



# 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) 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)

追加型投信／内外／株式

資産成長型

第11期(決算日2026年4月27日)

予想分配金提示型

第59期(決算日2025年11月25日) 第60期(決算日2025年12月25日) 第61期(決算日2026年1月26日)

第62期(決算日2026年2月25日) 第63期(決算日2026年3月25日) 第64期(決算日2026年4月27日)

## ●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、このたび「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)」は第11期の、「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)」は第64期の決算を行いました。ここに、両ファンドの作成対象期間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／株式
信託期間	2031年4月25日まで(信託設定日:2021年1月5日)
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。</li> <li>・主要投資対象ファンドへの投資を通じて、環境または社会志向等の持続可能な投資テーマに積極的に取り組む、日本を含む世界各国の様々な企業の株式に投資します。</li> <li>・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。</li> <li>・実質的な組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。</li> </ul>
主要運用対象	<p>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) / 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)</p> <p>AB SICAV 1ーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ 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</p> <p>ルクセンブルグ籍円建外国投資証券「AB SICAV 1ーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ」 「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」</p> <p>日本を含む世界各国の株式等。</p> <p>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。</p>
組入制限	<p>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) / 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)</p> <p>AB SICAV 1ーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ 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</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</li> <li>・株式への直接投資は行いません。</li> <li>・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。</li> <li>・ファンドの借入総額は、純資産総額の10%を上限とします。</li> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
分配方針	<p>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)</p> <p>原則として、毎決算時(毎年4月25日および10月25日。休業日の場合は翌営業日)に以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>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)</p> <p>原則として、毎決算時(毎月25日。休業日の場合は翌営業日)に以下の方針に基づき分配を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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、将来の収益分配金の支払いおよび金額について保証するものではありません。</li> <li>・分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないこともあります。</li> <li>・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。</li> </ul>

## 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>

## アライアンス・バーンスタイン・世界SDGs株式ファンドの 投資対象ファンドの運用プロセス

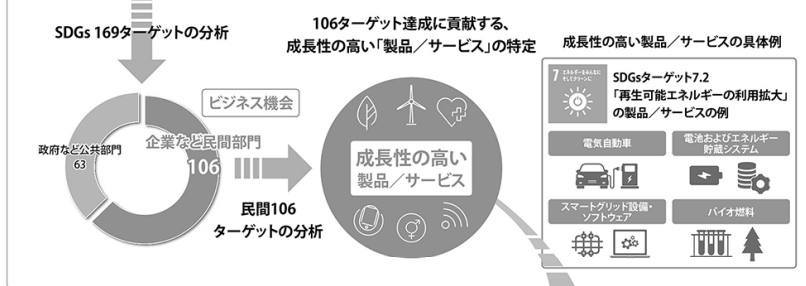
アライアンス・バーンスタイン・世界SDGs株式ファンドは、主要投資対象ファンドである「AB SICAV Iーサステナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ」への投資を通じて、SDGs達成への貢献が期待される日本を含む世界各国の企業の株式に投資します。下図のようなプロセスで、環境または社会志向等の持続可能な投資テーマに積極的に取り組む企業の株式に投資します。

### <運用プロセス>

株価指数の構成銘柄にとらわれず、SDGsを起点として調査対象銘柄群を幅広く特定することで、投資機会をもれなく追求



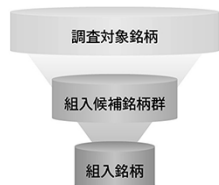
### STEP.1 SDGsに関連する製品／サービスの特定



### STEP.2 SDGsに関連する銘柄の特定 - 調査対象銘柄 -



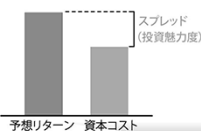
**STEP.3** SDGsに関連する投資魅力度の高い銘柄を厳選



- SDGs関連の高成長企業
- 高い投資魅力度

- テーマ・リサーチに基づき、各企業を徹底的に調査
- 組入候補銘柄に対して同一の銘柄評価基準を用いて投資魅力度を測定

【銘柄評価基準】  
 スプレッド(予想リターンと資本コスト\*の差)に基づく投資魅力度の測定



- 【分析手法】
- ▼ 予想リターン  
 ▼ 今後5年間の長期キャッシュフロー予想に基づき株価の予想リターン(年率)を算出
  - ▼ 資本コスト  
 ▼ ESG評価や事業リスク評価等によるリスク分析に基づき、独自の資本コストを算出

**スプレッドが大きい銘柄ほど魅力度が高いと判断し、組入れ**

\* 資本コストとは、株主・投資家が投資する資本に対して要求する最低利回り(期待収益率)を指します。

エンゲージメント



エンゲージメントとは“企業との対話”を意味します。主要投資対象ファンドでは、ポートフォリオ・マネジャーとアナリストが投資先企業の経営陣との継続的な対話を通じ、ESG面も含め、投資先企業の「株主価値」の向上を目指して積極的な提言を行っています。

※議論のテーマは炭素排出量、役員報酬、ダイバーシティ・エクイティ・インクルージョン(DEI)など、多岐にわたります。

# 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）

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配前)	税金 分配	み 金 騰 落	期中 騰 落 率	参考 指 数 騰 落 率	債券 組入 比率	債券 先物 比率	投資信託 組入 比率	純資産 総額	
										円
7期(2024年4月25日)	15,022		0	18.0	18,812	23.2	0.7	0.9	95.0	40,985
8期(2024年10月25日)	16,276		0	8.3	20,665	9.9	0.8	1.1	97.8	33,615
9期(2025年4月25日)	13,579		0	△16.6	18,973	△8.2	1.2	1.6	96.0	22,225
10期(2025年10月27日)	17,121		0	26.1	24,955	31.5	1.2	1.5	96.0	22,549
11期(2026年4月27日)	17,084		0	△0.2	28,047	12.4	1.6	1.9	98.1	17,398

(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	騰 落 率	参考 指 数	騰 落 率	債券 組入 比率	債券 先物 比率	投資信託 組入 比率
(期首) 2025年10月27日	17,121	—	24,955	—	1.2	1.5	96.0
10月末	17,197	0.4	25,232	1.1	1.2	1.5	95.2
11月末	16,793	△1.9	25,558	2.4	1.3	1.7	97.5
12月末	16,844	△1.6	26,081	4.5	1.4	1.7	97.2
2026年1月末	16,607	△3.0	26,350	5.6	1.5	1.8	97.8
2月末	16,550	△3.3	26,973	8.1	1.5	1.9	98.3
3月末	15,229	△11.1	25,155	0.8	1.8	2.1	98.4
(期末) 2026年4月27日	17,084	△0.2	28,047	12.4	1.6	1.9	98.1

(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。

※参考指数について

当ファンドの参考指数は「MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円ベース）」です。「MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円ベース）」は、原則として基準価額計算日前日付の「MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、米ドルベース）」の値を、委託会社が計算日付の為替レート（株式会社三菱UFJ銀行が発行する対顧客電売買相場の仲値）を用いて円換算したものです。

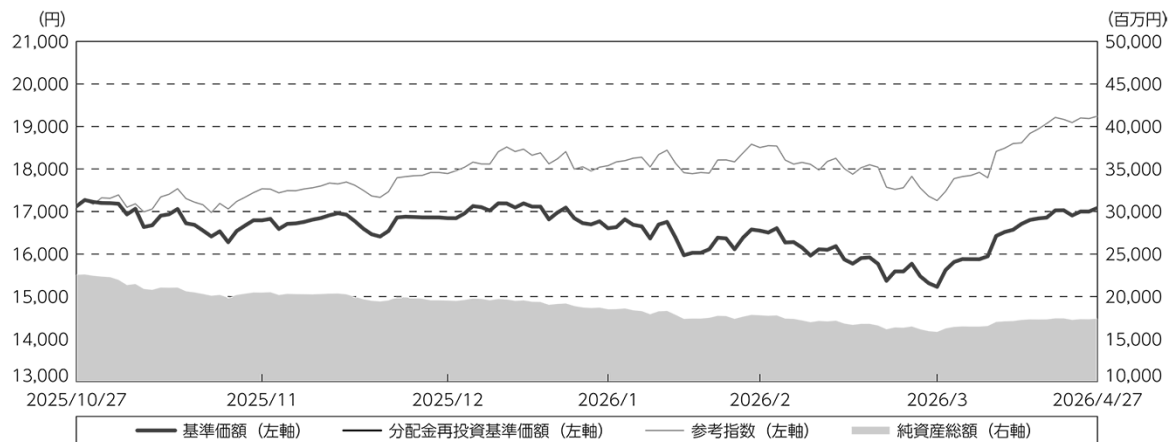
当該指数に係る著作権等の知的財産権、その他一切の権利は、当該指数等の開発元または公表元に帰属します。

## 運用経過

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）（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

（2025年10月28日～2026年4月27日）



期首：17,121円

期末：17,084円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：△ 0.2%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 上記騰落率は、小数第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、期首（2025年10月27日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 参考指数は、MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円ベース）です。

### ○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）は前期末比で下落しました。

### ○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主としてルクセンブルグ籍円建外国投資証券「AB SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスSIシェアーズ」への投資を通じて運用を行います。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

- ・円安米ドル高となったこと

#### 下落要因

- ・保有銘柄の価格下落

## 投資環境

(2025年10月28日～2026年4月27日)

