



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)

追加型投信／内外／債券

第5期(決算日2022年2月15日) 第6期(決算日2022年3月15日) 第7期(決算日2022年4月15日)
第8期(決算日2022年5月16日) 第9期(決算日2022年6月15日) 第10期(決算日2022年7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。

| 商品分類 | 追加型投信／内外／債券 | |
|--------|--|--|
| 信託期間 | 2032年1月15日まで(信託設定日:2021年10月5日) | |
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none"> 日本を含む世界各国の債券等を実質的な主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。 主要投資対象ファンドへの投資を通じて、主に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んでいると考えられる、世界各国の様々な発行体の債券等に投資します。 *主要投資対象ファンド: <ul style="list-style-type: none"> ルクセンブルグ籍円建外国投資証券「AB SICAVI-サステナブル・インカム・ポートフォリオ クラスS1QGシェアーズ(為替ヘッジあり)」 主要投資対象ファンドの運用は、アライアンス・バーンスタイン・エル・ビーに委託します。 *アライアンス・バーンスタイン(以下、「AB」)には、アライアンス・バーンスタイン・エル・ビーとその傘下の関連会社を含みます。 世界の債券市場から、AB独自のSDGs分析を活用し、より魅力的な投資機会を追求します。 当ファンドは、ファンド・オフ・ファンズ方式により運用を行います。 主要投資対象ファンドにおいて、原則として同クラスの純資産総額を米ドル換算した額と同程度度の「米ドル売り/円買い」の為替取引を行い、対円での為替変動リスクの軽減を図ります。 | |
| 主要運用対象 | <ul style="list-style-type: none"> 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) AB SICAVI-サステナブル・インカム・ポートフォリオ クラスS1QGシェアーズ(為替ヘッジあり) 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 | <ul style="list-style-type: none"> ルクセンブルグ籍円建外国投資証券「AB SICAVI-サステナブル・インカム・ポートフォリオ クラスS1QGシェアーズ(為替ヘッジあり)」、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 日本を含む世界各国の債券等 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 |
| 組入制限 | <ul style="list-style-type: none"> 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) AB SICAVI-サステナブル・インカム・ポートフォリオ クラスS1QGシェアーズ(為替ヘッジあり) 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 | <ul style="list-style-type: none"> 株式への実質投資割合は、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合は、制限を設けません。 流動性の低い資産への投資は、純資産額の10%を超えないものとします。 ポートフォリオの借入総額は、純資産額の10%を上限とします。 米ドル建資産への実質的な投資比率について、原則として純資産総額の90%以上に維持します。 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 | <p>原則として、毎決算時(毎月15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"> 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。 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、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なく、分配可能額が少額の場合は、分配を行わないこともあります。 留保金の運用については、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・世界SDGs債券ファンド(毎月決算型・為替ヘッジあり)」は、このたび第10期の決算を行いました。

ここに、第5期から第10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>

○設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 (分配落) | 価 額 | | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 入 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|---------------------|--------------|-----|--------|---------------------|----------------|----------------|--------------------|--------------|
| | | 税 分 | 込 配 | み 期 金 騰 落 中 率 | | | | |
| (設定日) 2021年10月5日 | 円 10,000 | | 円 — | % — | % — | % — | % — | 百万円 1 |
| 1期(2021年10月15日) | 9,968 | | 0 | △0.3 | 0.7 | 0.9 | 97.4 | 1 |
| 2期(2021年11月15日) | 9,956 | | 0 | △0.1 | 0.1 | 0.1 | 97.1 | 8 |
| 3期(2021年12月15日) | 9,907 | | 0 | △0.5 | 0.0 | 0.0 | 105.3 | 47 |
| 4期(2022年1月17日) | 9,794 | | 0 | △1.1 | 0.0 | 0.0 | 97.9 | 50 |
| 5期(2022年2月15日) | 9,471 | | 0 | △3.3 | 0.0 | 0.0 | 97.5 | 45 |
| 6期(2022年3月15日) | 9,203 | | 20 | △2.6 | 0.0 | 0.0 | 97.6 | 43 |
| 7期(2022年4月15日) | 9,063 | | 20 | △1.3 | 0.0 | 0.0 | 98.0 | 43 |
| 8期(2022年5月16日) | 8,751 | | 20 | △3.2 | 0.0 | 0.0 | 98.0 | 41 |
| 9期(2022年6月15日) | 8,444 | | 20 | △3.3 | 0.0 | 0.0 | 98.2 | 40 |
| 10期(2022年7月15日) | 8,415 | | 20 | △0.1 | 0.0 | 0.0 | 98.4 | 59 |

