



アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ハイ・インカム・オープンB (為替ヘッジあり)

[愛称：NK・コンパス (羅針盤)]

追加型投信／内外／債券

第275期(決算日2020年6月10日) 第276期(決算日2020年7月10日) 第277期(決算日2020年8月11日)
第278期(決算日2020年9月10日) 第279期(決算日2020年10月12日) 第280期(決算日2020年11月10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米国をはじめ世界中の公社債のなかから、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・ゲインの獲得をめざします。 ②債券セクター間の投資収益率の格差に着目し、より高い収益が期待される債券セクターに機動的にウェイトをかけた資産配分を行い、アクティブに運用します。 ③外貨建資産については原則として為替ヘッジを行います。
主要運用対象	米国および米国外の投資適格国の国債・政府機関債、米国内のアセット・バック証券、米国内外の投資適格社債および高利回り社債、エマーゼィング・カンントリー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株式への投資割合は、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。また、繰越欠損金がある時は、これを控除します。)等の全額とします。 ②分配金は、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、分配対象収益が少額の場合は、収益分配を行わないこともあります。 ③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・ハイ・インカム・オープンB (為替ヘッジあり)」は、このたび第280期の決算を行いました。

ここに、第275期から第280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			ICEバンクオブアメリカ・US・ハイ・イールド・インデックス（米ドルベース）	期中騰落率	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（米ドルベース）	期中騰落率	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・グローバル（米ドルヘッジベース）	期中騰落率	債券組入比率	純資産総額
	(分配率)	税込み分配金	期中騰落率								
	円	円	%		%		%		%		百万円
251期(2018年6月11日)	6,698	20	△0.3	1,265.04	0.4	789.827	0.3	383.602	△0.2	93.6	1,979
252期(2018年7月10日)	6,696	20	0.3	1,266.25	0.1	799.745	1.3	387.890	1.1	95.5	1,978
253期(2018年8月10日)	6,669	20	△0.1	1,282.77	1.3	789.853	△1.2	386.237	△0.4	94.6	1,964
254期(2018年9月10日)	6,620	20	△0.4	1,284.81	0.2	776.018	△1.8	386.724	0.1	97.6	1,945
255期(2018年10月10日)	6,555	20	△0.7	1,284.55	△0.0	782.568	0.8	382.082	△1.2	96.6	1,923
256期(2018年11月12日)	6,498	15	△0.6	1,276.20	△0.6	783.697	0.1	384.558	0.6	96.6	1,910
257期(2018年12月10日)	6,488	15	0.1	1,259.74	△1.3	785.240	0.2	390.873	1.6	95.6	1,901
258期(2019年1月10日)	6,509	15	0.6	1,272.28	1.0	809.104	3.0	394.453	0.9	91.9	1,905
259期(2019年2月12日)	6,541	15	0.7	1,294.84	1.8	826.606	2.2	398.166	0.9	92.6	1,907
260期(2019年3月11日)	6,544	15	0.3	1,305.55	0.8	825.772	△0.1	400.416	0.6	93.9	1,909
261期(2019年4月10日)	6,580	15	0.8	1,333.20	2.1	838.630	1.6	404.097	0.9	95.5	1,919
262期(2019年5月10日)	6,566	15	0.0	1,336.46	0.2	834.023	△0.5	405.773	0.4	93.9	1,916
263期(2019年6月10日)	6,611	15	0.9	1,339.28	0.2	857.250	2.8	415.147	2.3	91.4	1,931
264期(2019年7月10日)	6,629	15	0.5	1,359.32	1.5	876.106	2.2	418.819	0.9	94.9	1,930
265期(2019年8月13日)	6,657	15	0.6	1,355.46	△0.3	867.721	△1.0	428.530	2.3	92.8	1,936
266期(2019年9月10日)	6,660	15	0.3	1,376.41	1.5	870.094	0.3	430.557	0.5	93.3	1,938
267期(2019年10月10日)	6,641	15	△0.1	1,369.40	△0.5	867.943	△0.2	432.052	0.3	95.2	1,908
268期(2019年11月11日)	6,579	15	△0.7	1,380.93	0.8	858.972	△1.0	423.716	△1.9	96.8	1,884
269期(2019年12月10日)	6,576	15	0.2	1,389.36	0.6	873.754	1.7	425.727	0.5	96.7	1,883
270期(2020年1月10日)	6,578	15	0.3	1,416.95	2.0	893.874	2.3	425.686	△0.0	97.3	1,883
271期(2020年2月10日)	6,603	15	0.6	1,420.33	0.2	913.971	2.2	433.286	1.8	98.2	1,887
272期(2020年3月10日)	6,574	15	△0.2	1,333.31	△6.1	891.197	△2.5	453.816	4.7	92.7	1,874
273期(2020年4月10日)	6,281	15	△4.2	1,259.48	△5.5	821.955	△7.8	444.330	△2.1	97.5	1,790
274期(2020年5月11日)	6,358	15	1.5	1,281.57	1.8	831.149	1.1	445.913	0.4	96.9	1,811
275期(2020年6月10日)	6,532	15	3.0	1,374.07	7.2	891.212	7.2	443.400	△0.6	98.1	1,863
276期(2020年7月10日)	6,515	15	△0.0	1,359.72	△1.0	895.127	0.4	449.554	1.4	92.7	1,860
277期(2020年8月11日)	6,604	15	1.6	1,416.62	4.2	935.263	4.5	452.054	0.6	94.1	1,825
278期(2020年9月10日)	6,576	15	△0.2	1,417.55	0.1	924.827	△1.1	448.607	△0.8	90.6	1,819
279期(2020年10月12日)	6,565	15	0.1	1,426.38	0.6	912.376	△1.3	449.367	0.2	98.2	1,813
280期(2020年11月10日)	6,585	20	0.6	1,461.00	2.4	930.170	2.0	446.979	△0.5	96.8	1,804

