



アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

愛称：グローバル・チャンピオン

追加型投信／内外／債券

第282期(決算日2021年6月25日) 第283期(決算日2021年7月26日) 第284期(決算日2021年8月25日)
第285期(決算日2021年9月27日) 第286期(決算日2021年10月25日) 第287期(決算日2021年11月25日)

●当ファンドの仕組み

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信／内外／債券
信託期間	無期限
運用方針	①インカム・ゲインの確保とともに信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。 ②世界中の公社債の中から、相対的に投資価値の高い証券に分散投資することにより、インカム・ゲインの確保とともにキャピタル・ゲインの獲得を目指します。 ③分散投資と投資対象証券の相対価値分析を基本とした、アクティブな運用を行います。
主要運用対象	世界各国の投資適格格付けの公社債を主な投資対象とします。
組入制限	①外貨建資産への投資については、制限を設けません。 ②株式への投資制限は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
分配方針	毎月決算を行い、原則として以下の方針により分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の利子等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ②分配金額は、委託者が基準価額水準や市場動向等を勘案して決定します。 ③収益分配金(税引き後)は自動払いぞく投資契約に基づき再投資されます。 ④留保益の運用については、特に制限を設けず、「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用を行います。

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド」は、このたび第287期の決算を行いました。

ここに、第282期から第287期の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

アライアンス・バーンスタイン株式会社

〒100-0011

東京都千代田区内幸町二丁目1番6号 日比谷パークフロント

お問合せ先 お客様窓口

電話番号 03-5962-9687

(受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで)

ホームページアドレス <https://www.alliancebernstein.co.jp>

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額		参考指数	債権組入比率	債券先物比率	純資産額
		税込分配金	期中騰落率				
	円	円	%		%	%	百万円
258期(2019年6月25日)	5,839	3	0.4	385.637	0.9	106.0	2,222
259期(2019年7月25日)	5,870	3	0.6	387.537	0.5	105.3	2,223
260期(2019年8月26日)	5,775	3	△1.6	387.263	△0.1	104.5	2,171
261期(2019年9月25日)	5,853	3	1.4	390.874	0.9	105.0	2,113
262期(2019年10月25日)	5,909	3	1.0	393.728	0.7	101.6	2,121
263期(2019年11月25日)	5,883	3	△0.4	392.839	△0.2	101.0	2,102
264期(2019年12月25日)	5,911	3	0.5	395.387	0.6	105.1	2,100
265期(2020年1月27日)	5,952	3	0.7	399.804	1.1	104.1	2,108
266期(2020年2月25日)	6,070	3	2.0	406.097	1.6	102.2	2,137
267期(2020年3月25日)	5,633	3	△7.1	394.850	△2.8	97.8	1,978
268期(2020年4月27日)	5,700	3	1.2	393.451	△0.4	103.7	1,995
269期(2020年5月25日)	5,753	3	1.0	395.896	0.6	101.9	2,005
270期(2020年6月25日)	5,828	3	1.4	401.089	1.3	104.2	2,024
271期(2020年7月27日)	5,896	3	1.2	405.410	1.1	102.5	2,037
272期(2020年8月25日)	5,930	3	0.6	407.932	0.6	102.7	2,044
273期(2020年9月25日)	5,876	3	△0.9	404.465	△0.8	99.0	1,997
274期(2020年10月26日)	5,869	3	△0.1	405.270	0.2	104.1	1,984
275期(2020年11月25日)	5,919	3	0.9	408.500	0.8	101.7	2,000
276期(2020年12月25日)	5,931	3	0.3	409.574	0.3	102.6	1,995
277期(2021年1月25日)	5,929	3	0.0	409.349	△0.1	103.5	1,989
278期(2021年2月25日)	5,964	3	0.6	411.134	0.4	101.9	1,984
279期(2021年3月25日)	6,004	3	0.7	415.991	1.2	103.2	1,992
280期(2021年4月26日)	6,007	3	0.1	416.828	0.2	103.6	1,978
281期(2021年5月25日)	6,072	3	1.1	420.648	0.9	99.8	1,985
282期(2021年6月25日)	6,150	3	1.3	426.447	1.4	101.0	2,000
283期(2021年7月26日)	6,156	3	0.1	428.113	0.4	101.0	1,993
284期(2021年8月25日)	6,119	3	△0.6	425.795	△0.5	101.1	1,968
285期(2021年9月27日)	6,117	3	0.0	425.242	△0.1	99.3	1,965
286期(2021年10月25日)	6,204	3	1.5	431.726	1.5	100.4	1,987
287期(2021年11月25日)	6,201	3	0.0	432.965	0.3	99.1	1,973

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 債券組入比率には、新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

※参考指数について

当ファンドの参考指数はブルームバーグ・グローバル総合インデックス（ヘッジなし、円ベース）です。ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（ヘッジなし、円ベース）は、原則として基準価額計算日前日付の数値を採用しています。

当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。

○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 先 物 比 率
		円	騰 落 率			
第282期	(期 首) 2021年 5月25日	6,072	—	420.648	99.8	△18.4
	5月末	6,128	0.9	425.703	99.7	△15.7
	(期 末) 2021年 6月25日	6,153	1.3	426.447	101.0	△12.1
第283期	(期 首) 2021年 6月25日	6,150	—	426.447	101.0	△12.1
	6月末	6,123	△0.4	425.078	100.9	△12.1
	(期 末) 2021年 7月26日	6,159	0.1	428.113	101.0	△12.4
第284期	(期 首) 2021年 7月26日	6,156	—	428.113	101.0	△12.4
	7月末	6,137	△0.3	427.123	101.0	△12.5
	(期 末) 2021年 8月25日	6,122	△0.6	425.795	101.1	△17.5
第285期	(期 首) 2021年 8月25日	6,119	—	425.795	101.1	△17.5
	8月末	6,133	0.2	426.774	100.5	△18.2
	(期 末) 2021年 9月27日	6,120	0.0	425.242	99.3	△14.9
第286期	(期 首) 2021年 9月27日	6,117	—	425.242	99.3	△14.9
	9月末	6,128	0.2	426.552	101.4	△15.1
	(期 末) 2021年10月25日	6,207	1.5	431.726	100.4	△14.6
第287期	(期 首) 2021年10月25日	6,204	—	431.726	100.4	△14.6
	10月末	6,225	0.3	433.178	100.4	△14.6
	(期 末) 2021年11月25日	6,204	0.0	432.965	99.1	△18.6