### 【株式市場】

世界の株式市場は、前期末比で上昇しました(米ドルベース)。

2026年2月末にかけては、おおむね堅調に推移しました。堅調な人工知能(AI)需要を背景とする米国ハイテク株の上昇や、米国の利下げ期待、回復基調のユーロ圏景気などが株価を押し上げました。しかし3月以降は、米国とイスラエルによるイランへの軍事攻撃を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落しました。4月に入ると、米国・イランの和平協議の進展への期待から再び上昇しました。

### 【為替市場】

為替市場では、前期末比で円安米ドル高となりました。

2026年1月中旬にかけては、高市政権の財政運営が拡張的になるとの懸念や政府・日本銀行(日銀)による為替介入観測の後退を背景に円安米ドル高が進みました。その後は、日米当局による協調介入への警戒感が強まったことや高市政権による安定した政権運営への期待から、円高米ドル安となる局面がありました。2月半ば以降は、米国景気の底堅さが意識され利下げ観測が後退したことや、中東情勢の緊迫化を背景に安全資産としての米ドルの需要が高まったことから、再び円安米ドル高に推移しました。

## 運用概況

(2025年10月28日～2026年4月27日)

### 【当ファンド】

ルクセンブルグ籍円建外国投資証券「AB SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ」を主要投資対象とし、投資割合は高位を維持しました。

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 SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ】

SDGs\*達成への貢献が期待される日本を含む世界各国の企業の株式に投資することにより、信託財産の長期的な成長を目指しました。持続可能な投資テーマに適合し、世界で最も魅力的な証券を特定することを目的とし、「トップダウン」と「ボトムアップ」を組み合わせた投資プロセスを採用しました。

その結果、セクター配分においては、情報技術セクターなどを上位としました。国別配分においては、米国などを上位としました。

\*「SDGs(エスディージーズ; Sustainable Development Goals=持続可能な開発目標)」とは、貧困や不平等、環境破壊などの様々な問題を解決することを目指す、世界共通の目標です。17の目標(GOALS)と、より具体的な169のターゲットから構成されています。2015年9月の国連サミットで、2016年から2030年までの国際目標として採択されました。

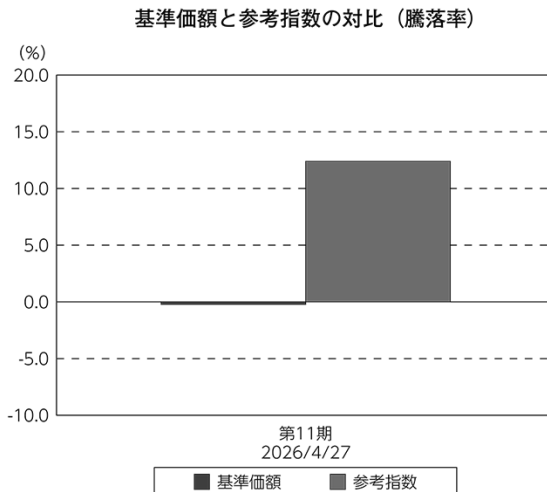
### 【アライアンス・バーンスタイン・日本債券インデックス・マザーファンド】

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

（2025年10月28日～2026年4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。右のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

（注）参考指数は、MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円ベース）です。

## 分配金

（2025年10月28日～2026年4月27日）

当期の収益分配については、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11期
	2025年10月28日～ 2026年4月27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	7,084

（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 SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ」を主要投資対象とし、投資割合は高位を維持します。

### 【AB SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ】

エネルギー転換やインフラ開発分野では、投資拡大の動きが一段と明確になっています。米国の電力需要は10年間の停滞を経て回復基調に転じており、電化やデータセンター建設の加速により送電網投資は年率1桁後半の増加が予想されています。さらに今後10年間で3兆4,000億米ドル規模の景気刺激策が見込まれており、当分野には追い風が吹いています。また、デジタル化、クリーンエネルギー、ヘルスケア分野のイノベーションも世界的な普及拡大により持続的な成長が期待されます。引き続き、強固なファンダメンタルズを基盤に、高い利益成長と規律ある資本配分を実現する企業の選別に注力します。

サステイナブル投資の「気候」、「健康」、「エンパワーメント」という3つの投資テーマは、世界の大きな流れとともに前進を続けており、このような強力な投資テーマから利益を生み出す企業を見極めることに注力しています。

引き続き、SDGs達成への貢献が期待される企業の株式に投資することで信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

### 【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。

## <ご参考>代表的な組入銘柄解説・SDGsの取組みについて

AB SICAV Iーサステナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズにおいて投資している銘柄は、基本的に持続可能な投資テーマに積極的に取り組む企業の株式です。代表的な組入銘柄について、SDGsが企業価値向上に資すると判断した根拠をご説明いたします。なお、以下は入手可能な直近のデータを掲載しております。

基準日：2026年3月31日

### アップル



SDGs目標：8「働きがいも経済成長も」

#### 【SDGsが企業価値向上に資すると判断した根拠】

世界的なテクノロジー企業。市中で使用されているiPhoneのうちアップグレードされていない台数が多くあり、今後複数年にわたるアップグレードサイクルに入るとみられる。端末でAI処理を行うエッジAIの活用から恩恵を受けると考えられ「ポケットの中のLLM(大規模言語モデル)」としての可能性が注目されている。また、SDGsの目標である生産性向上及び資源効率にも合致している。サステナビリティをはじめDEI(多様性・公平性・包括性)、サプライチェーン倫理の面でも顕著な進捗があり、現代の奴隷制リスクスコアも改善された。

### ウェイスト・マネジメント



SDGs目標：12「つくる責任つかう責任」

#### 【SDGsが企業価値向上に資すると判断した根拠】

廃棄物管理サービス分野における米国最大手企業。汚染削減、廃棄物の発生抑制、資源循環の向上に貢献。人口の増加に伴って年々増える廃棄物に対処する同社のような企業はサステナブルな社会実現のために不可欠な存在。廃棄物から排出されるメタンガスを再生可能な天然ガスとして廃棄物収集車の動力源とするなど、CO2(二酸化炭素)排出量を低く抑えている。事業の性質上、二酸化炭素排出は不可避である一方、それを大きく上回る二酸化炭素排出量削減に成功している。

### ネクステラ・エナジー



SDGs目標：7「エネルギーをみんなにそしてクリーンに」

#### 【SDGsが企業価値向上に資すると判断した根拠】

再生可能エネルギーによる発電・供給の世界的大手企業。米国での石炭から再生可能エネルギーやよりクリーンなガスへの転換を可能にする。風力や太陽光などの発電において50%以上のゼロカーボンを達成。合併した電力会社のガルフ・パワーは石炭を発電に使用しているが、近年中に石炭発電所をすべて閉鎖し、新たに太陽光発電や風力発電に置き換える予定。再生可能エネルギー業界の成長にけん引され、再生可能エネルギー発電量のさらなる増加を見込む中、企業利益が成長しており、持続可能な未来へのシフトにおける業界でのリーダーとみている。

※SDGsアイコンは、貢献するSDGsを指します(出所：国際連合)

## エンゲージメントについて

AB SICAV Iーサステナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオの運用戦略である「アライアンス・バーンスタイン・サステナブル・グローバル・テーマ株式戦略」のポートフォリオ・マネジャーとアナリストは、投資する企業の経営陣・取締役会メンバーに対し継続的にエンゲージメントを行います。その議論のトピックは、炭素排出量、役員報酬、ダイバーシティ・エクイティ・インクルージョン( DEI)など、環境・社会・ガバナンス(ESG)のさまざまなテーマにわたります。

過去のエンゲージメントについて、当社ホームページ(以下のURLの「月報・各種資料」)に『ESGエンゲージメント・レポート』を掲載していますので、ご参照ください。

<https://www.alliancebernstein.co.jp/retail/5247.html>

また、右の2次元コードをスマートフォン等のカメラで読み込むことで、直接ご覧いただけます。



○ 1 万口当たりの費用明細

(2025年10月28日～2026年4月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	75	0.452	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	( 5 )	(0.027)	委託した資金の運用、基準価額の発表等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(68)	(0.411)	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の提供等、口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 )	(0.013)	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	1	0.006	(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 ）	( 1 )	(0.006)	その他は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受益権の管理事務に係る費用、計理業務関係費用、印刷業者等に支払う法定書類の作成・印刷・提供等および届出に係る費用等
合 計	76	0.458	
期中の平均基準価額は、16,536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。

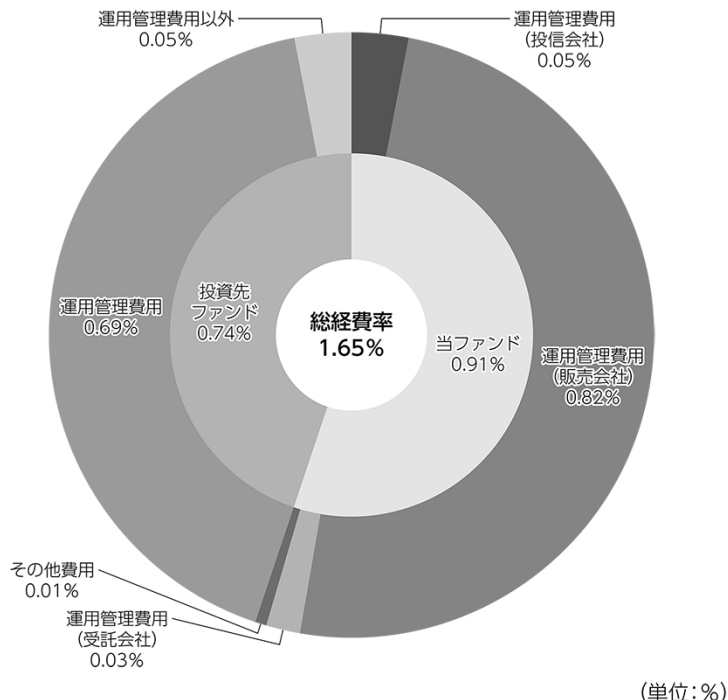
(注) 組入投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「主要投資対象ファンドの概要」に表示することとしております。