(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。

※参考指数について

- ・ICEバンクオブアメリカ・US・ハイ・イールド・インデックス（*）（米ドルベース）は、米ドル建てで発行されたハイ・イールド・ボンド市場の動きを示す指数で、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。
- （*）ICEバンクオブアメリカ・US・ハイ・イールド・インデックス：ICE BofA US High Yield Index
- ・JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（米ドルベース）は、エマージングの債券市場の動きを表す指数で、新興国が発行する米ドル建ての国債を対象に時価総額ベースで算出されたものです。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。
- ・JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・グローバル（米ドルヘッジベース）は、先進国の債券市場の動きを表す指数で、先進国が発行する国債を対象に為替ヘッジにかかる費用相当分を考慮して算出されたものです。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		ICEバンクオブアメリカ・US・ハイ・イールド・インデックス(米ドルベース)		JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(米ドルベース)		JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・グローバル(米ドルヘッジベース)		債券組入比率
		円	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
第275期	(期首) 2020年5月11日	6,358	—	1,281.57	—	831.149	—	445.913	—	96.9
	5月末	6,468	1.7	1,331.76	3.9	872.336	5.0	446.072	0.0	96.8
	(期末) 2020年6月10日	6,547	3.0	1,374.07	7.2	891.212	7.2	443.400	△0.6	98.1
第276期	(期首) 2020年6月10日	6,532	—	1,374.07	—	891.212	—	443.400	—	98.1
	6月末	6,501	△0.5	1,343.33	△2.2	887.171	△0.5	448.340	1.1	92.5
	(期末) 2020年7月10日	6,530	△0.0	1,359.72	△1.0	895.127	0.4	449.554	1.4	92.7
第277期	(期首) 2020年7月10日	6,515	—	1,359.72	—	895.127	—	449.554	—	92.7
	7月末	6,600	1.3	1,405.29	3.4	914.639	2.2	452.432	0.6	93.4
	(期末) 2020年8月11日	6,619	1.6	1,416.62	4.2	935.263	4.5	452.054	0.6	94.1
第278期	(期首) 2020年8月11日	6,604	—	1,416.62	—	935.263	—	452.054	—	94.1
	8月末	6,586	△0.3	1,421.21	0.3	919.672	△1.7	446.882	△1.1	89.8
	(期末) 2020年9月10日	6,591	△0.2	1,417.55	0.1	924.827	△1.1	448.607	△0.8	90.6
第279期	(期首) 2020年9月10日	6,576	—	1,417.55	—	924.827	—	448.607	—	90.6
	9月末	6,552	△0.4	1,402.73	△1.0	899.984	△2.7	451.420	0.6	95.1
	(期末) 2020年10月12日	6,580	0.1	1,426.38	0.6	912.376	△1.3	449.367	0.2	98.2
第280期	(期首) 2020年10月12日	6,565	—	1,426.38	—	912.376	—	449.367	—	98.2
	10月末	6,540	△0.4	1,414.12	△0.9	900.387	△1.3	450.035	0.1	96.1
	(期末) 2020年11月10日	6,605	0.6	1,461.00	2.4	930.170	2.0	446.979	△0.5	96.8