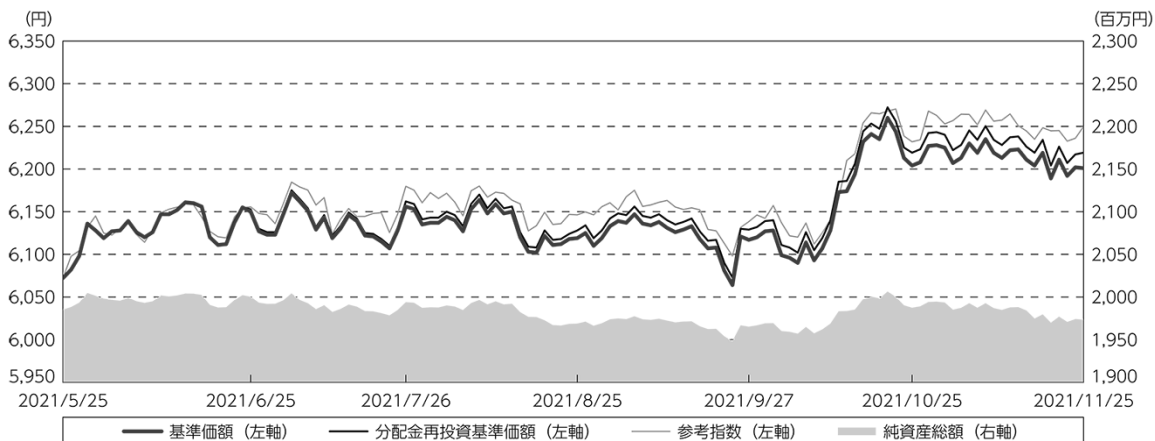
(注) 各期末基準価額は分配金込み、各騰落率は期首比です。
 (注) 債券組入比率には、新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。
 (注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。
 (注) 月末は、各月の最終営業日です。

運用経過

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド（以下「当ファンド」ということがあります。）の運用状況をご報告いたします。

作成期間中の基準価額等の推移

（2021年5月26日～2021年11月25日）



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 上記騰落率は、小数第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、作成期首（2021年5月25日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 参考指数は、ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（ヘッジなし、円ベース）です。

○基準価額の推移

基準価額（分配金（税込み）再投資）は前作成期末比2.4%の上昇※となりました。

※基準価額の騰落率は、各決算日の税込み分配金を当該決算日の基準価額で全額再投資したと仮定した場合のパフォーマンスを示しています。税金、手数料等を考慮しておりませんので、投資家の皆様の実際の投資成果を示すものではありません。

○基準価額の主な変動要因

上昇要因

- ・保有債券の利息収入
- ・保有する米国国債の価格上昇
- ・円安ドル高

下落要因

- ・保有するカナダの地方債の価格下落
- ・円高ユーロ安

投資環境

(2021年5月26日～2021年11月25日)

当作成期間の債券市場については、先進国国債はまちまちのパフォーマンスでした。投資適格社債は上昇しました。また、為替市場では円安ドル高が進行しました。

米国国債

デルタ株の世界的な感染拡大など新型コロナウイルスをめぐる懸念を受けて2021年8月初旬にかけて金利は低下（価格は上昇）しました。その後は、政策金利引き上げ時期の前倒しの可能性や早期のテーパリング開始が意識されたことから金利は上昇（価格は下落）基調で推移しました。10月下旬以降はやや低下しました。

ドイツ国債

デルタ株の世界的な感染拡大など新型コロナウイルスをめぐる懸念を受けてユーロ圏の景気回復懸念が高まったことから2021年8月初旬にかけて金利は低下しました。その後、インフレ高進懸念が高まると同時に、欧州中央銀行（ECB）の利上げ観測が意識されたことから金利は上昇し、11月以降は再び低下しました。

投資適格社債

2021年6月末にかけて上昇レンジ内で推移した後、10月中旬以降は堅調な企業業績見通しなどを背景に上昇しました。

円ドル・レート

円ドル・レートは、円安ドル高となりました。2021年7月月初にかけて円安ドル高基調で推移しました。その後はレンジ内で推移し、9月下旬以降米国国債金利の上昇に伴い円安ドル高が進行しました。

円ユーロ・レート

円ユーロは、円高ユーロ安となりました。欧州国債の金利低下やECBのハト派的な姿勢などを受けて2021年8月下旬にかけて円高が進行しました。その後いったんユーロが戻りましたが、10月下旬以降再び円高ユーロ安に推移しました。

運用概況

(2021年5月26日～2021年11月25日)

当ファンドは、世界各国の投資適格債を対象に、調査チームによる相対的投資価値分析を基本としたアクティブ運用を行います。運用にあたっては、当作成期間も引き続き、ファンダメンタル分析と計量分析を融合した運用判断に基づき、相対的に高い収益が期待される国、債券セクターや銘柄に対して機動的に資産配分を行いました。

その結果、社債券等の組入れは上昇した一方、国債・政府機関債の組入れは低下しました。

当作成期間中の売買では、国債・政府機関債等については、米国国債などを買い増した一方、メキシコ国債などを一部売却しました。投資適格社債については、金融関連銘柄などを買い増した一方、ヘルスケア関連銘柄などを全部売却しました。

なお、当ファンドは対円での為替ヘッジを行わず、外貨建資産の一部またはその大部分を実質的に他の通貨建てとなるように為替取引を行いました。

<公社債のセクター別組入比率>

前作成期末(2021年5月25日現在)