(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1.65%です。



総経費率(①+②+③)	1.65
①当ファンドの費用の比率	0.91
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.69
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.05

(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

(2025年10月28日～2026年4月27日)

### 投資信託証券

銘	柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国 (邦貨建)	AB SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマ ティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ	口	千円	口	千円
		—	—	254,567	4,532,660

(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

(2025年10月28日～2026年4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

(2026年4月27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 SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマ ティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ	1,190,816	936,249	17,062,204	98.1
	合 計	1,190,816	936,249	17,062,204	98.1

(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	296,016	296,016	329,229

(注) 単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

（2026年4月27日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 17,062,204	% 97.4
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	329,229	1.9
コール・ローン等、その他	128,316	0.7
投資信託財産総額	17,519,749	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（2026年4月27日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	17,519,749,565
コール・ローン等	109,723,527
投資信託受益証券(評価額)	17,062,204,710
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)	329,229,525
未収入金	18,590,000
未収利息	1,803
(B) 負債	121,243,372
未払解約金	35,323,025
未払信託報酬	84,797,756
その他未払費用	1,122,591
(C) 純資産総額(A-B)	17,398,506,193
元本	10,183,947,838
次期繰越損益金	7,214,558,355
(D) 受益権総口数	10,183,947,838口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,084円

（注）期首元本額13,170,920,180円、期中追加設定元本額20,103,617円、期中一部解約元本額3,007,075,959円。当期末現在における1口当たり純資産額1,7084円。

○損益の状況（2025年10月28日～2026年4月27日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	470,400
受取利息	470,400
(B) 有価証券売買損益	49,169,804
売買益	150,115,636
売買損	△ 100,945,832
(C) 信託報酬等	△ 85,920,347
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 36,280,143
(E) 前期繰越損益金	5,686,536,298
(F) 追加信託差損益金	1,564,302,200
(配当等相当額)	( 858,483,243)
(売買損益相当額)	( 705,818,957)
(G) 計(D+E+F)	7,214,558,355
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	7,214,558,355
追加信託差損益金	1,564,302,200
(配当等相当額)	( 858,483,243)
(売買損益相当額)	( 705,818,957)
分配準備積立金	5,686,536,298
繰越損益金	△ 36,280,143

（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に対する消費税等相当額およびその他費用等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11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(0円)、収益調整金額(1,528,022,057円)および分配準備積立金額(5,686,536,298円)より分配対象収益額は7,214,558,355円(10,000口当たり7,084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
-----------------	----

## ○お知らせ

---

2025年10月28日以降において、当ファンドの信託約款について、以下に掲げる事項を内容とする変更を行いました。

2026年4月1日付で「一般社団法人投資信託協会」が「一般社団法人日本投資顧問業協会」と合併し、「一般社団法人資産運用業協会」が発足したため、信託約款中に「一般社団法人投資信託協会」とあるのを「一般社団法人資産運用業協会」に変更しました。

（変更日：2026年4月1日）

# 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）

## ○最近30期の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落	期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
35期(2023年11月27日)	10,663	100	8.1	16,381	7.3	0.5	0.6	98.3	21,774
36期(2023年12月25日)	10,574	100	0.1	16,250	△0.8	0.5	0.7	97.5	20,478
37期(2024年1月25日)	10,778	200	3.8	17,138	5.5	0.6	0.7	98.5	19,852
38期(2024年2月26日)	11,228	200	6.0	18,166	6.0	0.6	0.7	97.5	19,797
39期(2024年3月25日)	11,252	200	2.0	18,810	3.5	0.6	0.7	97.5	19,379
40期(2024年4月25日)	10,871	100	△2.5	18,812	0.0	0.6	0.8	97.2	17,830
41期(2024年5月27日)	11,400	200	6.7	19,823	5.4	0.6	0.8	97.3	18,058
42期(2024年6月25日)	11,376	200	1.5	20,437	3.1	0.6	0.8	96.4	17,576
43期(2024年7月25日)	10,774	200	△3.5	19,697	△3.6	0.7	0.9	97.0	15,868
44期(2024年8月26日)	10,550	100	△1.2	19,124	△2.9	0.7	0.9	96.4	15,184
45期(2024年9月25日)	10,486	100	0.3	19,419	1.5	0.8	1.0	96.3	14,324
46期(2024年10月25日)	10,733	200	4.3	20,665	6.4	0.8	1.0	97.1	13,995
47期(2024年11月25日)	10,779	100	1.4	21,177	2.5	0.9	1.1	95.1	12,969
48期(2024年12月25日)	10,553	100	△1.2	21,681	2.4	1.0	1.2	97.4	11,692
49期(2025年1月27日)	10,665	100	2.0	21,866	0.9	1.0	1.2	96.2	11,298
50期(2025年2月25日)	9,789	0	△8.2	21,074	△3.6	1.2	1.4	94.6	9,778
51期(2025年3月25日)	9,576	0	△2.2	20,745	△1.6	1.2	1.5	95.3	9,309
52期(2025年4月25日)	8,722	0	△8.9	18,973	△8.5	1.3	1.7	95.9	8,213
53期(2025年5月26日)	9,376	0	7.5	20,082	5.8	1.3	1.6	96.2	8,498
54期(2025年6月25日)	9,872	0	5.3	21,254	5.8	1.3	1.6	95.7	8,567
55期(2025年7月25日)	10,191	100	4.2	22,537	6.0	1.3	1.6	95.7	8,577
56期(2025年8月25日)	10,107	100	0.2	22,903	1.6	1.3	1.7	95.6	8,206
57期(2025年9月25日)	10,229	100	2.2	23,706	3.5	1.3	1.7	95.8	8,055
58期(2025年10月27日)	10,579	100	4.4	24,955	5.3	1.3	1.7	96.0	8,091
59期(2025年11月25日)	10,218	0	△3.4	25,124	0.7	1.4	1.8	95.4	7,588
60期(2025年12月25日)	10,314	100	1.9	26,018	3.6	1.5	1.9	96.3	7,263
61期(2026年1月26日)	10,203	100	△0.1	26,234	0.8	1.6	1.9	96.3	6,905
62期(2026年2月25日)	9,926	0	△2.7	26,786	2.1	1.7	2.1	97.3	6,447
63期(2026年3月25日)	9,451	0	△4.8	25,593	△4.5	1.9	2.3	97.3	5,808
64期(2026年4月27日)	10,243	100	9.4	28,047	9.6	1.9	2.2	96.4	6,012

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(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。

### ※参考指数について

当ファンドの参考指数は「MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円ベース）」です。「MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円ベース）」は、原則として基準価額計算前日付の「MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（配当込み、米ドルベース）」の値を、委託会社が計算日付の為替レート（株式会社三菱UFJ銀行が発行する対顧客電汇売買相場の仲値）を用いて円換算したものです。

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

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準 価 額		参 考 指 数		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
第59期	(期 首)	円	%		%	%	%	%
	2025年10月27日	10,579	—	24,955	—	1.3	1.7	96.0
	10月末	10,625	0.4	25,232	1.1	1.4	1.7	97.0
	(期 末)							
第60期	2025年11月25日	10,218	△3.4	25,124	0.7	1.4	1.8	95.4
	(期 首)							
	2025年11月25日	10,218	—	25,124	—	1.4	1.8	95.4
	11月末	10,372	1.5	25,558	1.7	1.4	1.8	97.5
第61期	(期 末)							
	2025年12月25日	10,414	1.9	26,018	3.6	1.5	1.9	96.3
	(期 首)							
	2025年12月25日	10,314	—	26,018	—	1.5	1.9	96.3
第62期	12月末	10,303	△0.1	26,081	0.2	1.5	1.9	96.9
	(期 末)							
	2026年1月26日	10,303	△0.1	26,234	0.8	1.6	1.9	96.3
	(期 首)							
第63期	2026年1月26日	10,203	—	26,234	—	1.6	1.9	96.3
	1月末	10,061	△1.4	26,350	0.4	1.6	2.0	97.1
	(期 末)							
	2026年2月25日	9,926	△2.7	26,786	2.1	1.7	2.1	97.3
第64期	(期 首)							
	2026年2月25日	9,926	—	26,786	—	1.7	2.1	97.3
	2月末	10,026	1.0	26,973	0.7	1.7	2.1	97.3
	(期 末)							
第65期	2026年3月25日	9,451	△4.8	25,593	△4.5	1.9	2.3	97.3
	(期 首)							
	2026年3月25日	9,451	—	25,593	—	1.9	2.3	97.3
	3月末	9,234	△2.3	25,155	△1.7	2.0	2.4	96.8
第66期	(期 末)							
	2026年4月27日	10,343	9.4	28,047	9.6	1.9	2.2	96.4

(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) 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。