(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。

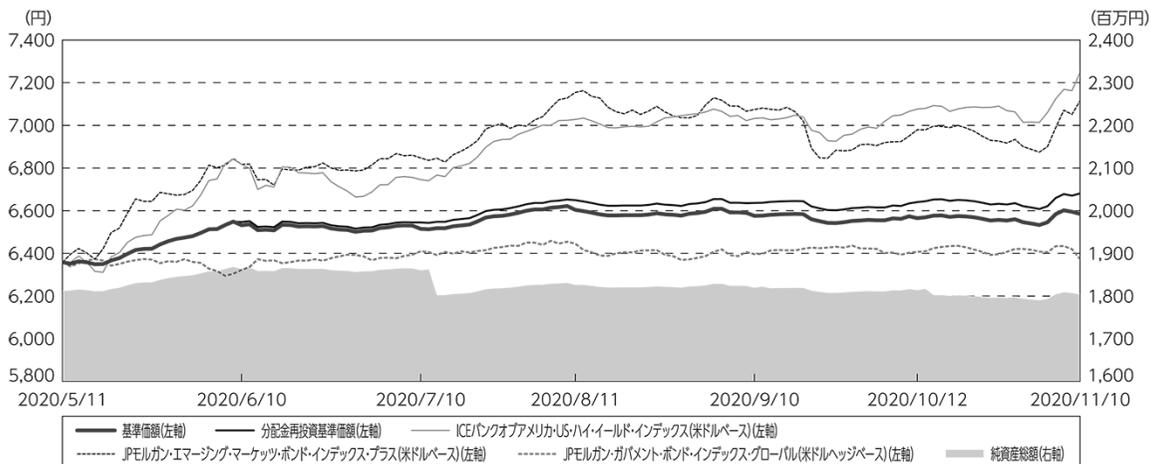
(注) 月末は、各月の最終営業日です。

運用経過

アラライアンス・バーンスタイン・グローバル・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）（以下「当ファンド」といことがあります。）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

（2020年5月12日～2020年11月10日）



第275期首：6,358円

第280期末：6,585円（既払分配金（税込み）：95円）

騰落率：5.1%（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および参考指数は、作成期首（2020年5月11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、ICEバンクオブアメリカ・US・ハイ・イールド・インデックス（米ドルベース）、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（米ドルベース）およびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・グローバル（米ドルヘッジベース）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5.1%の上昇※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いませんので、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

値上がり要因

- ・保有債券の利息収入
- ・資産担保証券、エネルギー関連や小売関連のハイイールド社債の価格上昇
- ・金融関連の投資適格社債の価格上昇

値下がり要因

- ・米国やイギリスの国債の価格下落

投資環境

(2020年5月12日～2020年11月10日)

当作成期の債券市場については、ハイイールド社債および新興国債券は堅調に推移し、先進国国債は相対的に弱い動きとなりました。また、為替市場では円高ドル安が進行しました。

先進国の国債：

米回国債は、当作成期初から2020年6月上旬にかけて、市場予想を上回る雇用統計を受け景気の早期回復への期待が高まったことから金利は上昇（価格は下落）しました。その後8月初旬にかけて、新型コロナウイルスの感染再拡大や米中関係の一段の悪化を懸念し金利は低下（価格は上昇）しましたが、その後当作成期末にかけては再び上昇しました。

ドイツ国債は、当作成期初から2020年6月上旬にかけては、米回国債金利の上昇に伴って金利は上昇しました。その後は、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念が高まり景気の先行き不透明感などから金利はおおむね低下基調で推移しました。当作成期末はワクチン開発への期待から上昇しました。

日本国債は、新型コロナウイルスの国内感染者数増加に対する懸念や、ワクチン開発への期待などに左右され、当作成期を通じて方向感のない展開となりました。

ハイイールド社債：

経済活動正常化への期待が高まったことなどを背景に米国株式市場が堅調に推移したことを受けて上昇しました。世界的な低金利を背景とした利回り需要の高まりも当市場に追い風となりました。

新興国債券：

堅調な米国株式市場の流れやドル安の進展などを受けて上昇基調で推移しました。アルゼンチン、エクアドルについて、2020年8月に主要債権者団との債務再編交渉がまとまったことも当市場に追い風となりました。

運用概況

（2020年5月12日～2020年11月10日）

当ファンドは先進国の投資適格債をはじめ、ハイイールド債や新興国債券など世界中の公社債の中から、相対的に投資価値が高い証券に分散投資を行います。運用にあたっては当作成期も引き続き債券セクター間の投資収益率の格差に着目し、より高い収益が期待される債券セクターに機動的に資産配分を行いました。

その結果、新興国債券、先進国の投資適格社債等、ハイイールド社債の組入比率が上昇した一方、先進国の国債の組入比率は低下しました。

当作成期間中の売買では、先進国の国債については、米国国債を一部売却しました。先進国の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、小売関連銘柄などを一部売却しました。ハイイールド社債については、情報・テクノロジー関連銘柄などを買い増した一方、小売関連銘柄などを一部売却しました。新興国債券については、エジプト国債を新規で買いつけた一方、コロンビアのエネルギー関連銘柄などを一部売却しました。