セクター	比率
国債・政府機関債	66.2%
社債券等	24.3%
モーゲージ証券	9.3%
現金等	0.2%



当作成期末(2021年11月25日現在)

セクター	比率
国債・政府機関債	64.0%
社債券等	25.9%
モーゲージ証券	9.2%
現金等	0.9%

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

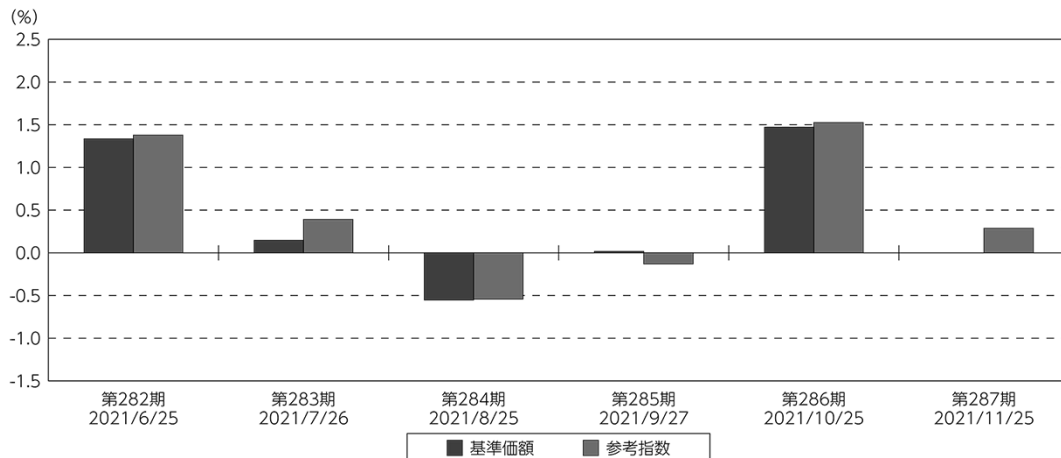
(注) 小数第2位を四捨五入。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2021年5月26日～2021年11月25日)

当ファンドは、特定の指数を上回ることを目指す運用を行っていないため、ベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（ヘッジなし、円ベース）です。

分配金

(2021年5月26日～2021年11月25日)

当作成期間の収益分配については、基準価額水準や市場動向等を勘案して決定しました。各決算期の分配金については、以下をご覧ください。（当期作成期間合計：18円）なお、収益分配に充てなかった利益については、信託財産内に留保し「運用の基本方針」に基づいて運用を行います。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第282期	第283期	第284期	第285期	第286期	第287期
	2021年5月26日～ 2021年6月25日	2021年6月26日～ 2021年7月26日	2021年7月27日～ 2021年8月25日	2021年8月26日～ 2021年9月27日	2021年9月28日～ 2021年10月25日	2021年10月26日～ 2021年11月25日
当期分配金 (対基準価額比率)	3 0.049%	3 0.049%	3 0.049%	3 0.049%	3 0.048%	3 0.048%
当期の収益	3	3	0	0	3	—
当期の収益以外	—	—	2	2	—	3
翌期繰越分配対象額	193	195	192	190	195	192

(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

世界経済は、新型コロナウイルスの影響による不確実性が残るものの、主要国の過去最大級の財政政策や金融政策などが追い風となり、2021年および2022年はプラス成長になると予想しています。ワクチン接種の早期拡充に加え、中小企業などの資金繰りや就業支援などの対策が引き続き求められる一方、経済回復などを目的としたインフラ投資などが経済の新たなけん引役として期待されます。

このような見通しの下、国債や投資適格社債の種別・銘柄など、投資機会を見極めて組み入れる方針です。

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年5月26日～2021年11月25日)

項 目	第282期～第287期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬	53	0.859	(a) 信託報酬＝作成期間中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(26)	(0.416)	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 ）	(26)	(0.416)	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(2)	(0.028)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝作成期間中の売買委託手数料÷作成期間中の平均受益権口数
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.002)	売買委託手数料は、組入金融商品等の売買の際に売買仲介人に支払う手数料
(c) そ の 他 費 用	3	0.051	(c) その他費用＝作成期間中のその他費用÷作成期間中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(2)	(0.033)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.007)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(1)	(0.012)	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	56	0.912	
作成期間中の平均基準価額は、6,145円です。			

(注) 作成期間中の費用（消費税等の課されるものは消費税等相当額を含めて表示）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

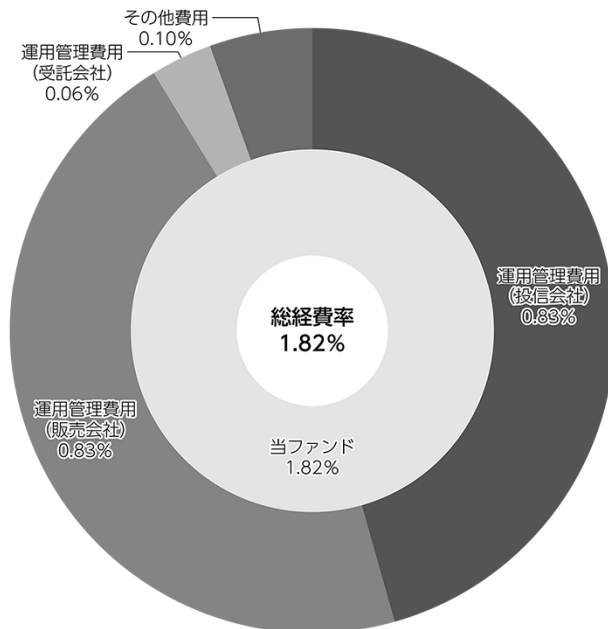
(注) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。ただし、平均基準価額は円未満切り捨て。

(注) 各比率は、1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を作成対象期間の平均受益権口数に作成対象期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.82%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年5月26日～2021年11月25日)

