	3,706,546	0.4
Mt. Logan Re Ltd. (Special Investment)(e)			632	<u>564,108</u>	<u>0.1</u>
				<u>4,270,654</u>	<u>0.5</u>
EMERGING MARKETS - CORPORATE BONDS					
INDUSTRIAL					
CONSUMER NON-CYCLICAL					
Virgolino de Oliveira Finance SA(e) (f)	10.88%	01/13/2020	USD 1,665	<u>167</u>	<u>0.0</u>
				<u>49,763,033</u>	<u>5.9</u>
Total Investments					
(cost \$972,838,634)				<u>\$ 800,380,237</u>	<u>96.5%</u>
Time Deposits					
BBH, Grand Cayman(g)	(0.78)%	-	-	1	0.0
ANZ, London(g)	0.80 %	-	-	216	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	(0.13)%	-	-	1	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	4.15 %	-	-	12,224	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(g)	0.40 %	-	-	1	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(g)	1.10 %	-	-	13	0.0
Sumitomo, Tokyo(g)	1.68 %	-	-	<u>34,695,766</u>	<u>4.1</u>
Total Time Deposits				<u>34,708,221</u>	<u>4.1</u>
Other assets less liabilities				<u>(5,375,162)</u>	<u>(0.6)</u>
Net Assets				<u>\$ 829,713,296</u>	<u>100.0%</u>

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS

Counterparty	Contracts to Deliver (000)	In Exchange For (000)	Settlement Date	Unrealized Appreciation/ Depreciation)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 189	USD 28	09/06/2022	\$ 500
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3	USD 3	09/06/2022	37
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2	USD 2	09/06/2022	(7)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,431	CNH 23,188	09/06/2022	(67,343)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,682	EUR 1,674	09/06/2022	373
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 637	EUR 624	09/06/2022	(9,555)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 101	USD 71	09/12/2022	1,392
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1	USD 1	09/12/2022	15
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2	USD 2	09/12/2022	(7)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 3	USD 2	09/12/2022	-
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 29,721	AUD 41,926	09/12/2022	(1,028,673)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,683	EUR 1,674	09/12/2022	358
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 607	EUR 586	09/12/2022	(17,868)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 142	GBP 116	09/12/2022	(7,307)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 781	SGD 1,069	09/12/2022	(16,157)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 6,683	ZAR 108,374	09/12/2022	(361,847)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 506	USD 30	09/12/2022	305
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 64	USD 9	09/19/2022	150
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1	USD 1	09/19/2022	15
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1	USD 1	09/19/2022	(2)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,410	CNH 23,138	09/19/2022	(53,312)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,679	EUR 1,670	09/19/2022	448
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 547	EUR 536	09/19/2022	(7,644)
				<u>\$ (1,566,129)</u>
			Appreciation	\$ 3,593
			Depreciation	\$ (1,569,722)

+ Used for share class hedging purposes.

PUT OPTIONS WRITTEN

Description	Exercise Price	Expiration Date	Contracts	Premiums Received	Market Value
S&P 500 Index	USD 3,400	10/21/2022	170	\$ 276,585	\$ (321,300)

CREDIT DEFAULT SWAPS

Counterparty	Referenced Obligation	Termination Date	Notional Amount ('000)	Market Value	Upfront Premiums Paid/(Received)	Unrealized Appreciation/(Depreciation)
Sale Contracts						
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 27	\$ (11,322)	\$ (4,069)	\$ (7,253)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 529	(221,907)	(79,448)	(142,459)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,008	(841,695)	(294,366)	(547,329)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,057	(862,397)	(236,985)	(625,412)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,466	(319,065)	(169,585)	(149,480)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,199	(478,597)	(224,463)	(254,134)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 589	(128,264)	(44,528)	(83,736)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,466	(319,065)	(188,781)	(130,284)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,833	(398,831)	(96,756)	(302,075)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,833	(398,831)	(107,021)	(291,810)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 873	(365,856)	(157,743)	(208,113)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 900	(377,178)	(166,013)	(211,165)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 1,368	(573,530)	(250,847)	(322,683)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,508	(328,158)	(186,705)	(141,453)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,833	(398,831)	(189,668)	(209,163)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 1,029	(431,522)	(119,335)	(312,187)
Total				\$ (6,455,049)	\$ (2,516,313)	\$ (3,938,736)

CENTRALLY CLEARED INTEREST RATE SWAPS

Clearing Broker/(Exchange)	Notional Amount ('000)	Termination Date	Rate Type		Unrealized Appreciation/(Depreciation)
			Payments Made By the Fund	Payments Received By the Fund	
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 25,200	04/25/2024	1 Day SOFR	2.703%	\$ 363,373
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 9,060	07/01/2024	1 Day SOFR	3.132%	70,254
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 14,760	04/25/2027	1 Day SOFR	2.774%	218,788
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 11,380	07/01/2027	1 Day SOFR	2.937%	84,196
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 3,370	04/25/2032	1 Day SOFR	2.719%	63,125
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 2,040	07/01/2032	1 Day SOFR	2.914%	5,227
Total					\$ 804,963
Total for Swaps					\$ (3,133,773)

* Principal amount less than 500.