なお、当ファンドの外貨建資産については、当作成期を通じ、高い為替ヘッジ比率を維持しました。

<公社債のセクター別組入比率>

前作成期末（2020年5月11日現在）

セクター	比率
先進国の国債	47.6%
ハイイールド社債	25.4%
先進国の投資適格社債等	13.9%
新興国債券	9.9%
その他資産	0.2%
現金等	3.0%



当作成期末（2020年11月10日現在）

セクター	比率
先進国の国債	35.0%
ハイイールド社債	28.8%
先進国の投資適格社債等	17.9%
新興国債券	15.2%
その他資産	0.2%
現金等	3.0%

（注）組入比率は純資産総額に対する評価額の割合（それぞれ小数第2位を四捨五入）。

（注）「その他資産」は、株式、新株予約権付社債（転換社債）の合計。

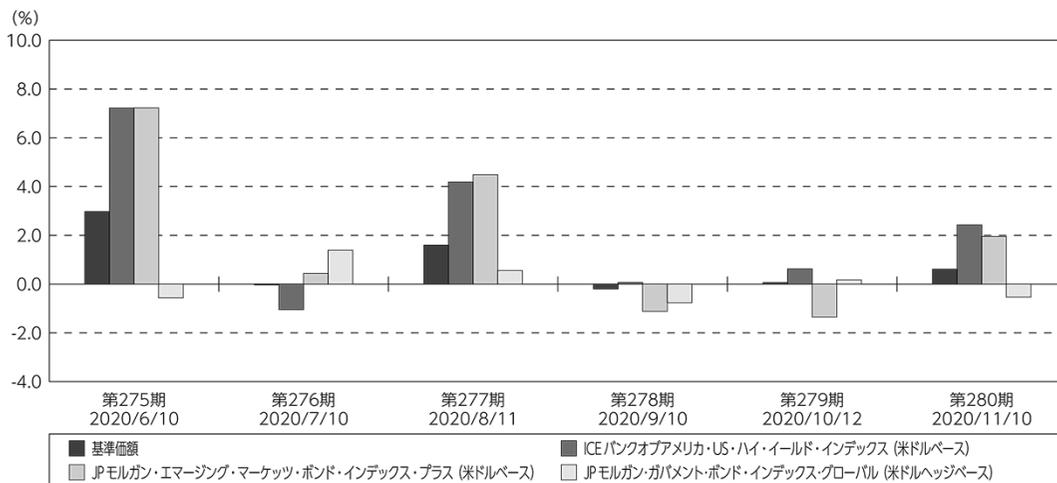
（注）格付はムーディーズとS&Pのうちいずれか高い方を採用して集計したものです。

当ファンドのベンチマークとの差異

（2020年5月12日～2020年11月10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、ICEバンクオブアメリカ・US・ハイ・イールド・インデックス（米ドルベース）、JPモルガン・エマーゼィング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（米ドルベース）およびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・グローバル（米ドルヘッジベース）です。

分配金

（2020年5月12日～2020年11月10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、為替のヘッジ・コスト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：95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275期	第276期	第277期	第278期	第279期	第280期
	2020年5月12日～ 2020年6月10日	2020年6月11日～ 2020年7月10日	2020年7月11日～ 2020年8月11日	2020年8月12日～ 2020年9月10日	2020年9月11日～ 2020年10月12日	2020年10月13日～ 2020年11月10日
当期分配金 (対基準価額比率)	15 0.229%	15 0.230%	15 0.227%	15 0.228%	15 0.228%	20 0.303%
当期の収益	15	15	15	15	15	19
当期の収益以外	—	—	—	—	—	0
翌期繰越分配対象額	3,307	3,309	3,320	3,322	3,324	3,324

(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、欧米などの一部の地域で再びロックダウンが強化されたことから、引き続き慎重な見極めが必要ではあるものの、主要国が矢継ぎ早に繰り出している過去最大級の財政政策や金融政策などが経済活動回復の追い風となり、2021年はプラス成長となる見込みです。

先進国のうち、米国経済は、2020年7-9月期の実質国内総生産（GDP）成長率は大きく持ち直し、3四半期ぶりのプラスかつ過去最大の伸びとなりました。2021年は、現在までに打ち出されている3兆ドルを超える経済対策が後押しとなりプラス成長に回復すると予想しています。

ハイイールド社債については、引き続きファンダメンタルズは悪化しており、足元のデフォルト率は上昇していますが、上昇ペースは鈍化していることから、2021年には低下に転じるとみています。需給環境は起債ペースが高止まりしてはいるものの、BB格を中心とする魅力的な発行条件により強い需要が続いています。米国大統領選挙などリスク材料をめぐりボラティリティが高まる局面も想定されることから、運用にあたっては、デュレーションが短く、十分に分散されたディフェンシブなポートフォリオを維持しつつ、ファンダメンタルズ対比で割安と判断する銘柄についても選別的に組み入れていく方針です。