公社債

		第282期～第287期		
		買付額	売付額	
国内	国債証券	千円 69,954	千円 47,334	
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 3,625	千米ドル 3,242
		地方債証券	—	124
		特殊債証券	4,320	4,326 (45)
		社債証券	637	1,184 (45)
	カナダ	国債証券	千カナダドル 617	千カナダドル 924
		地方債証券	—	265
		特殊債証券	156	868
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ —	千メキシコペソ 8,128
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ —	千コロンビアペソ 382,338
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	540	855
		社債証券	—	49
	イタリア	国債証券	332	399
		社債証券	99	105
	フランス	国債証券	—	394
		社債証券	103	203
	オランダ	社債証券	109	27
	スペイン	国債証券	412	239
		社債証券	104	—
	ベルギー	国債証券	—	43
	オーストリア	国債証券	238	—
	フィンランド	国債証券	36	—
	アイルランド	国債証券	248	67
	その他	国債証券	319	206
		社債証券	1,432	742
	イギリス	国債証券	千英ポンド 391	千英ポンド 295
		社債証券	—	63
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 495	千オーストラリアドル 283
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランドドル 371	千ニュージーランドドル —

アラリアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

			第282期～第287期	
			買付額	売付額
外国	中国	国債証券	千中国元 1,297	千中国元 710
		特殊債券	—	691

(注) 金額は受け渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数値には含まれておりません。

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) —印は該当なし。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		第282期～第287期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	債券先物取引	百万円 518	百万円 571	百万円 1,363	百万円 1,413

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

(注) 単位未満は切り捨て。

直物為替先渡取引状況

種 類 別		第282期～第287期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
米ドル		百万円	百万円	百万円	百万円
	(チリペソ)	—	0	—	—
	(コロンビアペソ)	52	39	39	39
	(インドネシアルピア)	39	27	39	27
	(インドルピー)	39	30	20	30
	(韓国ウォン)	44	44	44	44
	(ペルーソル)	9	9	9	9
	(ロシアルーブル)	26	28	48	28

(注) 取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) —印は該当なし。

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月26日～2021年11月25日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2021年11月25日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第287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	185,450 (19,850)	190,430 (19,856)	9.6 (1.0)	— (—)	8.6 (—)	— (—)	1.0 (1.0)	
合 計	185,450 (19,850)	190,430 (19,856)	9.6 (1.0)	— (—)	8.6 (—)	— (—)	1.0 (1.0)	

(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) 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	第287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1035回国庫短期証券	—	19,850	19,856	2022/2/14
第358回利付国債(10年)	0.1	16,050	16,190	2030/3/20
第359回利付国債(10年)	0.1	44,950	45,315	2030/6/20
第62回利付国債(30年)	0.5	8,100	7,791	2049/3/20
第65回利付国債(30年)	0.4	5,850	5,444	2049/12/20
第68回利付国債(30年)	0.6	15,000	14,693	2050/9/20
第143回利付国債(20年)	1.6	6,250	7,266	2033/3/20
第150回利付国債(20年)	1.4	25,400	29,208	2034/9/20
第158回利付国債(20年)	0.5	12,850	13,242	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	12,550	13,102	2036/12/20
第169回利付国債(20年)	0.3	8,400	8,248	2039/6/20
第177回利付国債(20年)	0.4	10,200	10,071	2041/6/20
合 計		185,450	190,430	

(注) 単位未満は切り捨て。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	第287期末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 6,280	千米ドル 6,438	千円 742,512	% 37.6	% 0.4	% 24.0	% 4.6	% 9.0
カナダ	千カナダドル 300	千カナダドル 311	28,390	1.4	—	1.4	—	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	287	288	37,248	1.9	—	1.7	0.2	—
イタリア	1,077	1,085	140,306	7.1	—	7.1	—	—
フランス	300	307	39,740	2.0	—	0.7	1.3	—
オランダ	100	100	13,047	0.7	—	0.7	—	—
スペイン	518	520	67,291	3.4	—	3.4	—	—
ベルギー	25	30	3,952	0.2	—	0.2	—	—
オーストリア	233	236	30,611	1.6	—	1.6	—	—
フィンランド	35	36	4,757	0.2	—	0.2	—	—
アイルランド	224	240	31,070	1.6	—	1.6	—	—
その他	2,279	2,336	302,038	15.3	—	6.3	9.0	—
イギリス	千英ポンド 277	千英ポンド 298	45,898	2.3	—	1.9	—	0.4
オーストラリア	千オーストラリアドル 1,008	千オーストラリアドル 1,163	96,724	4.9	—	3.9	1.0	—
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 365	千ニュージーランドドル 372	29,556	1.5	—	—	1.5	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 241	千マレーシアリンギット 255	6,998	0.4	—	0.4	—	—
中国	千中国元 7,840	千中国元 8,005	144,404	7.3	3.7	7.3	—	—
合 計	—	—	1,764,549	89.4	4.0	62.4	17.6	9.4

(注) 邦貨換算金額は、第287期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(注) 一印は該当なし。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 格付はムーディーズとS&Pのうちいずれか高い方を採用して集計したものです。