(注) 設定日の基準価額は、当初設定時の価額です。また設定日の純資産総額は、当初設定元本総額を表示しております。

(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。

※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。

○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 | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 組 入 比 率 | 託 券 率 |
|-------|------------|-------|-------|-----|-----------|-----------|-------------------|-------|
| | | | 騰 落 率 | 率 | | | | |
| 第5期 | (期首) | 円 | % | % | % | % | % | % |
| | 2022年1月17日 | 9,794 | — | 0.0 | 0.0 | 97.9 | | |
| | 1月末 | 9,681 | △1.2 | 0.0 | 0.0 | 97.6 | | |
| 第6期 | (期末) | | | | | | | |
| | 2022年2月15日 | 9,471 | △3.3 | 0.0 | 0.0 | 97.5 | | |
| | 2月末 | 9,443 | △0.3 | 0.0 | 0.0 | 97.4 | | |
| 第7期 | (期首) | | | | | | | |
| | 2022年3月15日 | 9,223 | △2.6 | 0.0 | 0.0 | 97.6 | | |
| | 3月末 | 9,268 | 0.7 | 0.0 | 0.0 | 97.4 | | |
| 第8期 | (期末) | | | | | | | |
| | 2022年4月15日 | 9,083 | △1.3 | 0.0 | 0.0 | 98.0 | | |
| | 4月末 | 8,947 | △1.3 | 0.0 | 0.0 | 97.8 | | |
| 第9期 | (期首) | | | | | | | |
| | 2022年5月16日 | 8,771 | △3.2 | 0.0 | 0.0 | 98.0 | | |
| | 5月末 | 8,883 | 1.5 | 0.0 | 0.0 | 98.1 | | |
| 第10期 | (期末) | | | | | | | |
| | 2022年6月15日 | 8,464 | △3.3 | 0.0 | 0.0 | 98.2 | | |
| | 6月末 | 8,444 | — | 0.0 | 0.0 | 98.2 | | |
| 第10期 | (期首) | | | | | | | |
| | 2022年7月15日 | 8,436 | △0.1 | 0.0 | 0.0 | 98.1 | | |
| 第10期 | (期末) | | | | | | | |
| | 2022年7月15日 | 8,435 | △0.1 | 0.0 | 0.0 | 98.4 | | |