新興国債券については、引き続き新型コロナウイルスやコモディティ価格などをめぐる不確実性はあるものの、新興国債券市場への資金流入は継続しています。一方で、米中関係ならびに米国大統領選挙の影響について注視する必要がある状況が続いています。引き続き、構造改革が進展するなど財政改善が見込める国や悪材料を十分に織り込み、価格面で魅力が出てきた国に投資妙味があると考えています。一方、対外収支の脆弱な国については慎重なスタンスとします。

※将来の市場環境の変動などにより、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

（2020年5月12日～2020年11月10日）

項 目	第275期～第280期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 56	% 0.855	(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 ）	(25)	(0.386)	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 ）	(29)	(0.441)	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) そ の 他 費 用	2	0.025	(b) 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 ）	(1)	(0.016)	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)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.004)	その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	58	0.880	
作成期間中の平均基準価額は、6,541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。

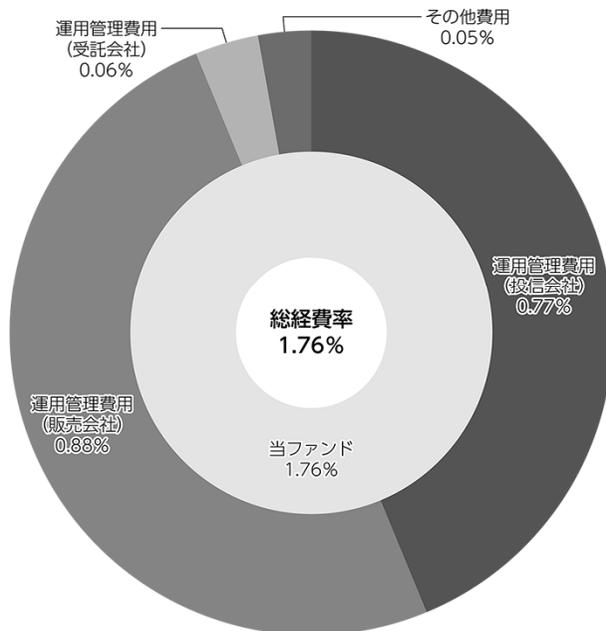
(注) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。ただし、平均基準価額は円未満切り捨て。

(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1.76%です。



(注) 当ファンドの費用は1万円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

（2020年5月12日～2020年11月10日）

株式

			第275期～第280期			
			買 付		売 付	
			株 数	金 額	株 数	金 額
外国	未上場・ 未登録株式	アメリカ	百株 — (44)	千米ドル — (5)	百株 —	千米ドル —

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は株式分割、予約権行使（株式転換）、合併等による増減分です。

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) —印は該当なし。

新株予約権付社債（転換社債）

			第275期～第280期			
			買 付		売 付	
			額 面	金 額	額 面	金 額
外国	アメリカ	千米ドル —	千米ドル —	千米ドル 35	千米ドル 5	

(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) 単位未満は切り捨て。

(注) —印は該当なし。

公社債

			第275期～第280期	
			買 付 額	売 付 額
外	アメリカ	国債証券	千米ドル 1,708	千米ドル 1,672 (1,515)
		地方債証券	—	54
		社債券	2,556	1,431 (307)
国	ブラジル	国債証券	千ブラジルリアル 577	千ブラジルリアル 562
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	スペイン	国債証券	—	— (31)
	その他	国債証券	90	—

(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、上段の数字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。

直物為替先渡取引状況

種 類 別	第275期～第280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
(ブラジルリアル)	81	80	81	80

(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。

○株式売買比率

(2020年5月12日～2020年11月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第275期～第280期
(a) 当作成期中の株式売買金額	565千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	3,044千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.18

(注) 株式売買金額は、受け渡し代金。

(注) 平均組入株式時価総額は、各月末現在の組入株式時価総額（外貨建株式は、当該月末日の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した額）の単純平均。

(注) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月12日～2020年11月10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

(2020年11月10日現在)

外国株式

銘柄	株数	株数	第280期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ…上場・店頭株式) BERRY CORP	百株 29	百株 29	千米ドル 9	千円 980	エネルギー	
(アメリカ…未上場・未登録株式) CHC GROUP LLC	10	55	0.08323	8	—	
SOUTHEASTERN GROCERS INC	1	1	13	1,441	—	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	42 3	87 3	23 —	2,430 <0.1%>	
(カナダ…上場・店頭株式) TERVITA CORPORATION	30	30	千カナダドル 5	475	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	30 1	30 1	5 —	475 <0.0%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	73 4	117 4	— —	2,906 <0.2%>	