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄		第287期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	6.7	55	72	8,336	2036/1/26
		US TREASURY	0.125	530	527	60,847	2023/4/30
		US TREASURY	0.125	670	665	76,703	2023/8/15
		US TREASURY	0.125	355	352	40,615	2023/9/15
		US TREASURY	0.375	175	173	19,980	2024/4/15
		US TREASURY	0.25	64	62	7,159	2025/5/31
		US TREASURY	0.875	230	225	26,016	2026/6/30
		US TREASURY	2.875	255	276	31,862	2028/5/15
		US TREASURY	1.125	515	441	50,921	2040/8/15
		US TREASURY	1.875	290	283	32,646	2051/2/15
		US TREASURY	2.0	115	115	13,337	2051/8/15
		US TSY INFL IX N/B	0.125	65	76	8,811	2031/1/15
	特殊債券 (除く金融債)	FNMA 30 YR CA 2370	4.5	62	67	7,794	2048/9/1
		GNMAII30YR TBA 3.0 DEC21	3.0	252	260	30,068	2051/12/1
		UMBS 30 YR CA 6404	2.5	102	105	12,187	2050/7/1
		UMBS 30 YR RA 1419	3.5	49	52	6,046	2049/9/1
		UMBS 30YR TBA 2.0 DEC21	2.0	77	76	8,800	2051/12/1
		UMBS 30YR TBA 2.5 DEC21	2.5	304	309	35,671	2051/12/1
	普通社債券	AHT1 2018-ASHF A	0.99	90	90	10,457	2035/4/15
		AIR LEASE CORP	3.25	3	3	359	2025/3/1
		AIR LEASE CORP	3.625	9	9	1,095	2027/4/1
		AIR LEASE CORP	2.1	3	2	332	2028/9/1
		ALTRIA GROUP INC	3.4	43	44	5,100	2030/5/6
		AT&T INC	4.3	6	6	770	2042/12/15
		AT&T INC	3.65	52	51	5,929	2059/9/15
		AVIATION CAPITAL GROUP	4.125	16	16	1,959	2025/8/1
		AVIATION CAPITAL GROUP	1.95	10	9	1,132	2026/1/30
		AVIATION CAPITAL GROUP	1.95	14	13	1,571	2026/9/20
		BANCO DE CREDITO DEL PER	3.125	45	44	5,087	2030/7/1
		BANK OF AMERICA CORP	2.687	73	73	8,438	2032/4/22
		BAT CAPITAL CORP	4.906	50	55	6,453	2030/4/2
		BRITISH TELECOM PLC	9.625	16	23	2,715	2030/12/15
		BROADCOM INC	4.11	25	27	3,135	2028/9/15
		BROADCOM INC	3.137	6	5	672	2035/11/15
		BROADCOM INC	3.187	8	7	892	2036/11/15
		BX 2019-IMC A	1.089	100	99	11,519	2034/4/15
		CAS 2014-C03 2M2	2.98925	7	7	904	2024/7/25
		CAS 2014-C04 1M2	4.98925	26	27	3,155	2024/11/25
		CAS 2014-C04 2M2	5.08925	9	9	1,081	2024/11/25
CAS 2016-C01 1M2		6.83925	17	18	2,085	2028/8/25	
CAS 2016-C01 2M2		7.03925	11	12	1,452	2028/8/25	
CAS 2016-C02 1M2	6.08925	43	45	5,239	2028/9/25		
CAS 2016-C06 1M2	4.33925	19	19	2,306	2029/4/25		

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

銘	柄	第287期末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	普通社債券					
	CAS 2021-R01 1M1	0.8	10	10	1,154	2041/10/25
	CAS 2021-R01 1M2	1.6	10	10	1,221	2041/10/25
	CBS CORP	5.5	20	24	2,863	2033/5/15
	CHARLES SCHWAB CORP	4.0	46	46	5,354	2099/12/1
	CHARTER COMM OPT LLC/CAP	5.375	30	35	4,102	2047/5/1
	CITIGROUP INC	4.075	33	36	4,174	2029/4/23
	CITIGROUP INC	3.98	51	55	6,453	2030/3/20
	CONTINENTAL RESOURCES	5.75	17	19	2,279	2031/1/15
	CONTINENTAL RESOURCES	2.875	26	25	2,888	2032/4/1
	CORNING INC	5.45	20	26	3,038	2079/11/15
	DELL INT LLC / EMC CORP	8.35	28	46	5,331	2046/7/15
	DEVON ENERGY CORP	5.6	39	48	5,629	2041/7/15
	DISCOVERY COMMUNICATIONS	5.2	19	23	2,703	2047/9/20
	DISCOVERY COMMUNICATIONS	5.3	11	13	1,590	2049/5/15
	DISCOVERY COMMUNICATIONS	4.65	9	10	1,204	2050/5/15
	ENBRIDGE ENERGY PARTNERS	7.375	32	50	5,778	2045/10/15
	ENERGY TRANSFER OPERATING	6.25	50	64	7,430	2049/4/15
	FCAT 2018-3 D	4.15	36	37	4,299	2024/12/16
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	2.6	41	41	4,743	2030/2/7
	GSMS 2013-G1 A1	2.059	12	12	1,401	2031/4/10
	GSMS 2013-G1 A2	3.557	115	115	13,263	2031/4/10
	HARLEY-DAVIDSON FINL SER	3.35	21	21	2,535	2025/6/8
	HARLEY-DAVIDSON INC	3.5	20	21	2,432	2025/7/28
	HUSKY ENERGY INC	4.4	30	33	3,821	2029/4/15
	IHSFR 2018-SFR4 A	1.191	90	90	10,435	2038/1/17
	JPMBB 2014-C21 B	4.3413	17	17	2,072	2047/8/15
	KYNDRYL HOLDINGS INC	2.05	26	25	2,908	2026/10/15
	LAS VEGAS SANDS CORP	3.9	35	35	4,094	2029/8/8
	MDC HOLDINGS INC	6.0	30	37	4,284	2043/1/15
	NEXTERA ENERGY CAPITAL	1.9	14	13	1,578	2028/6/15
	ONEOK INC	4.55	35	38	4,477	2028/7/15
	ORACLE CORP	3.95	31	32	3,793	2051/3/25
	PLAINS ALL AMER PIPELINE	3.55	4	4	474	2029/12/15
	PLAINS ALL AMER PIPELINE	3.8	10	10	1,199	2030/9/15
	PMTCR 2019-1R A	2.08775	33	33	3,901	2024/3/27
	ROSS STORES INC	4.7	9	10	1,167	2027/4/15
	SBA TOWER TRUST	3.869	25	25	2,966	2049/10/15
	STACR 2021-DNA3 M2	2.14867	20	20	2,383	2033/10/25
	STACR 2021-DNA5 M2	1.69867	14	14	1,700	2034/1/25
	SUNCOR ENERGY INC	6.5	9	12	1,423	2038/6/15
	SUNCOR ENERGY INC	6.85	26	37	4,275	2039/6/1
	SURA ASSET MANAGEMENT	4.875	100	106	12,273	2024/4/17
	SUZANO AUSTRIA GMBH	3.75	45	44	5,137	2031/1/15
	SYNCHRONY FINANCIAL	3.95	5	5	619	2027/12/1