(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。

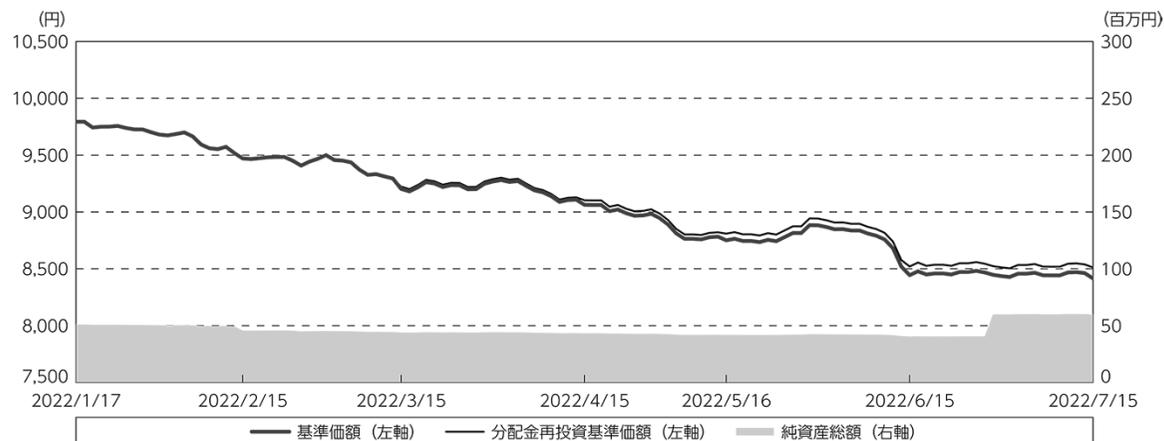
(注) 月末は、各月の最終営業日です。

運用経過

アライアンス・バーンスタイン・世界SDGs債券ファンド（毎月決算型・為替ヘッジあり）（以下「当ファンド」ということがあります。）の運用状況をご報告いたします。

作成期間中の基準価額等の推移

（2022年1月18日～2022年7月15日）



第5期首： 9,794円

第10期末： 8,415円（既払分配金（税込み）：100円）

騰落率：△ 13.1%（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、作成期首（2022年1月17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）は前作成期末比13.1%*の下落となりました。

*基準価額の騰落率は、各決算期末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ーサステナブル・インカム・ポートフォリオ クラスS1QG（為替ヘッジあり）」への投資を通じて運用を行います。当作成期における基準価額の変動要因は次のとおりです。

下落要因：保有している投資適格社債やハイイールド社債、新興国債券の価格下落
為替のヘッジ・コスト

投資環境

（2022年1月18日～2022年7月15日）

当作成期の投資適格社債市場は、2022年3月上旬にかけて、米国における積極的な金融引締め観測や緊迫するウクライナ情勢を背景に下落基調で推移しました。その後ロシアとウクライナの停戦交渉への期待から反転し、米国金利の上昇の一服などを受けて上値を切り上げる展開となりました。

新興国債券市場は、ロシアによるウクライナ侵攻の激化による影響や、米国金利の上昇を受けて下落基調で推移しました。米国の金融引締めによる景気減速懸念が高まり金融市場のセンチメントが悪化したことも悪材料となりました。

ハイイールド社債市場は、ウクライナ情勢をめぐる懸念や米国金利の上昇に伴う景気減速懸念などを背景に、おおむね下落基調で推移しました。

運用概況

（2022年1月18日～2022年7月15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ーサステナブル・インカム・ポートフォリオ クラスS1QG（為替ヘッジあり）」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ーサステナブル・インカム・ポートフォリオ クラスS1QG（為替ヘッジあり）】

SDGs*達成に貢献する発行体等を選別するトップダウンアプローチにより、長期的な観点から事業存続可能性の高い発行体を抽出し、幅広い債券セクターから魅力度の高い投資機会を追求して運用しました。

その結果、セクター配分においては、国債やハイイールド社債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。