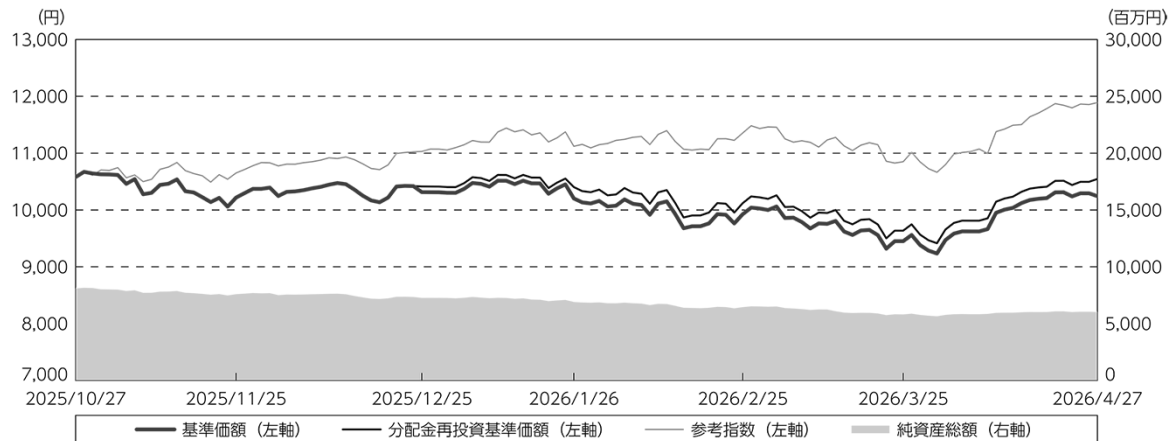
(注) 月末は、各月の最終営業日です。

## 運用経過

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）（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

（2025年10月28日～2026年4月27日）



第59期首：10,579円

第64期末：10,243円（既払分配金（税込み）：300円）

騰落率：△ 0.3%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 上記騰落率は、小数第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、作成期首（2025年10月27日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 参考指数は、MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円ベース）です。

### ○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）は前作成期末比で下落しました。

### ○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主としてルクセンブルグ籍円建外国投資証券「AB SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスSIシェアーズ」への投資を通じて運用を行います。当作成期間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

- ・円安米ドル高となったこと

#### 下落要因

- ・保有銘柄の価格下落

## 投資環境

(2025年10月28日～2026年4月27日)

### 【株式市場】

世界の株式市場は、前作成期末比で上昇しました(米ドルベース)。

2026年2月末にかけては、おおむね堅調に推移しました。堅調な人工知能(AI)需要を背景とする米国ハイテク株の上昇や、米国の利下げ期待、回復基調のユーロ圏景気などが株価を押し上げました。しかし3月以降は、米国とイスラエルによるイランへの軍事攻撃を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落しました。4月に入ると、米国・イランの和平協議の進展への期待から再び上昇しました。

### 【為替市場】

為替市場では、前作成期末比で円安米ドル高となりました。

2026年1月中旬にかけては、高市政権の財政運営が拡張的になるとの懸念や政府・日本銀行(日銀)による為替介入観測の後退を背景に円安米ドル高が進みました。その後は、日米当局による協調介入への警戒感が強まったことや高市政権による安定した政権運営への期待から、円高米ドル安となる局面がありました。2月半ば以降は、米国景気の底堅さが意識され利下げ観測が後退したことや、中東情勢の緊迫化を背景に安全資産としての米ドルの需要が高まったことから、再び円安米ドル高に推移しました。

## 運用概況

(2025年10月28日～2026年4月27日)

### 【当ファンド】

ルクセンブルグ籍円建外国投資証券「AB SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ」を主要投資対象とし、投資割合は高位を維持しました。

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 SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ】

SDGs\*達成への貢献が期待される日本を含む世界各国の企業の株式に投資することにより、信託財産の長期的な成長を目指しました。持続可能な投資テーマに適合し、世界で最も魅力的な証券を特定することを目的とし、「トップダウン」と「ボトムアップ」を組み合わせた投資プロセスを採用しました。

その結果、セクター配分においては、情報技術セクターなどを上位としました。国別配分においては、米国などを上位としました。

\*「SDGs(エスディージーズ; Sustainable Development Goals=持続可能な開発目標)」とは、貧困や不平等、環境破壊などの様々な問題を解決することを目指す、世界共通の目標です。17の目標(GOALS)と、より具体的な169のターゲットから構成されています。2015年9月の国連サミットで、2016年から2030年までの国際目標として採択されました。

### 【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】

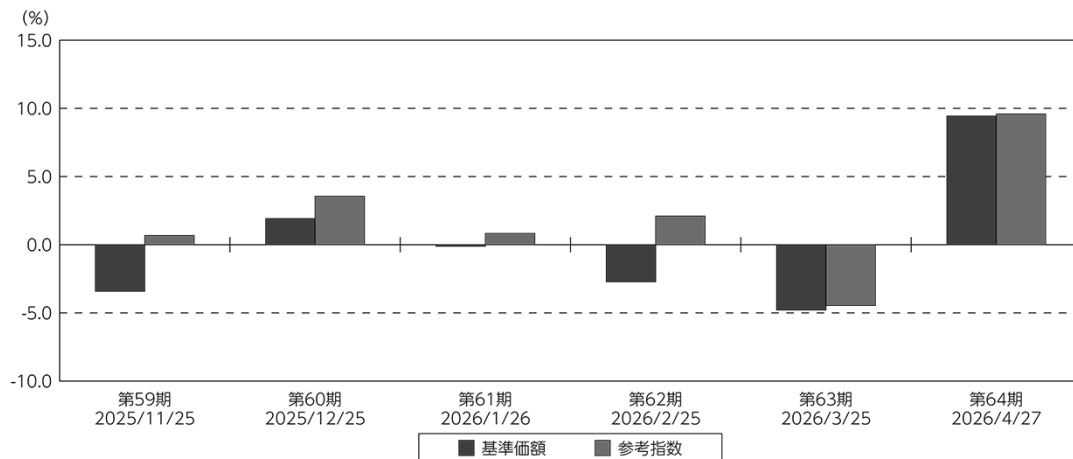
主としてわが国の国債および国内外の主要取引所に上場する債券先物に投資することにより、信託財産の成長を図ることを目標とし、日本国債の長期国債先物への投資を行いました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

（2025年10月28日～2026年4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、MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円ベース）です。

## 分配金

（2025年10月28日～2026年4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：300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59期	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期
	2025年10月28日～ 2025年11月25日	2025年11月26日～ 2025年12月25日	2025年12月26日～ 2026年1月26日	2026年1月27日～ 2026年2月25日	2026年2月26日～ 2026年3月25日	2026年3月26日～ 2026年4月27日
当期分配金	－	100	100	－	－	100
（対基準価額比率）	－%	0.960%	0.971%	－%	－%	0.967%
当期の収益	－	0	－	－	－	0
当期の収益以外	－	99	100	－	－	99
翌期繰越分配対象額	264	313	203	64	64	243

（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

### 【当ファンド】

ルクセンブルグ籍円建外国投資証券「AB SICAV Iーサステナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ」を主要投資対象とし、投資割合は高位を維持します。

### 【AB SICAV Iーサステナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ】

エネルギー転換やインフラ開発分野では、投資拡大の動きが一段と明確になっています。米国の電力需要は10年間の停滞を経て回復基調に転じており、電化やデータセンター建設の加速により送電網投資は年率1桁後半の増加が予想されています。さらに今後10年間で3兆4,000億米ドル規模の景気刺激策が見込まれており、当分野には追い風が吹いています。また、デジタル化、クリーンエネルギー、ヘルスケア分野のイノベーションも世界的な普及拡大により持続的な成長が期待されます。引き続き、強固なファンダメンタルズを基盤に、高い利益成長と規律ある資本配分を実現する企業の選別に注力します。

サステナブル投資の「気候」、「健康」、「エンパワーメント」という3つの投資テーマは、世界の大きな流れとともに前進を続けており、このような強力な投資テーマから利益を生み出す企業を見極めることに注力しています。

引き続き、SDGs達成への貢献が期待される企業の株式に投資することで信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

### 【アラライアンス・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。

## <ご参考>代表的な組入銘柄解説・SDGsの取組みについて

AB SICAV Iーサステナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズにおいて投資している銘柄は、基本的に持続可能な投資テーマに積極的に取り組む企業の株式です。代表的な組入銘柄について、SDGsが企業価値向上に資すると判断した根拠をご説明いたします。なお、以下は入手可能な直近のデータを掲載しております。

基準日：2026年3月31日

### アップル



SDGs目標：8「働きがいも経済成長も」

#### 【SDGsが企業価値向上に資すると判断した根拠】

世界的なテクノロジー企業。市中で使用されているiPhoneのうちアップグレードされていない台数が多くあり、今後複数年にわたるアップグレードサイクルに入るとみられる。端末でAI処理を行うエッジAIの活用から恩恵を受けると考えられ「ポケットの中のLLM(大規模言語モデル)」としての可能性が注目されている。また、SDGsの目標である生産性向上及び資源効率にも合致している。サステナビリティをはじめDEI(多様性・公平性・包括性)、サプライチェーン倫理の面でも顕著な進展があり、現代の奴隷制リスクスコアも改善された。