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

銘柄		第287期末					
		利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	普通社債券	SYNCHRONY FINANCIAL	2.875	28	27	3,173	2031/10/28
		TRANSCANADA PIPELINES	7.625	30	46	5,327	2039/1/15
		US BANCORP	5.3	30	32	3,744	2099/10/15
		VALERO ENERGY CORP	6.625	6	8	938	2037/6/15
		VERISIGN INC	2.7	7	6	804	2031/6/15
小計						742,512	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	190	187	17,057	2051/12/1
	地方債証券	PROVINCE OF ONTARIO	6.5	40	51	4,712	2029/3/8
		PROVINCE OF QUEBEC	2.75	50	52	4,753	2027/9/1
	特殊債券 (除く金融債)	CANADA HOUSING TRUST	2.35	20	20	1,866	2027/6/15
小計						28,390	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	—	104	106	13,773	2031/8/15
		BUNDESREP. DEUTSCHLAND	—	97	94	12,200	2050/8/15
	普通社債券	KFW	—	63	63	8,204	2029/6/15
		VOLKSWAGEN BANK GMBH	1.25	23	23	3,070	2025/12/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	585	602	77,862	2027/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.25	353	346	44,814	2028/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	39	36	4,782	2045/4/30
	普通社債券	ENI SPA	0.375	100	99	12,846	2028/6/14
フランス	普通社債券	DEXIA CREDIT LOCAL	0.5	200	204	26,413	2025/1/17
		SNCF SA	0.625	100	103	13,326	2030/4/17
オランダ	普通社債券	ABN AMRO BANK NV	0.6	100	100	13,047	2027/1/15
スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	1.2	203	206	26,738	2040/10/31
		SPANISH GOVERNMENT	1.0	215	210	27,253	2042/7/30
	普通社債券	BANCO SANTANDER SA	1.125	100	102	13,299	2027/6/23
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	1.9	25	30	3,952	2038/6/22
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	93	97	12,586	2029/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	140	139	18,025	2031/2/20
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	0.5	35	36	4,757	2029/9/15
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	1.35	67	74	9,634	2031/3/18
		IRISH GOVERNMENT	—	107	104	13,483	2031/10/18
	普通社債券	GE CAPITAL EURO FUNDING	4.625	50	61	7,952	2027/2/22
その他	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1.0	100	97	12,649	2029/7/28
		REPUBLIC OF PERU	3.75	100	117	15,206	2030/3/1
		UNITED MEXICAN STATES	3.375	134	150	19,470	2031/2/23
	地方債証券	JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	0.01	100	99	12,843	2028/2/2
	特殊債券 (除く金融債)	DEVELOPMENT BK OF JAPAN	0.01	100	100	12,984	2024/10/15
	普通社債券	BANK OF NOVA SCOTIA	0.25	100	97	12,624	2028/11/1
		CANADIAN IMP BK COMMERCE	0.01	100	100	12,963	2026/10/7
		CK HUTCHISON FINANCE 16	0.875	100	102	13,208	2024/10/3
	CREDIT SUISSE AG LONDON	0.25	100	99	12,913	2026/1/5	

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

銘柄		第287期末					
		利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
その他	普通社債券	DANSKE BANK AS	0.75	100	99	12,826	2029/6/9
		DNB BOLIGKREDITT AS	0.625	100	102	13,304	2025/6/19
		EXXON MOBIL CORP	0.835	100	98	12,704	2032/6/26
		FIDELITY NATIONAL INFORM	0.625	100	101	13,106	2025/12/3
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	3.375	45	49	6,437	2025/3/27
		HSBC HOLDINGS PLC	0.309	100	99	12,909	2026/11/13
		JPMORGAN CHASE & CO	1.09	100	102	13,301	2027/3/11
		MORGAN STANLEY	0.406	100	99	12,869	2027/10/29
		NATIONAL AUSTRALIA BANK	2.25	100	108	14,025	2025/6/6
		NATIONAL BANK OF CANADA	0.01	100	100	12,972	2026/9/29
		NATL WESTMINSTER BANK	0.5	100	101	13,166	2024/5/15
		ROYAL BANK OF CANADA	0.25	100	101	13,091	2024/1/29
		STADSHYPOTEK AB	0.5	100	102	13,253	2025/7/11
		WESTPAC BANKING CORP	0.5	100	102	13,205	2025/1/16
小計						670,065	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	1.75	179	193	29,789	2037/9/7
		UK TREASURY	1.25	36	37	5,797	2051/7/31
		UK TREASURY	1.5	12	13	2,087	2053/7/31
	普通社債券	YORKSHIRE WATER FINANCE	6.5876	50	53	8,224	2023/2/21
小計						45,898	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	AUSTRALIA I/L	3.124	148	232	19,322	2030/9/20
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	50	56	4,669	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	49	45	3,754	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	176	190	15,805	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	90	108	8,998	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	145	152	12,639	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	190	207	17,205	2047/3/21
	地方債証券	BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.25	160	172	14,328	2024/11/27
小計						96,724	
ニュージーランド				千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.75	365	372	29,556	2025/4/15
小計						29,556	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	241	255	6,998	2030/4/15
小計						6,998	
中国				千中国元	千中国元		
	国債証券	CHINA GOVERNMENT	3.01	540	543	9,808	2028/5/13
		CHINA GOVERNMENT	2.68	780	762	13,756	2030/5/21
		CHINA GOVERNMENT	3.27	790	811	14,636	2030/11/19
		CHINA GOVERNMENT	3.39	1,920	1,885	34,010	2050/3/16

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンド

銘	柄	第287期末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
中国		%	千中国元	千中国元	千円	
	特殊債券 (除く金融債) CHINA DEVELOPMENT BANK	4.04	3,810	4,002	72,193	2028/7/6
	小 計				144,404	
	合 計				1,764,549	