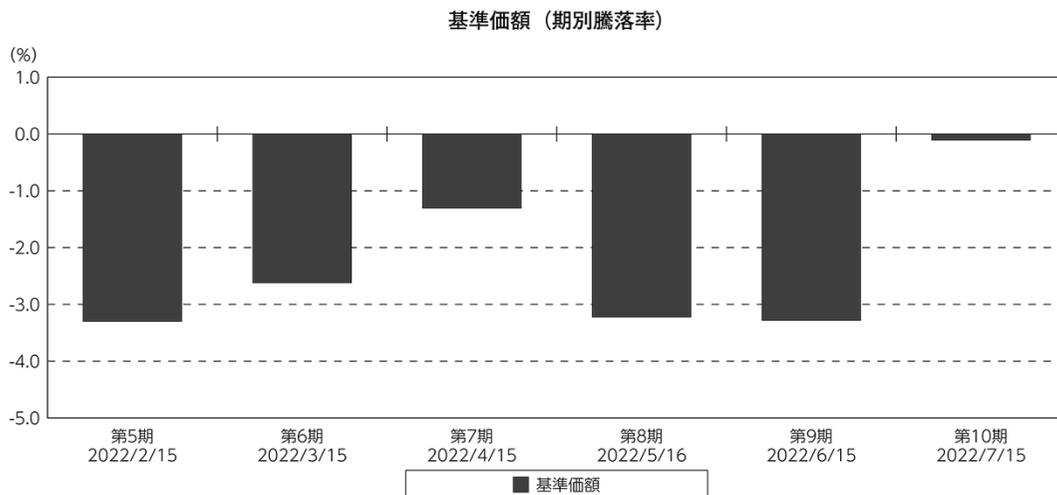
【アライアンス・バーンスタイン・日本債券インデックス・マザーファンド】

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

（2022年1月18日～2022年7月15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1月18日～2022年7月15日）

当作成期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：100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5期 | 第6期 | 第7期 | 第8期 | 第9期 | 第10期 |
|-----------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2022年1月18日～ 2022年2月15日 | 2022年2月16日～ 2022年3月15日 | 2022年3月16日～ 2022年4月15日 | 2022年4月16日～ 2022年5月16日 | 2022年5月17日～ 2022年6月15日 | 2022年6月16日～ 2022年7月15日 |
| 当期分配金 | — | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 |
| （対基準価額比率） | —% | 0.217% | 0.220% | 0.228% | 0.236% | 0.237% |
| 当期の収益 | — | 20 | — | — | 20 | — |
| 当期の収益以外 | — | — | 20 | 20 | — | 20 |
| 翌期繰越分配対象額 | 58 | 131 | 111 | 91 | 153 | 133 |

（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・インカム・ポートフォリオ クラスS1QG（為替ヘッジあり）」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・インカム・ポートフォリオ クラスS1QG（為替ヘッジあり）】

足元では、すでに利上げに着手した米国に続き欧州でも利上げに踏み切る方針が示されるなど金融政策の正常化が注目されています。また、ロシアによるウクライナ侵攻の長期化、供給制約やサプライチェーンの混乱も懸念されます。このような不確実性が高い環境下、様々な債券セクターを投資対象とすることで攻めと守りの両方の局面に対応する方針です。市場環境に応じてより魅力的な債券セクターに重点的に資産配分を行うことで、相対的に高い格付と好利回りの両立を目指します。また、グローバル社会が強くコミットしているSDGs（持続可能な開発目標）達成への貢献度を考慮することで、環境変化への対応に優れ事業が存続する可能性が高い企業や、サステナブルな社会を実現する国などの発行体を選別して投資します。こうした発行体の債券は、長期的な信用力の安定が見込めるほか、投資家の需要の高まりの恩恵を受けやすいとみています。引き続き、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発行体の債券に投資することで、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。

（注）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1月18日～2022年7月15日）

| 項 目 | 第5期～第10期 | | 項 目 の 概 要 |
|--|--------------------------------|--|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| | 円 | % | |
| (a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社) | 28 (2) (25) (1) | 0.310 (0.027) (0.270) (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、基準価額の算出等の対価 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 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) | 4 (4) | 0.047 (0.047) | (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・交付および届出に係る費用等 |
| 合 計 | 32 | 0.357 | |
| 作成期間中の平均基準価額は、9,109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。