### ウェイスト・マネジメント



SDGs目標：12「つくる責任つかう責任」

#### 【SDGsが企業価値向上に資すると判断した根拠】

廃棄物管理サービス分野における米国最大手企業。汚染削減、廃棄物の発生抑制、資源循環の向上に貢献。人口の増加に伴って年々増える廃棄物に対処する同社のような企業はサステナブルな社会実現のために不可欠な存在。廃棄物から排出されるメタンガスを再生可能な天然ガスとして廃棄物収集車の動力源とするなど、CO2(二酸化炭素)排出量を低く抑えている。事業の性質上、二酸化炭素排出は不可避である一方、それを大きく上回る二酸化炭素排出量削減に成功している。

### ネクステラ・エナジー



SDGs目標：7「エネルギーをみんなにそしてクリーンに」

#### 【SDGsが企業価値向上に資すると判断した根拠】

再生可能エネルギーによる発電・供給の世界的大手企業。米国での石炭から再生可能エネルギーやよりクリーンなガスへの転換を可能にする。風力や太陽光などの発電において50%以上のゼロカーボン達成。合併した電力会社のガルフ・パワーは石炭を発電に使用しているが、近年中に石炭発電所をすべて閉鎖し、新たに太陽光発電や風力発電に置き換える予定。再生可能エネルギー業界の成長にけん引され、再生可能エネルギー発電量のさらなる増加を見込む中、企業利益が成長しており、持続可能な未来へのシフトにおける業界でのリーダーとみている。

※SDGsアイコンは、貢献するSDGsを指します(出所：国際連合)

## エンゲージメントについて

AB SICAV Iーサステナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオの運用戦略である「アライアンス・バーンスタイン・サステナブル・グローバル・テーマ株式戦略」のポートフォリオ・マネジャーとアナリストは、投資する企業の経営陣・取締役会メンバーに対し継続的にエンゲージメントを行います。その議論のトピックは、炭素排出量、役員報酬、ダイバーシティ・エクイティ・インクルージョン( DEI)など、環境・社会・ガバナンス(ESG)のさまざまなテーマにわたります。

過去のエンゲージメントについて、当社ホームページ(以下のURLの「月報・各種資料」)に『ESGエンゲージメント・レポート』を掲載していますので、ご参照ください。

<https://www.alliancebernstein.co.jp/retail/5246.html>

また、右の2次元コードをスマートフォン等のカメラで読み込むことで、直接ご覧いただけます。



○ 1万口当たりの費用明細

(2025年10月28日～2026年4月27日)

項 目	第59期～第64期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 ) ( 受 託 会 社 )	円 46 ( 3 ) (42) ( 1 )	% 0.452 (0.027) (0.411) (0.013)	(a) 信託報酬＝作成期間中の平均基準価額×信託報酬率  委託した資金の運用、基準価額の発表等の対価  購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の提供等、口内でのファンドの管理および事務手続き等の対価  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 ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	0 ( 0 )	0.000 (0.000)	(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  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 ( そ の 他 )	1 ( 1 )	0.010 (0.010)	(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  その他は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受益権の管理事務に係る費用、計理業務関係費用、印刷業者等に支払う法定書類の作成・印刷・提供等および届出に係る費用等
合 計	47	0.462	
作成期間中の平均基準価額は、10,103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) 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。

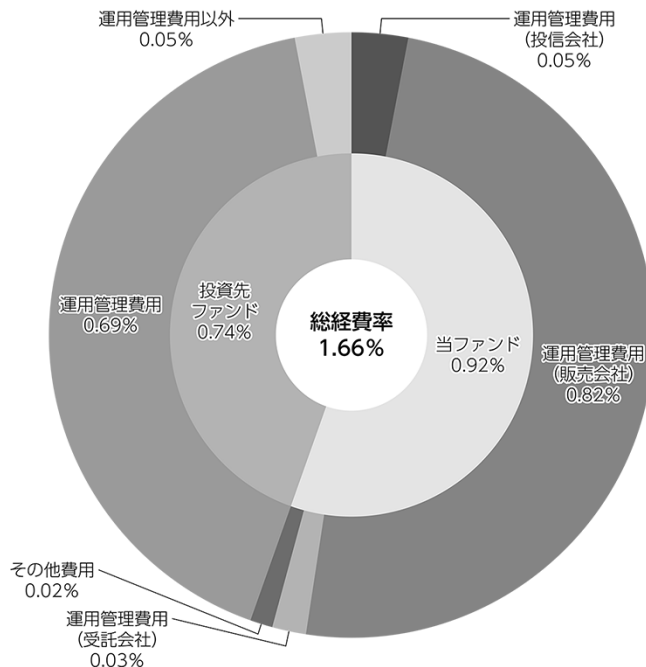
(注) 組入投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「主要投資対象ファンドの概要」に表示することとしております。

(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1.66%です。



(単位:%)

<b>総経費率(①+②+③)</b>	<b>1.66</b>
①当ファンドの費用の比率	0.92
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.69
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.05

(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

(2025年10月28日～2026年4月27日)

### 投資信託証券

銘		第59期～第64期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外国 (邦貨建)	AB SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマ ティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ	口 18,968	千円 339,344	口 128,204	千円 2,264,140

(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

(2025年10月28日～2026年4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

(2026年4月27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		第58期末		第64期末	
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
	AB SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマ ティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ	口 427,365	口 318,129	千円 5,797,589	% 96.4
合	計	427,365	318,129	5,797,589	96.4

(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		第58期末		第64期末	
		口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
	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	千口 119,176	千口 119,176	千円 132,547	千円 132,547

(注) 単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

（2026年4月27日現在）

項 目	第64期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 5,797,589	% 95.4
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	132,547	2.2
コール・ローン等、その他	147,909	2.4
投資信託財産総額	6,078,045	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

項 目	第59期末	第60期末	第61期末	第62期末	第63期末	第64期末
	2025年11月25日現在	2025年12月25日現在	2026年1月26日現在	2026年2月25日現在	2026年3月25日現在	2026年4月27日現在
	円	円	円	円	円	円
<b>(A) 資産</b>	<b>7,606,682,772</b>	<b>7,363,992,284</b>	<b>6,994,265,518</b>	<b>6,480,874,941</b>	<b>5,830,527,742</b>	<b>6,078,045,977</b>
コール・ローン等	221,692,420	206,103,416	206,037,438	69,148,498	30,400,398	146,016,094
投資信託受益証券(評価額)	7,238,209,765	6,996,371,235	6,647,854,951	6,276,877,639	5,651,938,750	5,797,589,912
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)	136,468,462	134,764,245	133,679,743	134,847,668	133,918,095	132,547,571
未収入金	10,310,000	26,750,000	6,690,000	—	14,270,000	1,890,000
未収利息	2,125	3,388	3,386	1,136	499	2,400
<b>(B) 負債</b>	<b>18,392,995</b>	<b>100,976,710</b>	<b>89,114,159</b>	<b>32,887,316</b>	<b>21,898,117</b>	<b>65,777,177</b>
未払収益分配金	—	70,422,132	67,676,105	—	—	58,695,472
未払解約金	12,650,311	24,840,493	15,575,096	27,841,795	17,510,864	2,123,549
未払信託報酬	5,612,654	5,584,707	5,730,205	4,931,280	4,287,918	4,845,896
その他未払費用	130,030	129,378	132,753	114,241	99,335	112,260
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>7,588,289,777</b>	<b>7,263,015,574</b>	<b>6,905,151,359</b>	<b>6,447,987,625</b>	<b>5,808,629,625</b>	<b>6,012,268,800</b>
元本	7,426,536,129	7,042,213,285	6,767,610,562	6,496,197,245	6,145,981,625	5,869,547,264
次期繰越損益金	161,753,648	220,802,289	137,540,797	△ 48,209,620	△ 337,352,000	142,721,536
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>7,426,536,129口</b>	<b>7,042,213,285口</b>	<b>6,767,610,562口</b>	<b>6,496,197,245口</b>	<b>6,145,981,625口</b>	<b>5,869,547,264口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	10,218円	10,314円	10,203円	9,926円	9,451円	10,243円

（注）第59期首元本額7,648,565,696円、第59～64期中追加設定元本額15,522,060円、第59～64期中一部解約元本額1,794,540,492円。第64期末現在における1口当たり純資産額1,0243円。

## ○損益の状況

項 目	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期
	2025年10月28日～ 2025年11月25日	2025年11月26日～ 2025年12月25日	2025年12月26日～ 2026年1月26日	2026年1月27日～ 2026年2月25日	2026年2月26日～ 2026年3月25日	2026年3月26日～ 2026年4月27日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	32,237	38,748	65,211	35,787	36,796	34,191
受取利息	32,237	38,748	65,211	35,787	36,796	34,191
(B) 有価証券売買損益	△262,345,176	143,513,544	△1,203,661	△175,219,549	△287,384,467	528,512,543
売買益	2,837,223	151,275,147	4,151,293	7,770,001	6,411,682	539,927,474
売買損	△265,182,399	△7,761,603	△5,354,954	△182,989,550	△293,796,149	△11,414,931
(C) 信託報酬等	△5,742,684	△5,714,085	△5,862,958	△5,045,521	△4,387,253	△4,958,156
(D) 当期損益金(A+B+C)	△268,055,623	137,838,207	△7,001,408	△180,229,283	△291,734,924	523,588,578
(E) 前期繰越損益金	160,664,720	△101,830,100	△33,045,101	△103,336,465	△268,264,227	△534,799,274
(F) 追加信託差損益金	269,144,551	255,216,314	245,263,411	235,356,128	222,647,151	212,627,704
(配当等相当額)	(35,892,691)	(34,040,015)	(32,776,887)	(31,469,137)	(29,773,211)	(28,434,292)
(売買損益相当額)	(233,251,860)	(221,176,299)	(212,486,524)	(203,886,991)	(192,873,940)	(184,193,412)
(G) 計(D+E+F)	161,753,648	291,224,421	205,216,902	△48,209,620	△337,352,000	201,417,008
(H) 収益分配金	0	△70,422,132	△67,676,105	0	0	△58,695,472
次期繰越損益金(G+H)	161,753,648	220,802,289	137,540,797	△48,209,620	△337,352,000	142,721,536
追加信託差損益金	269,144,551	255,216,314	245,263,411	235,356,128	222,647,151	163,520,149
(配当等相当額)	(35,892,691)	(34,040,015)	(32,776,887)	(31,469,137)	(29,773,211)	(—)
(売買損益相当額)	(233,251,860)	(221,176,299)	(212,486,524)	(203,886,991)	(192,873,940)	(163,520,149)
分配準備積立金	160,664,720	81,960,250	11,023,927	10,575,067	10,004,422	—
繰越損益金	△268,055,623	△116,374,275	△118,746,541	△294,140,815	△570,003,573	△20,798,613