(注) 邦貨換算金額は、第287期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 単位未満は切り捨て。

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	第287期末	
			買 建 額	売 建 額
			百万円	百万円
外	債券先物取引	10 ULTRA FUT	—	66
		CAN10YR BOND	—	12
		EUR-BOBL	—	226
		EUR-BUND	—	22
国		EUR-SCHATZ	—	43
		10YR KTB	23	—
		LONG GILT	—	19

(注) 邦貨換算金額は、第287期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) —印は該当なし。

直物為替先渡取引残高

銘 柄 別	取引契約残高			
	第287期末想定元本額			
	買 建 額		売 建 額	
	外貨建金額	邦貨換算金額	外貨建金額	邦貨換算金額
米ドル	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円
	(コロンビアペソ)	110	112	13
	(インドネシアルピア)	177	108	12
	(インドルピー)	176	—	—
	(韓国ウォン)	192	—	—
	(ペルーソル)	28	—	—
	(ロシアルーブル)	195	167	19

(注) 邦貨換算金額は、第287期末の外貨建金額をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) —印は該当なし。

○投資信託財産の構成

(2021年11月25日現在)

項 目	第287期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 1,954,979	% 95.0
コール・ローン等、その他	103,741	5.0
投資信託財産総額	2,058,720	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注) 第287期末における外貨建純資産 (1,763,541千円) の投資信託財産総額 (2,058,720千円) に対する比率は85.7%です。

(注) 外貨建資産は、第287期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、邦貨換算に使用した為替レートは、1米ドル=115.33円、1カナダドル=91.13円、1ユーロ=129.28円、1英ポンド=153.90円、1オーストラリアドル=83.10円、1ニュージーランドドル=79.45円、1マレーシアリンギット=27.3718円、100韓国ウォン=9.72円、1南アフリカランド=7.26円、1中国元=18.0387円です。

○特定資産の価格等の調査

調査を行った者の名称

EY新日本有限責任監査法人

調査の結果及び方法の概要

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・インカム・ファンドにおいて行った取引のうち、調査依頼を行った取引は2021年5月26日から2021年11月25日までの間で直物為替先渡取引（以下「NDF」といいます。）36件及び有価証券（外国貸付債権信託受益証券）取引4件でした。投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）第11条第2項に基づき、これらのNDF取引については比較可能な価格のほか、通貨、期日、レート、取引の相手方の名称、その他当該取引の内容に関して、有価証券取引については比較可能な価格のほか、銘柄、数量、その他当該有価証券の内容に関してEY新日本有限責任監査法人へその調査を委託し、日本公認会計士協会が公表した専門業務実務指針4460「投資信託及び投資法人における特定資産の価格等の調査に係る合意された手続業務に関する実務指針」に基づく調査結果として合意された手続実施結果報告書を受領する予定です。

なお、本調査は財務諸表監査の一部ではなく、また、価格の妥当性や内部管理体制について保証を提供するものではありません。

以上

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第282期末	第283期末	第284期末	第285期末	第286期末	第287期末
	2021年6月25日現在	2021年7月26日現在	2021年8月25日現在	2021年9月27日現在	2021年10月25日現在	2021年11月25日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	3,614,393,148	3,627,030,125	3,176,378,533	2,983,002,698	3,425,809,842	3,237,091,488
コール・ローン等	58,141,561	46,334,712	36,497,680	75,378,633	94,676,180	65,254,311
公社債(評価額)	2,021,301,131	2,013,540,663	1,991,111,444	1,952,065,644	1,994,760,751	1,954,979,806
未収入金	1,517,500,042	1,551,202,890	1,128,650,101	937,538,415	1,322,360,287	1,200,275,378
未収利息	8,735,612	7,978,714	9,260,539	8,272,885	8,352,778	6,971,365
前払費用	2,089,329	1,061,974	894,720	770,867	1,297,874	1,471,934
その他未収収益	472,886	712,911	951,690	1,182,381	1,428,614	1,641,293
差入委託証拠金	6,152,587	6,198,261	9,012,359	7,793,873	2,933,358	6,497,401
(B) 負債	1,614,063,604	1,633,083,881	1,207,541,647	1,017,783,337	1,438,392,765	1,263,609,983
未払金	1,610,172,173	1,628,756,662	1,203,771,118	1,013,761,060	1,434,724,187	1,259,405,571
未払収益分配金	975,820	971,722	965,291	963,888	960,987	954,724
未払解約金	—	450,747	—	—	100,039	351,987
未払信託報酬	2,892,206	2,881,301	2,782,483	3,033,475	2,586,213	2,874,312
未払利息	62	106	61	65	150	46
その他未払費用	23,343	23,343	22,694	24,849	21,189	23,343
(C) 純資産総額(A-B)	2,000,329,544	1,993,946,244	1,968,836,886	1,965,219,361	1,987,417,077	1,973,481,505
元本	3,252,734,834	3,239,074,608	3,217,636,889	3,212,962,154	3,203,290,507	3,182,415,146
次期繰越損益金	△1,252,405,290	△1,245,128,364	△1,248,800,003	△1,247,742,793	△1,215,873,430	△1,208,933,641
(D) 受益権総口数	3,252,734,834口	3,239,074,608口	3,217,636,889口	3,212,962,154口	3,203,290,507口	3,182,415,146口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,150円	6,156円	6,119円	6,117円	6,204円	6,201円

(注) 第282期首元本額3,269,170,085円、第282～287期中追加設定元本額4,275,973円、第282～287期中一部解約元本額91,030,912円。第287期末現在における1口当たり純資産額0.6201円。