(注) 邦貨換算金額は、第280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) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注) —印は該当なし。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	第280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
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	13,107	14,225	1,496,640	83.0	32.3	48.4	27.6	6.9
カナダ	千カナダドル 285	千カナダドル 320	25,934	1.4	—	0.3	1.1	—
メキシコ	千メキシコペソ 7,557	千メキシコペソ 8,439	43,545	2.4	—	0.8	1.6	—
ブラジル	千ブラジルレアル 572	千ブラジルレアル 630	12,311	0.7	0.7	—	0.7	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	30	49	6,132	0.3	—	0.3	—	—
フランス	49	83	10,364	0.6	—	0.6	—	—
スペイン	75	117	14,640	0.8	—	0.8	—	—
ベルギー	64	116	14,531	0.8	—	0.8	—	—
その他	100	103	12,877	0.7	0.7	0.7	—	—
イギリス	千英ポンド 223	千英ポンド 354	49,171	2.7	—	2.7	—	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 1,500	千スウェーデンクローナ 1,504	18,337	1.0	—	—	—	1.0
オーストラリア	千オーストラリアドル 259	千オーストラリアドル 297	22,766	1.3	—	0.3	—	1.0
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 228	千ニュージーランドドル 265	19,092	1.1	—	—	1.1	—
合 計	—	—	1,746,346	96.8	33.7	55.8	32.1	8.9

(注) 邦貨換算金額は、第280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・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利率	額面金額	第280期末		償還年月日
				評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	ARAB REPUBLIC OF EGYPT	6.2004	200	209	22,087	2024/3/1
	DOMINICAN REPUBLIC	5.95	100	112	11,829	2027/1/25
	REPUBLIC OF BRAZIL	7.125	100	131	13,838	2037/1/20
	REPUBLIC OF COLOMBIA	3.125	200	210	22,167	2031/4/15
	REPUBLIC OF EL SALVADOR	7.625	80	66	7,041	2034/9/21
	REPUBLIC OF LEBANESE6.6	—	17	2	250	2026/11/27
	REPUBLIC OF LEBANESE6.65	—	5	0.7	73	2024/4/22
	REPUBLIC OF LEBANESE6.85	—	6	0.84	88	2027/3/23
	REPUBLIC OF PANAMA	3.75	20	21	2,266	2026/4/17
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.7	200	234	24,632	2041/3/1
	REPUBLIC OF URUGUAY	7.875	41	64	6,806	2033/1/15
	REPUBLIC OF URUGUAY	7.625	75	118	12,506	2036/3/21
	REPUBLIC OF VENEZ 9	—	12	1	113	2023/5/7
	UNITED MEXICAN STATES	4.0	324	353	37,219	2023/10/2
	US TREASURY	—	517	517	54,422	2020/12/3
	US TREASURY	7.25	360	404	42,562	2022/8/15
	US TREASURY	7.125	466	539	56,759	2023/2/15
	US TREASURY	7.625	912	1,191	125,336	2025/2/15
	US TREASURY	6.0	351	451	47,470	2026/2/15
	US TREASURY	2.0	1,017	1,102	115,960	2026/11/15
	US TREASURY	3.125	60	77	8,193	2044/8/15
地方債証券	CALIFORNIA ST	7.95	0.00577	0.00579	0.609	2036/3/1
	CALIFORNIA ST	7.6	30	53	5,640	2040/11/1
普通社債券	1011778 BC / NEW RED FIN	5.75	16	17	1,803	2025/4/15
	ABC SUPPLY CO INC	4.0	5	5	549	2028/1/15
	ACADIA HEALTHCARE CO INC	6.5	9	9	975	2024/3/1
	ACE CAPITAL TRUST II	9.7	15	22	2,366	2030/4/1
	ACRISURE LLC / FIN INC	8.125	15	15	1,674	2024/2/15
	ADAMS HOMES INC	7.5	9	9	964	2025/2/15
	ADAPTHEALTH LLC	6.125	4	4	449	2028/8/1
	ADIANT US LLC	9.0	30	34	3,606	2025/4/15
	ADT CORP	4.125	33	34	3,673	2023/6/15
	ADVANCED DRAINAGE SYSTEM	5.0	3	3	332	2027/9/30
	ADVANTAGE SALES & MARKET	6.5	28	28	2,989	2028/11/15
	AIRCASTLE LTD	5.0	3	3	323	2023/4/1
	AIRCASTLE LTD	4.4	10	10	1,066	2023/9/25
	AIRCASTLE LTD	4.125	5	4	519	2024/5/1
	AIRCASTLE LTD	5.25	27	27	2,899	2025/8/11
	ALBERTSONS COS/SAFEWAY	5.75	3	3	325	2025/3/15
	ALBERTSONS COS/SAFEWAY	4.625	9	9	1,012	2027/1/15
	ALBERTSONS COS/SAFEWAY	4.875	7	7	812	2030/2/15
	ALLEGHANY CORP	3.625	40	44	4,710	2030/5/15
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CO	4.75	22	21	2,239	2024/12/15
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CO	7.0	22	22	2,372	2026/1/15