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額およびその他費用等を含めて表示しています。

(注) (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59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(0円)、収益調整金額(35,892,691円)および分配準備積立金額(160,664,720円)より分配対象収益額は196,557,411円(10,000口当たり264円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第60期計算期間末における費用控除後の配当等収益額(37,034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(138,842,039円)および分配準備積立金額(152,345,348円)より分配対象収益額は291,224,421円(10,000口当たり413円)であり、うち70,422,132円(10,000口当たり100円)を分配金額としております。

(注) 第61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(0円)、収益調整金額(78,700,032円)および分配準備積立金額(11,023,927円)より分配対象収益額は205,216,902円(10,000口当たり303円)であり、うち67,676,105円(10,000口当たり100円)を分配金額としております。

(注) 第62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(0円)、収益調整金額(31,469,137円)および分配準備積立金額(10,575,067円)より分配対象収益額は42,044,204円(10,000口当たり64円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第63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(0円)、収益調整金額(29,773,211円)および分配準備積立金額(10,004,422円)より分配対象収益額は39,777,633円(10,000口当たり64円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第64期計算期間末における費用控除後の配当等収益額(33,695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(191,829,091円)および分配準備積立金額(9,554,222円)より分配対象収益額は201,417,008円(10,000口当たり343円)であり、うち58,695,472円(10,000口当たり100円)を分配金額としております。

## ○分配金のお知らせ

	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期
1万口当たり分配金（税込み）	0円	100円	100円	0円	0円	100円

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

### ◇課税上の取扱い

#### ①分配金の課税について

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

#### ②個人の課税上の取扱い

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

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

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

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

## ○お知らせ

2025年10月28日以降において、当ファンドの信託約款について、以下に掲げる事項を内容とする変更を行いました。

2026年4月1日付で「一般社団法人投資信託協会」が「一般社団法人日本投資顧問業協会」と合併し、「一般社団法人資産運用業協会」が発足したため、信託約款中に「一般社団法人投資信託協会」とあるのを「一般社団法人資産運用業協会」に変更しました。

（変更日：2026年4月1日）

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2026年4月27日現在）

<アラライアンス・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(90,933,434千口)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 B B 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	86,600,000 (86,600,000)	86,508,850 (86,508,850)	85.5 (85.5)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	85.5 (85.5)
合 計	86,600,000 (86,600,000)	86,508,850 (86,508,850)	85.5 (85.5)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	85.5 (85.5)

(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1313回国庫短期証券	—	29,000,000	28,968,128	2026/6/22
第1319回国庫短期証券	—	28,000,000	27,948,536	2026/7/21
第1342回国庫短期証券	—	29,600,000	29,592,185	2026/5/11
合 計		86,600,000	86,508,850	

(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	百万円
	101,036	—

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) 一印は該当なし。

# AB SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ

2025年5月31日決算  
(計算期間：2024年6月1日～2025年5月31日)

形態	ルクセンブルグ籍円建外国投資証券
投資目的	信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を含む世界各国の株式等
投資方針	<ul style="list-style-type: none"><li>・ファンドは、環境または社会志向等の持続可能な投資テーマに積極的に取り組む、世界各国の様々な企業の株式等に投資することにより、成長機会を追求し、投資目的の達成を目指します。</li><li>・ファンドは、持続可能な投資テーマに適合し、世界で最も魅力的な証券を特定することを目的とし、「トップダウン」と「ボトムアップ」を組み合わせた投資プロセスを採用します。</li><li>・「トップダウン」のテーマ別アプローチに加えて、「ボトムアップ」アプローチは、環境、社会、企業統治など「ESG要因」への企業のエクスポージャー、ならびに企業経営の将来の収益成長、評価、および品質に焦点を当てます。</li><li>・個別銘柄の選択を投資リターンを主な源泉とするため、株式ポートフォリオの状況に応じ、外国為替予約や通貨関連デリバティブ取引等を用いて、通貨構成比を調整することがあります。</li></ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"><li>・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。</li><li>・ファンドの借入総額は、純資産総額の10%を上限とします。</li></ul>
ベンチマーク	MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス (ACWI)
決算日	毎年5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 SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ 円建てクラスS1シェアーズ」は「AB SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ」のシェアクラスの1つです。

以下は「AB SICAV Iーサステイナブル・グローバル・シーマティック・ポートフォリオ」の決算日である2025年5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が抜粋・翻訳したのですが、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の法律に基づいて監査を受けております。

(1) 資産・負債計算書 (2025年5月31日現在)

	Sustainable Global Thematic Portfolio (USD)
<b>資 産</b>	
投資有価証券一時価	\$1,895,780,342
定期預金	107,101,059
保管銀行およびブローカーにおける現金	1,846,616
ファンド株式販売未収金	283,583
未収配当金および未収利息	2,249,548
投資有価証券売却未収金	3,071,359
為替先渡契約未実現評価益	7,784,399
有価証券貸付未収収益	1,177
その他未収金	252,339
	<u>2,018,370,422</u>
<b>負 債</b>	
投資有価証券購入未払金	1
ファンド株式買戻未払金	21,999,775
為替先渡契約未実現評価損	6,026,819
保管銀行およびブローカーに対する未払金	291,000
未払費用およびその他債務	3,775,231
	<u>32,092,826</u>
<b>純 資 産</b>	<u>\$1,986,277,596</u>

(2) 損益計算書および純資産変動計算書 (2024年6月1日～2025年5月31日)

Sustainable Global  
Thematic Portfolio  
(USD)

**投資収益**

配当金 (純額)	\$18,694,809
利息	2,650,141
有価証券貸付収益 (純額)	4,544
	21,349,494

**費用**

管理報酬	25,744,763
管理会社報酬	713,636
税金	743,628
名義書換代行報酬	896,904
販売報酬	146,077
保管報酬	261,325
専門家報酬	269,685
会計および管理事務代行報酬	129,712
印刷費	44,973
その他	217,990
	29,168,693

費用の払戻しまたは権利放棄

費用純額 0純投資収益／(損失) 29,168,693(7,819,199)**実現利益および(損失)**

投資有価証券、為替先渡契約、スワップ、金融先物契約、 オプションおよび通貨	288,452,711
資本源泉税	(277,979)

**未実現利益および(損失)の変動**

投資有価証券	(204,257,033)
為替先渡契約	5,359,805
外貨	24,979
運用実績	81,483,284

**ファンド株式の取引**

増加／(減少)	(872,398,174)
配当金	(1,487,722)