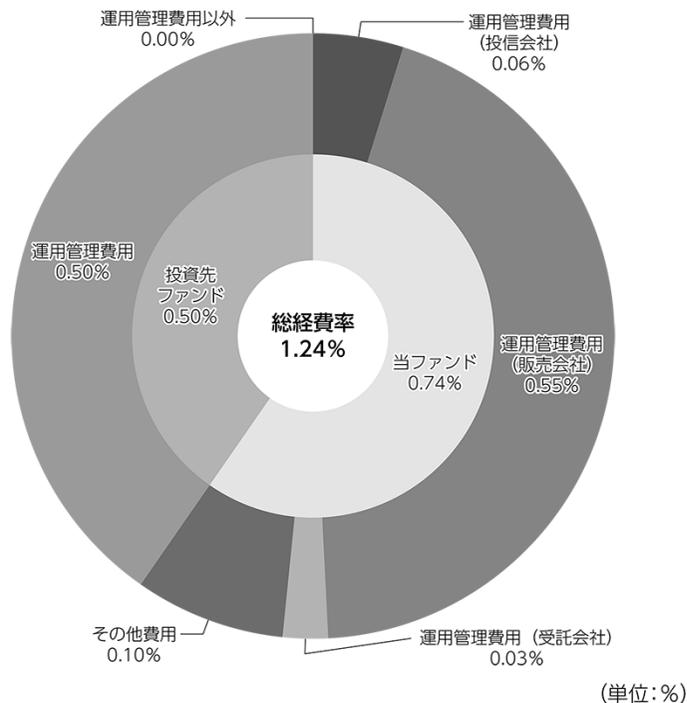
(注) 組入投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入ファンドの概要」に表示することとしております。

(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1.24%です。



| | |
|----------------------|------|
| 総経費率(①+②+③) | 1.24 |
| ①当ファンドの費用の比率 | 0.74 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.50 |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.00 |

(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1月18日～2022年7月15日）

投資信託証券

| 銘柄 | | 第5期～第10期 | | | |
|----|---|------------|--------------|----------|-------------|
| | | 買付 | | 売付 | |
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内 | AB SICAV I- サステナブル・インカム・ポートフォリオ クラスS1QGシェアーズ(為替ヘッジあり) | 口 2,425 | 千円 20,287 | 口 455 | 千円 4,310 |

(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1月18日～2022年7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。

○自己設定による当ファンドの設定・解約状況

（2022年1月18日～2022年7月15日）

| 第5期首残高(元本) | 当作成期設定元本 | 当作成期解約元本 | 第10期末残高(元本) | 取引の理由 |
|------------|----------|----------|-------------|-------------|
| 百万円 1 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 1 | 当初設定時における取得 |

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) 一印は該当なし。

○組入資産の明細

（2022年7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 | | 第4期末 | | 第10期末 | | |
|----|---|-------|-------|-------|--------|------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 評価額 | 比率 |
| | | 口 | 千円 | 口 | 千円 | % |
| | AB SICAV I- サステナブル・インカム・ポートフォリオ クラスS1QGシェアーズ(為替ヘッジあり) | 5,115 | 7,086 | 7,086 | 58,813 | 98.4 |
| | 合 計 | 5,115 | 7,086 | 7,086 | 58,813 | 98.4 |

(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 | 柄 | 第4期末 | | 第10期末 | | |
|------------------------------------|---|------|----|-------|----|-------|
| | | 口 | 数 | 口 | 数 | 評 価 額 |
| | | | 千口 | | 千口 | 千円 |
| 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 | | 8 | | 8 | | 9 |

(注) 単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年7月15日現在)