(注) 第287期末現在において純資産総額が元本を下回っており、その差額は△1,208,933,641円です。

○損益の状況

項 目	第282期	第283期	第284期	第285期	第286期	第287期
	2021年5月26日～ 2021年6月25日	2021年6月26日～ 2021年7月26日	2021年7月27日～ 2021年8月25日	2021年8月26日～ 2021年9月27日	2021年9月28日～ 2021年10月25日	2021年10月26日～ 2021年11月25日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	3,640,800	3,291,009	3,076,482	3,247,495	2,842,646	2,942,438
受取利息	3,426,875	3,055,503	2,839,637	3,020,613	2,603,064	2,733,967
その他収益金	216,608	237,710	238,325	229,133	241,826	211,483
支払利息	△ 2,683	△ 2,204	△ 1,480	△ 2,251	△ 2,244	△ 3,012
(B) 有価証券売買損益	27,126,029	4,856,501	△ 10,331,888	△ 3,147,836	26,351,121	1,617,319
売買益	53,099,754	38,949,093	24,186,149	24,886,584	68,396,612	59,948,960
売買損	△ 25,973,725	△ 34,092,592	△ 34,518,037	△ 28,034,420	△ 42,045,691	△ 58,331,641
(C) 先物取引等取引損益	△ 1,559,746	△ 2,143,028	△ 735,544	△ 3,230,820	△ 2,817,906	△ 1,574,944
取引益	1,289,709	2,237,147	620,745	4,916,566	5,095,076	3,078,175
取引損	△ 2,849,455	△ 4,380,175	△ 1,356,289	△ 1,685,746	△ 2,277,170	△ 4,653,119
(D) 信託報酬等	△ 3,026,134	△ 3,015,338	△ 2,956,237	△ 3,123,632	△ 2,937,293	△ 3,014,038
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	26,180,949	2,989,144	△ 10,947,187	206,847	29,074,380	△ 29,225
(F) 前期繰越損益金	△ 240,165,724	△ 214,002,653	△ 210,538,250	△ 222,080,659	△ 222,119,999	△ 192,701,177
(G) 追加信託差損益金	△ 1,037,444,695	△ 1,033,143,133	△ 1,026,349,275	△ 1,024,905,093	△ 1,021,866,824	△ 1,015,248,515
(配当等相当額)	(3,742,340)	(3,741,798)	(3,729,366)	(3,736,221)	(3,737,051)	(3,725,153)
(売買損益相当額)	(△ 1,041,187,035)	(△ 1,036,884,931)	(△ 1,030,078,641)	(△ 1,028,641,314)	(△ 1,025,603,875)	(△ 1,018,973,668)
(H) 計(E+F+G)	△ 1,251,429,470	△ 1,244,156,642	△ 1,247,834,712	△ 1,246,778,905	△ 1,214,912,443	△ 1,207,978,917
(I) 次期繰越損益金	△ 975,820	△ 971,722	△ 965,291	△ 963,888	△ 960,987	△ 954,724
(次期繰越損益金(H+I))	△ 1,252,405,290	△ 1,245,128,364	△ 1,248,800,003	△ 1,247,742,793	△ 1,215,873,430	△ 1,208,933,601
追加信託差損益金	△ 1,037,444,695	△ 1,033,143,133	△ 1,026,349,275	△ 1,024,905,093	△ 1,021,866,824	△ 1,015,248,515
(配当等相当額)	(3,742,340)	(3,741,798)	(3,729,366)	(3,736,221)	(3,737,051)	(3,725,153)
(売買損益相当額)	(△ 1,041,187,035)	(△ 1,036,884,931)	(△ 1,030,078,641)	(△ 1,028,641,314)	(△ 1,025,603,875)	(△ 1,018,973,668)
分配準備積立金	59,062,094	59,465,472	58,214,523	57,355,428	58,791,528	57,441,209
繰越損益金	△ 274,022,689	△ 271,450,703	△ 280,665,251	△ 280,193,128	△ 252,798,134	△ 251,126,335

(注) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は、売買による損益のほか、各期末における評価損益、外国為替の売買および期末評価換えによる損益を含んでおります。

(注) (D) 信託報酬等には信託報酬、監査報酬などの諸費用とそれらに対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (G) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金計算過程は以下のとおりです。

* 第282期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (3,263,441円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 (0円)、収益調整金額 (3,742,340円) および分配準備積立金額 (56,774,473円) より分配対象収益額は63,780,254円 (10,000口当たり196円) であり、うち975,820円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

* 第283期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (1,638,302円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 (0円)、収益調整金額 (3,741,798円) および分配準備積立金額 (58,798,892円) より分配対象収益額は64,178,992円 (10,000口当たり198円) であり、うち971,722円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

* 第284期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (120,245円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 (0円)、収益調整金額 (3,729,366円) および分配準備積立金額 (59,059,569円) より分配対象収益額は62,909,180円 (10,000口当たり195円) であり、うち965,291円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

* 第285期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (201,641円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 (0円)、収益調整金額 (3,736,221円) および分配準備積立金額 (58,117,675円) より分配対象収益額は62,055,537円 (10,000口当たり193円) であり、うち963,888円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

* 第286期計算期間末における費用控除後の配当等収益額 (2,581,814円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 (0円)、収益調整金額 (3,737,051円) および分配準備積立金額 (57,170,701円) より分配対象収益額は63,489,566円 (10,000口当たり198円) であり、うち960,987円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

* 第287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 (3,725,153円) および分配準備積立金額 (58,395,933円) より分配対象収益額は62,121,086円 (10,000口当たり195円) であり、うち954,724円 (10,000口当たり3円) を分配金額としております。

○分配金のお知らせ

	第282期	第283期	第284期	第285期	第286期	第287期
1 万口当たり分配金 (税込み)	3円	3円	3円	3円	3円	3円

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

◇課税上の取扱い

①分配金の課税について

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

②個人の課税上の取扱い

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

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

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

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

○お知らせ

2021年5月26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。

運用の指図に関する権限を委託するアラライアンス・バーンスタイン・エル・ピーの所在の場所を、「アメリカ合衆国、ニューヨーク州、ニューヨーク市」から、「アメリカ合衆国、テネシー州、ナッシュビル市」に変更しました。

(変更日：2021年7月6日)