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）

銘	柄	第280期末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	普通社債券						
	ALLIANT HOLD / CO-ISSUER	6.75	7	7	794	2027/10/15	
	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO	6.625	32	34	3,623	2026/7/15	
	ALLISON TRANSMISSION INC	5.875	16	17	1,886	2029/6/1	
	ALLY FINANCIAL INC	5.8	13	15	1,613	2025/5/1	
	ALLY FINANCIAL INC	8.0	20	28	2,994	2031/11/1	
	ALTRIA GROUP INC	4.8	35	41	4,357	2029/2/14	
	AMC ENTERTAINMENT HOLDIN	5.75	14	1	154	2025/6/15	
	AMC ENTERTAINMENT HOLDIN	5.875	30	3	343	2026/11/15	
	AMC NETWORKS INC	5.0	30	30	3,218	2024/4/1	
	AMERICAN AXLE & MFG INC	6.875	38	40	4,262	2028/7/1	
	AMERICAN EXPRESS CO	3.53538	4	3	399	2099/9/15	
	APACHE CORP	4.625	2	2	211	2025/11/15	
	APACHE CORP	4.875	5	5	535	2027/11/15	
	APX GROUP INC	7.875	10	10	1,056	2022/12/1	
	APX GROUP INC	6.75	11	11	1,253	2027/2/15	
	ARAMARK SERVICES INC	6.375	26	28	2,951	2025/5/1	
	ARCELORMITTAL	7.25	25	31	3,354	2039/10/15	
	ARCONIC CORP	6.0	19	20	2,174	2025/5/15	
	ARCONIC ROLLED PRODUCTS	6.125	6	6	683	2028/2/15	
	AT&T INC	2.75	40	42	4,435	2031/6/1	
	AVAYA INC	6.125	30	32	3,388	2028/9/15	
	AVIATION CAPITAL GROUP	2.875	6	6	637	2022/1/20	
	AVIATION CAPITAL GROUP	3.875	15	15	1,584	2023/5/1	
	AVIATION CAPITAL GROUP	4.375	5	5	529	2024/1/30	
	AVIATION CAPITAL GROUP	5.5	23	24	2,528	2024/12/15	
	AVIATION CAPITAL GROUP	4.875	11	10	1,152	2025/10/1	
	AVIATION CAPITAL GROUP	3.5	9	7	828	2027/11/1	
	AVIS BUDGET CAR RENTAL	5.75	3	2	311	2027/7/15	
	BANCO DE CREDITO DEL PER	3.125	26	26	2,803	2030/7/1	
	BANK OF AMERICA CORP	6.25	26	28	3,026	2099/9/5	
	BANK OF AMERICA CORP	6.3	17	19	2,049	2099/9/10	
	BANK OF AMERICA CORP	6.5	9	10	1,069	2099/10/23	
	BANK OF NY MELLON CORP	3.64738	6	5	624	2099/12/20	
	BAT CAPITAL CORP	3.215	29	31	3,313	2026/9/6	
	BAT CAPITAL CORP	4.7	7	8	855	2027/4/2	
	BAUSCH HEALTH COS INC	6.25	44	47	5,009	2029/2/15	
	BBA US HOLDINGS INC	5.375	13	13	1,412	2026/5/1	
	BEAZER HOMES USA	5.875	4	4	440	2027/10/15	
	BERRY PLASTICS CORP	5.125	10	10	1,069	2023/7/15	
	BFLD 2019-DPLO E	2.38838	10	9	951	2034/10/15	
	BMW US CAPITAL LLC	3.9	41	45	4,827	2025/4/9	
	BOARDWALK PIPELINES LP	3.4	45	43	4,613	2031/2/15	
	BOMBARDIER INC	5.75	2	1	207	2022/3/15	
	BOMBARDIER INC	6.125	7	6	667	2023/1/15	
	BOMBARDIER INC	7.5	7	5	596	2025/3/15	
	BOOKING HOLDINGS INC	4.625	35	42	4,426	2030/4/13	