**純資産**

期首	2,778,680,208
為替換算調整	0
期末	\$1,986,277,596

## (3) 投資明細表 (2025年5月31日現在)

	Shares	Value (USD)	Net Assets %
<b>TRANSFERABLE SECURITIES QUOTED ON A STOCK EXCHANGE OR DEALT IN ON ANOTHER REGULATED MARKET</b>			
<b>COMMON STOCKS</b>			
<b>INFORMATION TECHNOLOGY</b>			
<b>COMMUNICATIONS EQUIPMENT</b>			
Xiaomi Corp. - Class H .....	3,727,600	\$ 23,994,604	1.2%
<b>ELECTRONIC EQUIPMENT, INSTRUMENTS &amp; COMPONENTS</b>			
Flex Ltd. ....	1,461,920	61,839,216	3.1
Halma PLC. ....	956,243	37,488,630	1.9
Keyence Corp. ....	44,700	18,710,094	0.9
Zebra Technologies Corp. - Class A .....	73,700	21,356,049	1.1
		<u>139,393,989</u>	<u>7.0</u>
<b>SEMICONDUCTORS &amp; SEMICONDUCTOR EQUIPMENT</b>			
Broadcom, Inc. ....	163,420	39,559,079	2.0
Monolithic Power Systems, Inc. ....	29,998	19,855,676	1.0
NVIDIA Corp. ....	453,425	61,271,320	3.1
NXP Semiconductors NV .....	101,526	19,404,664	1.0
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. ....	1,838,000	58,621,246	2.9
		<u>198,711,985</u>	<u>10.0</u>
<b>SOFTWARE</b>			
Cadence Design Systems, Inc. ....	93,985	26,980,274	1.4
Microsoft Corp. ....	175,919	80,986,071	4.1
Palo Alto Networks, Inc. ....	207,334	39,895,208	2.0
Salesforce, Inc. ....	156,990	41,660,436	2.1
SAP SE .....	131,510	39,784,427	2.0
		<u>229,306,416</u>	<u>11.6</u>
<b>TECHNOLOGY HARDWARE, STORAGE &amp; PERIPHERALS</b>			
Apple, Inc. ....	164,230	32,985,596	1.7
Lenovo Group Ltd. - Class H. ....	12,486,000	14,254,252	0.7
		<u>47,239,848</u>	<u>2.4</u>
		<u>638,646,842</u>	<u>32.2</u>
<b>INDUSTRIALS</b>			
<b>COMMERCIAL SERVICES &amp; SUPPLIES</b>			
Tetra Tech, Inc. ....	961,448	33,592,993	1.7
Veralto Corp. ....	483,193	48,816,989	2.5
		<u>82,409,982</u>	<u>4.2</u>
<b>CONSTRUCTION &amp; ENGINEERING</b>			
AECOM .....	371,366	40,794,555	2.1
WSP Global, Inc. ....	173,653	35,583,459	1.8
		<u>76,378,014</u>	<u>3.9</u>
<b>ELECTRICAL EQUIPMENT</b>			
Emerson Electric Co. ....	324,250	38,708,965	1.9
Prisma SpA .....	561,742	36,126,774	1.8
Rockwell Automation, Inc. ....	154,201	48,658,126	2.4
		<u>123,493,865</u>	<u>6.1</u>
<b>PROFESSIONAL SERVICES</b>			
Experian PLC. ....	656,428	32,693,595	1.6
RELX PLC. ....	454,965	24,483,568	1.2
		<u>57,177,163</u>	<u>2.8</u>
		<u>339,459,024</u>	<u>17.0</u>
<b>FINANCIALS</b>			
<b>BANKS</b>			
NU Holdings Ltd./Cayman Islands - Class A .....	1,126,495	13,529,205	0.7
<b>CAPITAL MARKETS</b>			
Jefferies Financial Group, Inc. ....	505,677	24,575,902	1.2
London Stock Exchange Group PLC. ....	363,096	55,247,558	2.8
LPL Financial Holdings, Inc. ....	111,060	42,997,990	2.2
Partners Group Holding AG(a) .....	16,762	22,500,789	1.1
TMX Group Ltd. ....	479,990	19,401,061	1.0
		<u>164,723,300</u>	<u>8.3</u>
<b>FINANCIAL SERVICES</b>			
Fiserv, Inc. ....	169,427	27,581,021	1.4
Visa, Inc. - Class A .....	151,134	55,192,626	2.8
		<u>82,773,647</u>	<u>4.2</u>

	Rate	Date	Shares	Value (USD)	Net Assets %
<b>INSURANCE</b>					
AIA Group Ltd. - Class H			5,403,600	\$ 44,980,258	2.3%
Reinsurance Group of America, Inc. - Class A			144,429	29,360,971	1.5
				74,341,229	3.8
				<u>335,367,381</u>	<u>17.0</u>
<b>HEALTH CARE</b>					
<b>BIOTECHNOLOGY</b>					
AbbVie, Inc.			183,710	34,190,268	1.7
<b>HEALTH CARE EQUIPMENT &amp; SUPPLIES</b>					
Alcon AG			522,990	45,038,275	2.3
Becton Dickinson & Co.			85,856	14,817,887	0.7
GE HealthCare Technologies, Inc.			514,035	36,260,029	1.8
Hologic, Inc.			364,972	22,690,309	1.1
Stryker Corp.			78,450	30,018,108	1.5
Terumo Corp.			2,123,151	38,974,298	2.0
				<u>187,798,906</u>	<u>9.4</u>
<b>HEALTH CARE PROVIDERS &amp; SERVICES</b>					
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.			265,586	21,405,562	1.1
<b>PHARMACEUTICALS</b>					
Eli Lilly & Co.			26,020	19,194,173	1.0
				<u>262,588,909</u>	<u>13.2</u>
<b>CONSUMER DISCRETIONARY</b>					
<b>AUTOMOBILE COMPONENTS</b>					
Aptiv PLC			635,578	42,462,966	2.1
<b>BROADLINE RETAIL</b>					
MercadoLibre, Inc.			18,052	46,272,511	2.3
<b>TEXTILES, APPAREL &amp; LUXURY GOODS</b>					
On Holding AG - Class A			803,485	47,718,974	2.4
				<u>136,454,451</u>	<u>6.8</u>
<b>UTILITIES</b>					
<b>ELECTRIC UTILITIES</b>					
NextEra Energy, Inc.			652,331	46,080,662	2.3
<b>WATER UTILITIES</b>					
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP			2,389,036	49,029,644	2.5
				<u>95,110,306</u>	<u>4.8</u>
<b>CONSUMER STAPLES</b>					
<b>FOOD PRODUCTS</b>					
Danone SA			349,340	29,867,631	1.5
Kerry Group PLC - Class A			180,850	19,769,546	1.0
				<u>49,637,177</u>	<u>2.5</u>
<b>ENERGY</b>					
<b>OIL, GAS &amp; CONSUMABLE FUELS</b>					
Cameco Corp.			658,060	38,516,252	1.9
<b>Total Investments</b>					
(cost \$1,678,044,563)				<u>\$1,895,780,342</u>	<u>95.4%</u>
<b>Time Deposits</b>					
ANZ, London(b)	2.65%	-		1,917	0.0
BBH, New York(b)	2.65%	-		1	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.01%	-		199,298	0.0
Citibank, New York(b)	3.68%	-		103,897,083	5.3
DBS Bank, Singapore(b)	3.68%	-		322,694	0.0
HSBC, Hong Kong(b)	0.01%	-		873,665	0.0
HSBC, London(b)	3.16%	-		201,577	0.0
HSBC, Paris(b)	1.11%	-		202,558	0.0
Nordea, Oslo(b)	3.23%	-		362,963	0.0
Scotiabank, Toronto(b)	1.58%	-		757,128	0.0
SEB, Stockholm(b)	0.73%	-		22,531	0.0
SEB, Stockholm(b)	1.08%	-		53,278	0.0
SMBC, London(b)	0.12%	-		206,365	0.0
Standard Chartered Bank, Johannesburg(b)	5.45%	-		1	0.0
<b>Total Time Deposits</b>				<u>107,101,059</u>	<u>5.3</u>
<b>Other assets less liabilities</b>				<u>(16,603,805)</u>	<u>(0.7)</u>
<b>Net Assets</b>				<u>\$1,986,277,596</u>	<u>100.0%</u>

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS

Counterparty	Contracts to Deliver (000)	In Exchange For (000)	Settlement Date	Unrealized Appreciation (Depreciation)
Bank of America NA	BRL 424,190	USD 74,039	06/03/2025	\$(126,861)
Bank of America NA	USD 22,850	BRL 130,430	06/03/2025	(45,144)
Bank of America NA	CAD 41,003	USD 29,117	06/18/2025	(783,710)
Bank of America NA	USD 25,594	CAD 35,218	06/18/2025	88,034
Bank of America NA	USD 6,957	JPY 1,022,191	06/23/2025	164,710
Bank of America NA	USD 13,815	JPY 1,936,504	06/23/2025	(323,486)
Bank of America NA	CHF 58,484	USD 71,681	07/09/2025	297,094
Bank of America NA	HKD 46,220	USD 5,956	07/11/2025	40,235
Barclays Bank PLC	CNH 374,237	USD 51,584	06/05/2025	(363,131)
Barclays Bank PLC	USD 11,946	INR 1,027,870	08/14/2025	18,007
Brown Brothers Harriman & Co.	HKD 90,658	USD 11,691	07/11/2025	87,066
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 7	USD 8	06/09/2025	9
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 28	USD 32	06/09/2025	(119)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 961	EUR 847	06/09/2025	1,083
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 897	USD 581	06/16/2025	2,495
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 526	USD 338	06/16/2025	(1,525)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 2	USD 2	06/16/2025	(13)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 89	USD 102	06/16/2025	132
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1,135	USD 1,277	06/16/2025	(12,614)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 555	USD 432	06/16/2025	1,102
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 30	USD 23	06/16/2025	(47)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 644	AUD 1,002	06/16/2025	2,002
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 35,462	AUD 54,864	06/16/2025	(90,085)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 91	CAD 126	06/16/2025	1,397
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 60,358	EUR 53,723	06/16/2025	691,082
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 24,406	SGD 31,649	06/16/2025	152,697
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 415	SGD 534	06/16/2025	(557)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 1,209	USD 779	06/23/2025	(300)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 1,976	USD 1,425	06/23/2025	(16,212)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 935	USD 1,136	06/23/2025	(2,587)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 1,457	USD 203	06/23/2025	261
Brown Brothers Harriman & Co.+	CZK 194	USD 9	06/23/2025	(2)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 5	USD 6	06/23/2025	7
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3,805	USD 4,319	06/23/2025	(6,874)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 1,277	USD 1,714	06/23/2025	(6,723)
Brown Brothers Harriman & Co.+	HKD 11,049	USD 1,415	06/23/2025	2,783
Brown Brothers Harriman & Co.+	HUF 5,664	USD 16	06/23/2025	27
Brown Brothers Harriman & Co.+	ILS 215	USD 60	06/23/2025	(841)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 357,530	USD 2,493	06/23/2025	2,881
Brown Brothers Harriman & Co.+	MXN 2,068	USD 106	06/23/2025	4
Brown Brothers Harriman & Co.+	NOK 736	USD 73	06/23/2025	460
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 37	USD 22	06/23/2025	(138)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 212	USD 56	06/23/2025	(127)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SEK 3,433	USD 359	06/23/2025	611
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 197	USD 153	06/23/2025	82
Brown Brothers Harriman & Co.+	THB 2,076	USD 63	06/23/2025	128
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 966	EUR 851	06/23/2025	1,556
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 3,081	USD 172	06/23/2025	549
Citibank NA	USD 5,145	CNH 37,382	06/05/2025	43,725
Citibank NA	CAD 11,355	USD 8,285	06/18/2025	4,949
Citibank NA	USD 14,352	SEK 139,714	06/26/2025	241,328
Citibank NA	GBP 65,016	USD 86,462	07/16/2025	(1,154,611)
Citibank NA	USD 18,940	KRW26,970,416	07/17/2025	641,160
Citibank NA	TWD 695,808	USD 23,348	08/22/2025	(404,640)
Deutsche Bank AG	USD 19,168	JPY 2,811,553	06/25/2025	419,387
Deutsche Bank AG	EUR 37,240	USD 42,076	07/09/2025	(307,522)
Deutsche Bank AG	USD 5,636	CHF 4,641	07/09/2025	28,300
HSBC Bank USA	EUR 4,544	USD 5,159	07/09/2025	(12,619)
HSBC Bank USA	HKD 193,166	USD 24,919	07/11/2025	195,043
HSBC Bank USA	TWD 669,055	USD 22,619	08/22/2025	(221,346)
HSBC Bank USA	USD 22,901	TWD 677,877	08/22/2025	239,749
JPMorgan Chase Bank NA	CAD 33,720	USD 24,271	06/18/2025	(318,271)
JPMorgan Chase Bank NA	EUR 9,489	USD 10,602	07/09/2025	(197,320)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL 35,196	USD 6,148	06/03/2025	(5,375)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 58,045	BRL 328,956	06/03/2025	(530,266)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 7,204	ZAR 140,952	06/05/2025	633,131
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 5,923	MXN 123,734	06/13/2025	448,041
Morgan Stanley Capital Services LLC	NOK 117,428	USD 11,076	06/26/2025	(428,431)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 11,254	NOK 117,428	06/26/2025	249,595
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL 328,956	USD 57,666	07/02/2025	538,647
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 109,170	EUR 95,718	07/09/2025	(231,011)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 35,924	HKD 278,354	07/11/2025	(295,532)
State Street Bank & Trust Co.	HKD 238,431	USD 30,782	07/11/2025	264,070
UBS AG	USD 67,379	CNH 485,634	06/05/2025	30,701