- (a) Floating Rate Security. Stated interest rate was in effect at August 31, 2022.
- (b) Variable rate coupon, rate shown as of August 31, 2022.
- (c) Inverse interest only security.
- (d) IO - Interest Only.
- (e) Fair valued as determined in accordance with procedures established by and under the general supervision of the Management Company's Board of Managers.
- (f) Defaulted matured security.
- (g) Overnight deposit.

Currency Abbreviations:

- AUD - Australian Dollar
- CNH - Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- EUR - Euro
- GBP - Great British Pound
- SGD - Singapore Dollar
- USD - United States Dollar
- ZAR - South African Rand

Glossary:

ABS	- Asset-Backed Securities
CDX-CMBX.NA	- North American Commercial Mortgage-Backed Index
CLO	- Collateralized Loan Obligations
CMBS	- Commercial Mortgage-Backed Securities
CME	- Chicago Mercantile Exchange
LCH	- London Clearing House
REMICs	- Real Estate Mortgage Investment Conduits
SOFR	- Secured Overnight Financing Rate

See notes to financial statements.



ALLIANCEBERNSTEIN®

運用報告書

アライアンス・バーンスタイン・ 日本債券インデックス・マザーファンド

第13期(決算日2022年6月15日)

(計算期間：2021年6月16日～2022年6月15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。

運用方針	①信託財産の長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。 ②パークレイズ日本10年国債先物インデックスをベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	主としてわが国の国債および国内外の主要取引所に上場する債券先物に投資します。
組入制限	①株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ②外貨建資産への投資は行いません。

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5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率			
9期(2018年6月15日)	11,928	0.5	11,918	0.7	74.3	100.0	162,244
10期(2019年6月17日)	12,124	1.6	12,139	1.9	75.0	99.9	145,788
11期(2020年6月15日)	11,994	△1.1	12,039	△0.8	89.4	99.9	169,998
12期(2021年6月15日)	11,975	△0.2	12,048	0.1	75.3	100.0	164,167
13期(2022年6月15日)	11,516	△3.8	11,602	△3.7	78.6	99.9	143,682

(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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) 2021年6月15日	11,975	—	12,048	—	75.3	100.0
6月末	11,966	△0.1	12,040	△0.1	75.4	99.9
7月末	12,013	0.3	12,088	0.3	75.5	99.9
8月末	12,001	0.2	12,077	0.2	76.1	99.8
9月末	11,940	△0.3	12,019	△0.2	76.5	100.0
10月末	11,935	△0.3	12,015	△0.3	77.1	99.9
11月末	11,984	0.1	12,064	0.1	76.9	100.0
12月末	11,957	△0.2	12,041	△0.1	76.9	100.0
2022年1月末	11,886	△0.7	11,971	△0.6	77.4	99.9
2月末	11,868	△0.9	11,954	△0.8	78.9	100.0
3月末	11,813	△1.4	11,903	△1.2	75.5	100.0
4月末	11,806	△1.4	11,897	△1.3	75.7	100.0
5月末	11,807	△1.4	11,899	△1.2	76.7	99.9
(期末) 2022年6月15日	11,516	△3.8	11,602	△3.7	78.6	99.9

(注) 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。

※ベンチマークについて
当マザーファンドのベンチマークは「パークレイズ日本10年国債先物インデックス」です。「パークレイズ日本10年国債先物インデックス」は、日本10年国債先物期近限月への投資のパフォーマンスをあらわします。ここでは当マザーファンドの当初設定日(2009年8月3日)を10,000として指数化しております。
当資料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。

※ベンチマークの名称を「ブルームバーグ・パークレイズ」から「パークレイズ」へ修正いたしましたが、数値について変更はございません。

運用経過

アライアンス・バーンスタイン・日本債券インデックス・マザーファンド(以下「当マザーファンド」とい
うことがあります。)の運用状況をご報告いたします。

期中の基準価額等の推移

(2021年6月16日～2022年6月15日)

○基準価額等の推移

当マザーファンドの基準価額は前期末比3.8%の下落となりました。一方、パークレイズ日本10年国債先物
インデックスは同3.7%の下落となりました。

○基準価額の主な変動要因

下落要因：投資している債券先物の価格下落

当期中の基準価額の推移
2021年6月16日～2022年6月15日



当期中のベンチマークの推移
2021年6月16日～2022年6月15日



*ベンチマークについては前ページ「※ベンチマークについて」をご参照ください。

投資環境

(2021年6月16日～2022年6月15日)

当期の日本10年国債金利は、新型コロナウイルスの変異株などへの警戒から低下(価格は上昇)する局面があったものの、世界的な金利上昇を背景に、おおむね上昇(価格は下落)基調で推移しました。