| 項 目 | 第10期末 | |
|------------------------------------|--------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 58,813 | % 98.1 |
| 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 | 9 | 0.0 |
| コール・ローン等、その他 | 1,122 | 1.9 |
| 投資信託財産総額 | 59,944 | 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5期末 | 第6期末 | 第7期末 | 第8期末 | 第9期末 | 第10期末 |
|------------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | 2022年2月15日現在 | 2022年3月15日現在 | 2022年4月15日現在 | 2022年5月16日現在 | 2022年6月15日現在 | 2022年7月15日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 49,232,092 | 44,035,965 | 43,363,472 | 41,889,121 | 40,577,291 | 59,944,875 |
| コール・ローン等 | 4,712,150 | 1,162,022 | 1,045,229 | 939,771 | 835,657 | 1,121,170 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 44,510,042 | 42,864,038 | 42,308,380 | 40,939,482 | 39,731,999 | 58,813,824 |
| 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 | 9,900 | 9,905 | 9,863 | 9,868 | 9,635 | 9,881 |
| (B) 負債 | 3,564,500 | 120,745 | 212,496 | 121,876 | 121,025 | 172,650 |
| 未払金 | — | — | 90,000 | — | — | — |
| 未払収益分配金 | — | 95,432 | 95,224 | 95,461 | 95,819 | 142,056 |
| 未払解約金 | 3,535,276 | — | — | — | — | — |
| 未払信託報酬 | 25,227 | 21,857 | 23,549 | 22,809 | 21,767 | 26,417 |
| 未払利息 | 12 | 2 | 3 | 2 | 2 | 3 |
| その他未払費用 | 3,985 | 3,454 | 3,720 | 3,604 | 3,437 | 4,174 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 45,667,592 | 43,915,220 | 43,150,976 | 41,767,245 | 40,456,266 | 59,772,225 |
| 元本 | 48,219,163 | 47,716,006 | 47,612,406 | 47,730,626 | 47,909,855 | 71,028,286 |
| 次期繰越損益金 | △ 2,551,571 | △ 3,800,786 | △ 4,461,430 | △ 5,963,381 | △ 7,453,589 | △ 11,256,061 |
| (D) 受益権総口数 | 48,219,163口 | 47,716,006口 | 47,612,406口 | 47,730,626口 | 47,909,855口 | 71,028,286口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,471円 | 9,203円 | 9,063円 | 8,751円 | 8,444円 | 8,415円 |

(注) 第5期首元本額52,022,981円、第5～10期中追加設定元本額23,434,243円、第5～10期中一部解約元本額4,428,938円。第10期末現在における1口当たり純資産額0.8415円。

(注) 第10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△11,256,061円です。

○損益の状況

| 項 目 | 第5期 | 第6期 | 第7期 | 第8期 | 第9期 | 第10期 |
|------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2022年1月18日～ 2022年2月15日 | 2022年2月16日～ 2022年3月15日 | 2022年3月16日～ 2022年4月15日 | 2022年4月16日～ 2022年5月16日 | 2022年5月17日～ 2022年6月15日 | 2022年6月16日～ 2022年7月15日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 70 | 468, 227 | △ 78 | △ 71 | 419, 207 | △ 127 |
| 受取配当金 | — | 468, 322 | — | — | 419, 266 | — |
| 支払利息 | △ 70 | △ 95 | △ 78 | △ 71 | △ 59 | △ 127 |
| (B) 有価証券売買損益 | △1, 530, 825 | △1, 623, 323 | △ 546, 323 | △1, 368, 893 | △1, 766, 982 | △ 87, 929 |
| 売買益 | 94, 268 | 931 | 762 | 5 | — | 246 |
| 売買損 | △1, 625, 093 | △1, 624, 254 | △ 547, 085 | △1, 368, 898 | △1, 766, 982 | △ 88, 175 |
| (C) 信託報酬等 | △ 29, 212 | △ 25, 311 | △ 27, 269 | △ 26, 413 | △ 25, 204 | △ 30, 591 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △1, 560, 107 | △1, 180, 407 | △ 573, 670 | △1, 395, 377 | △1, 372, 979 | △ 118, 647 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 648, 531 | △2, 185, 576 | △3, 453, 388 | △4, 122, 282 | △5, 613, 120 | △ 7, 081, 918 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 342, 933 | △ 339, 371 | △ 339, 148 | △ 350, 261 | △ 371, 671 | △ 3, 913, 440 |
| (配当等相当額) | (28, 537) | (28, 243) | (28, 268) | (29, 582) | (32, 654) | (388, 103) |
| (売買損益相当額) | (△ 371, 470) | (△ 367, 614) | (△ 367, 416) | (△ 379, 843) | (△ 404, 325) | (△ 4, 301, 543) |
| (G) 計(D+E+F) | △2, 551, 571 | △3, 705, 354 | △4, 366, 206 | △5, 867, 920 | △7, 357, 770 | △11, 114, 005 |
| (H) 収益分配金 | 0 | △ 95, 432 | △ 95, 224 | △ 95, 461 | △ 95, 819 | △ 142, 056 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △2, 551, 571 | △3, 800, 786 | △4, 461, 430 | △5, 963, 381 | △7, 453, 589 | △11, 256, 061 |
| 追加信託差損益金 | △ 342, 933 | △ 339, 371 | △ 339, 148 | △ 350, 261 | △ 371, 671 | △ 3, 913, 440 |
| (配当等相当額) | (28, 537) | (28, 243) | (28, 268) | (29, 582) | (32, 654) | (388, 103) |
| (売買損益相当額) | (△ 371, 470) | (△ 367, 614) | (△ 367, 416) | (△ 379, 843) | (△ 404, 325) | (△ 4, 301, 543) |
| 分配準備積立金 | 253, 040 | 597, 882 | 501, 271 | 405, 810 | 703, 994 | 561, 938 |
| 繰越損益金 | △2, 461, 678 | △4, 059, 297 | △4, 623, 553 | △6, 018, 930 | △7, 785, 912 | △ 7, 904, 559 |