Counterparty		Contracts to Deliver (000)		In Exchange For (000)	Settlement Date	Unrealized Appreciation (Depreciation)
UBS AG.....	USD	31,761	AUD	52,756	06/12/2025	\$ 2,250,079
UBS AG.....	CHF	6,018	USD	7,207	07/09/2025	(138,779)
						<u>\$ 1,757,580</u>
					Appreciation	\$ 7,784,399
					Depreciation	\$ (6,026,819)

+ Used for portfolio or share class hedging purposes.

(a) Represents entire or partial securities out on loan. See Note L for securities lending information.

(b) Overnight deposit.

Currency Abbreviations:

AUD	- Australian Dollar
BRL	- Brazilian Real
CAD	- Canadian Dollar
CHF	- Swiss Franc
CNH	- Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
CZK	- Czech Koruna
EUR	- Euro
GBP	- Great British Pound
HKD	- Hong Kong Dollar
HUF	- Hungarian Forint
ILS	- Israeli Shekel
INR	- Indian Rupee
JPY	- Japanese Yen
KRW	- South Korean Won
MXN	- Mexican Peso
NOK	- Norwegian Krone
NZD	- New Zealand Dollar
PLN	- Polish Zloty
SEK	- Swedish Krona
SGD	- Singapore Dollar
THB	- Thailand Baht
TWD	- New Taiwan Dollar
USD	- United States Dollar
ZAR	- South African Rand



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16期(決算日2025年6月16日)

(計算期間：2024年6月18日～2025年6月16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			
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
14期(2023年6月15日)	11,997	4.2	12,107	4.4	78.0	100.0	136,997
15期(2024年6月17日)	11,890	△0.9	12,003	△0.9	78.3	99.9	128,026
16期(2025年6月16日)	11,678	△1.8	11,765	△2.0	78.0	99.9	112,389

(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) 2024年6月17日	11,890	-	12,003	-	78.3	99.9
6月末	11,789	△0.8	11,901	△0.8	77.5	99.9
7月末	11,772	△1.0	11,889	△0.9	77.7	100.0
8月末	11,943	0.4	12,056	0.4	78.4	100.0
9月末	11,987	0.8	12,094	0.8	79.3	100.0
10月末	11,950	0.5	12,056	0.4	79.7	99.9
11月末	11,851	△0.3	11,961	△0.3	79.9	100.0
12月末	11,815	△0.6	11,919	△0.7	81.0	99.9
2025年1月末	11,712	△1.5	11,815	△1.6	82.2	99.9
2月末	11,640	△2.1	11,740	△2.2	82.0	100.0
3月末	11,578	△2.6	11,671	△2.8	83.6	99.9
4月末	11,769	△1.0	11,861	△1.2	76.9	99.7
5月末	11,642	△2.1	11,729	△2.3	78.4	100.0
(期末) 2025年6月16日	11,678	△1.8	11,765	△2.0	78.0	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。

## 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

(2024年6月18日～2025年6月16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で下落しました。パークレイズ日本10年国債先物インデックスは  
前期末比で下落しました。

#### ○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  
2024年6月18日～2025年6月16日



当期中のベンチマークの推移  
2024年6月18日～2025年6月16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

(2024年6月18日～2025年6月16日)

当期の日本10年国債金利は、期初から2025年3月下旬にかけては、日本銀行(日銀)が利上げを決定したことや、追加利上げ観測などから上昇基調で推移しましたが、4月初旬に米国の日本に対する相互関税が予想以上に厳しい内容となったことを受けて大幅に低下しました。その後期末にかけては、消費税減税を巡る議論を受けて財政悪化が懸念されたことや、超長期債の入札が不調に終わったことなどから、金利は上昇に転じました。

## 運用概況

(2024年6月18日～2025年6月16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。

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。

※将来の市場環境の変動等により、当該運用方針が変更される場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2024年6月18日～2025年6月16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)	% 0.004 (0.004)	(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	0.007	
期中の平均基準価額は、11,787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

(2024年6月18日～2025年6月16日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	158,533,043	7,992,382 (163,300,000)

(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 471,878	百万円 485,253	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

(2024年6月18日～2025年6月16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

(2025年6月16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	87,700,000 (87,700,000)	87,666,637 (87,666,637)	78.0 (78.0)	- (-)	- (-)	- (-)	78.0 (78.0)
合 計	87,700,000 (87,700,000)	87,666,637 (87,666,637)	78.0 (78.0)	- (-)	- (-)	- (-)	78.0 (78.0)

(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) -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	利 率	当 期 末	
		額 面 金 額	評 価 額
国債証券	%	千円	千円
第1238回国庫短期証券	—	29,000,000	28,998,898
第1244回国庫短期証券	—	29,100,000	29,087,719
第1285回国庫短期証券	—	29,600,000	29,580,020
合 計		87,700,000	87,666,637

(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	百万円
		112,255	—

(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

(2025年6月16日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円	%
	87,666,637	77.9
コール・ローン等、その他	24,849,846	22.1
投資信託財産総額	112,516,483	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 (2025年6月16日現在)

項目	当期末	円
(A) 資産	112,516,483,531	
コール・ローン等	22,882,183,083	
公社債(評価額)	87,666,637,799	
未収入金	321,519,420	
未収利息	219,414	
差入委託証拠金	1,645,923,815	
(B) 負債	127,437,702	
未払解約金	127,437,702	
(C) 純資産総額(A-B)	112,389,045,829	
元本	96,241,236,638	
次期繰越損益金	16,147,809,191	
(D) 受益権総口数	96,241,236,638口	
1万口当たり基準価額(C/D)	11,678円	

(注) 期首元本額107,678,685,201円、期中追加設定元本額2,977,081,739円、期中一部解約元本額14,414,530,302円。当期末現在における1口当たり純資産額1.1678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)	49,562,991,298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	18,136,853,897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	28,126,165,476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)	296,016,477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)	119,176,022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

○お知らせ

2024年6月18日以降において、当マザーファンドの信託約款について、以下に掲げる事項を内容とする変更を行いました。

「投資信託及び投資法人に関する法律」第14条の改正に伴い、所要の変更を行いました。

(変更日：2025年4月1日)

○損益の状況 (2024年6月18日～2025年6月16日)

項目	当期	円
(A) 配当等収益	48,042,009	
受取利息	48,042,009	
(B) 有価証券売買損益	126,833,202	
売買益	126,833,202	
(C) 先物取引等取引損益	△ 2,313,301,510	
取引益	2,200,085,765	
取引損	△ 4,513,387,275	
(D) 保管費用等	△ 4,156,013	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 2,142,582,312	
(F) 前期繰越損益金	20,348,256,293	
(G) 追加信託差損益金	560,314,624	
(H) 解約差損益金	△ 2,618,179,414	
(I) 計(E+F+G+H)	16,147,809,191	
次期繰越損益金(I)	16,147,809,191	

(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。