運用概況

(2021年6月16日～2022年6月15日)

当マザーファンドは、主としてわが国の国債および国内外の主要取引所に上場する債券先物に投資することにより、信託財産の成長を図ることを目標とし、日本国債の長期国債先物への投資を行いました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2021年6月16日～2022年6月15日)

ベンチマークに連動する運用を目指した結果、当マザーファンドの当期末の基準価額はおおむねベンチマークに沿ったパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

引き続き、主としてわが国の国債および国内外の主要取引所に上場する債券先物に投資を行い、ベンチマークに連動する運用を目指します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月16日～2022年6月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.003 (0.003)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.003 (0.003)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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	0	0.006	
期中の平均基準価額は、11,914円です。			

(注) 期中の費用(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)を期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。

○ 売買及び取引の状況

(2021年6月16日～2022年6月15日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 237,057,998	千円 44,227,242 (203,300,000)

(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) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 単位未満は切り捨て。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		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 620,532	百万円 635,461	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受け渡し代金。

(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

(2021年6月16日～2022年6月15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

(2022年6月15日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 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	112,981,800 (112,981,800)	112,998,958 (112,998,958)	78.6 (78.6)	— (—)	— (—)	— (—)	78.6 (78.6)
合 計	112,981,800 (112,981,800)	112,998,958 (112,998,958)	78.6 (78.6)	— (—)	— (—)	— (—)	78.6 (78.6)

(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) 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。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 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1009回国庫短期証券	—	37,681,800	37,685,304	2022/7/20
第1065回国庫短期証券	—	37,800,000	37,800,453	2022/6/20
第1071回国庫短期証券	—	37,500,000	37,513,200	2022/10/11
合 計		112,981,800	112,998,958	

(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			当 期	
			買 建 額	売 建 額
国内	債券先物取引	10年国債標準物	百万円 143,541	百万円 —

(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

(2022年6月15日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 112,998,958	% 76.7
コール・ローン等、その他	34,292,991	23.3
投資信託財産総額	147,291,949	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年6月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	147,291,949,506
コール・ローン等	32,890,510,777
公社債(評価額)	112,998,958,005
差入委託証拠金	1,402,480,724
(B) 負債	3,609,360,380
未払金	3,572,256,110
未払解約金	37,019,567
未払利息	84,703
(C) 純資産総額(A-B)	143,682,589,126
元本	124,767,207,311
次期繰越損益金	18,915,381,815
(D) 受益権総口数	124,767,207,311口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,516円

(注) 期首元本額137,091,012,959円、期中追加設定元本額2,302,623,758円、期中一部解約元本額14,626,429,406円。当期末現在における1口当たり純資産額1,1516円。

(注) 当期末現在において、当親投資信託受益証券を組み入れているベビーファンドの組入元本額の内訳は、下記のとおりです。

<組入元本額の内訳>

適格機関投資家私募 アライアンス・バーンスタイン・グローバル・バランス (20/80)	66,188,858,867円
適格機関投資家私募 アライアンス・バーンスタイン・グローバル・バランス (20/80) - 2	23,768,211,832円
適格機関投資家私募 アライアンス・バーンスタイン・グローバル・バランス (20/80) - 3	34,793,491,176円
適格機関投資家私募 アライアンス・バーンスタイン・グローバル・アロケーション (30/70)	16,570,098円
AB新興国分散ファンドAコース(限定為替ヘッジ)	8,398円
AB新興国分散ファンドBコース(為替ヘッジなし)	8,398円
AB米国不動産好利回り債券ファンド(為替ヘッジなし)	8,360円
アライアンス・バーンスタイン・世界SDGs株式ファンド(資産成長型)	8,357円
アライアンス・バーンスタイン・世界SDGs株式ファンド(予想分配金提示型)	8,357円
アライアンス・バーンスタイン・世界SDGs債券ファンド(年2回決算型・為替ヘッジあり)	8,367円
アライアンス・バーンスタイン・世界SDGs債券ファンド(年2回決算型・為替ヘッジなし)	8,367円
アライアンス・バーンスタイン・世界SDGs債券ファンド(毎月決算型・為替ヘッジあり)	8,367円
アライアンス・バーンスタイン・世界SDGs債券ファンド(毎月決算型・為替ヘッジなし)	8,367円

○損益の状況 (2021年6月16日～2022年6月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 34,814,165
受取利息	10
支払利息	△ 34,814,175
(B) 有価証券売買損益	△ 145,771,277
売買損	△ 145,771,277
(C) 先物取引等取引損益	△ 5,625,380,995
取引益	260,833,805
取引損	△ 5,886,214,800
(D) 保管費用等	△ 5,162,329
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 5,811,128,766
(F) 前期繰越損益金	27,076,170,091
(G) 追加信託差損益金	435,743,098
(H) 解約差損益金	△ 2,785,402,608
(I) 計(E+F+G+H)	18,915,381,815
次期繰越損益金(I)	18,915,381,815

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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