(注) 損益の状況の中で(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) 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5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(28,537円)および分配準備積立金額(253,040円)より分配対象収益額は281,577円(10,000口当たり58円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第6期計算期間末における費用控除後の配当等収益額(442,916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(28,243円)および分配準備積立金額(250,398円)より分配対象収益額は721,557円(10,000口当たり151円)であり、うち95,432円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

(注) 第7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(28,268円)および分配準備積立金額(596,495円)より分配対象収益額は624,763円(10,000口当たり131円)であり、うち95,224円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

(注) 第8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(29,582円)および分配準備積立金額(501,271円)より分配対象収益額は530,853円(10,000口当たり111円)であり、うち95,461円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

(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(394,003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(32,654円)および分配準備積立金額(405,810円)より分配対象収益額は832,467円(10,000口当たり173円)であり、うち95,819円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

(注) 第10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(388,103円)および分配準備積立金額(703,994円)より分配対象収益額は1,092,097円(10,000口当たり153円)であり、うち142,056円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

○分配金のお知らせ

| | 第5期 | 第6期 | 第7期 | 第8期 | 第9期 | 第10期 |
|----------------|-----|-----|-----|-----|-----|------|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 0円 | 20円 | 20円 | 20円 | 20円 | 20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。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2022年7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（122,752,158千口）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 | 第10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 | 111,881,800 (111,881,800) | 111,941,518 (111,941,518) | 77.2 (77.2) | — (—) | — (—) | — (—) | 77.2 (77.2) |
| 合 計 | 111,881,800 (111,881,800) | 111,941,518 (111,941,518) | 77.2 (77.2) | — (—) | — (—) | — (—) | 77.2 (77.2) |

(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10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 | 37,681,950 | 2022/7/20 |
| 第1071回国庫短期証券 | | — | 37,500,000 | 37,512,225 | 2022/10/11 |
| 第1088回国庫短期証券 | | — | 36,700,000 | 36,747,343 | 2023/6/20 |
| 合 計 | | | 111,881,800 | 111,941,518 | |

(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 | 第10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 144,960 | 百万円 — |

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) 一印は該当なし。

AB SICAV I - サステナブル・インカム・ポートフォリオ クラスS1QGシェアーズ（為替ヘッジあり）

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）が組入対象とするルクセンブルグ籍円建外国投資証券「AB SICAV I - サステナブル・インカム・ポートフォリオ クラスS1QGシェアーズ（為替ヘッジあり）」は、2022年5月31日に第1期決算を迎えておりますが、現在監査未了のため記載すべき事項はありません。



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。