アラライアンス・バーンスタイン・グローバル・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）

銘	柄	第280期末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	普通社債券					
	BOXER PARENT CO INC	7.125	9	9	1,027	2025/10/2
	BROADCOM INC	4.7	23	26	2,758	2025/4/15
	BROADCOM INC	4.25	36	40	4,281	2026/4/15
	BROADCOM INC	4.11	18	20	2,142	2028/9/15
	BROOKFIELD RESID PROPERT	6.25	17	17	1,860	2027/9/15
	BROOKFIELD RESID PROPERT	4.875	18	17	1,838	2030/2/15
	BURLINGTON COAT FACTORY	6.25	3	3	333	2025/4/15
	BWAY HOLDING CO	5.5	16	16	1,729	2024/4/15
	CALPINE CORP	5.125	23	24	2,612	2028/3/15
	CARNIVAL CORP	11.5	45	50	5,357	2023/4/1
	CARRIZO OIL & GAS INC	6.25	12	5	549	2023/4/15
	CARS.COM INC	6.375	9	9	981	2028/11/1
	CAS 2014-C04 2M2	5.14925	16	16	1,749	2024/11/25
	CAS 2015-C01 1M2	4.44925	22	23	2,454	2025/2/25
	CAS 2015-C02 1M2	4.14925	33	33	3,562	2025/5/25
	CAS 2015-C02 2M2	4.14925	14	15	1,584	2025/5/25
	CAS 2015-C03 1M2	5.14925	33	34	3,610	2025/7/25
	CAS 2015-C03 2M2	5.14925	7	7	814	2025/7/25
	CAS 2015-C04 1M2	5.84925	39	41	4,386	2028/4/25
	CAS 2016-C01 1M2	6.89925	15	15	1,681	2028/8/25
	CAS 2016-C01 2M2	7.09925	7	7	823	2028/8/25
	CAS 2016-C02 1M2	6.14925	28	30	3,161	2028/9/25
	CAS 2016-C03 2M2	6.04925	23	24	2,579	2028/10/25
	CAS 2016-C05 2M2	4.59925	16	16	1,768	2029/1/25
	CAS 2016-C07 2M2	4.49925	6	7	744	2029/4/25
	CAS 2018-R07 1M2	2.54925	5	5	547	2031/4/25
	CAS 2019-R01 2M2	2.59925	26	26	2,741	2031/7/25
	CAS 2019-R02 1M2	2.44925	18	18	1,973	2031/8/25
	CAS 2019-R05 1M2	2.14925	23	23	2,423	2039/7/25
	CAS 2019-R06 2M2	2.24925	51	51	5,415	2039/9/25
	CAS 2019-R07 1M2	2.24925	35	35	3,730	2039/10/25
	CATALENT PHARMA SOLUTION	4.875	8	8	861	2026/1/15
	CATALENT PHARMA SOLUTION	5.0	4	4	444	2027/7/15
	CD&R SMOKEY BUYER INC	6.75	3	3	339	2025/7/15
	CDW LLC/CDW FINANCE	4.125	14	14	1,551	2025/5/1
	CEDAR FAIR LP	5.25	7	7	741	2029/7/15
	CEDAR FAIR/CAN/MAGNUM/MI	5.5	45	47	5,011	2025/5/1
	CENOVUS ENERGY INC	5.375	12	13	1,412	2025/7/15
	CENTENE CORP	5.375	18	19	2,018	2026/8/15
	CENTURYLINK INC	6.45	27	27	2,915	2021/6/15
	CF INDUSTRIES INC	4.95	10	12	1,276	2043/6/1
	CFX ESCROW CORP	6.0	4	4	440	2024/2/15
	CFX ESCROW CORP	6.375	4	4	452	2026/2/15
	CHARLES SCHWAB CORP	5.375	30	33	3,507	2099/12/1
	CHARTER COMM OPT LLC/CAP	4.2	11	12	1,322	2028/3/15
	CHARTER COMM OPT LLC/CAP	5.05	35	42	4,437	2029/3/30

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）

銘柄	銘柄	第280期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千円ドル	千円ドル	千円		
アメリカ	普通社債券						
	CHENIERE ENERGY PARTNERS	5.25	19	19	2,050	2025/10/1	
	CHENIERE ENERGY PARTNERS	4.5	7	7	795	2029/10/1	
	CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	8.125	4	3	373	2024/6/30	
	CIT GROUP INC	3.929	6	6	672	2024/6/19	
	CITGO PETROLEUM CORP	6.25	15	14	1,571	2022/8/15	
	CITGO PETROLEUM CORP	7.0	30	28	3,014	2025/6/15	
	CITIGROUP INC	3.106	57	61	6,497	2026/4/8	
	CITIGROUP INC	4.45	31	36	3,809	2027/9/29	
	CITIGROUP INC	4.37513	7	6	732	2099/8/15	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	4.1935	3	2	307	2099/10/6	
	CLEAN HARBORS INC	4.875	15	15	1,681	2027/7/15	
	CLEAN HARBORS INC	5.125	7	7	813	2029/7/15	
	CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	5.125	16	16	1,714	2027/8/15	
	CLEAVER-BROOKS INC	7.875	5	4	514	2023/3/1	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	9.875	31	36	3,832	2025/10/17	
	COLT MERGER SUB INC	6.25	20	21	2,242	2025/7/1	
	COMERICA INC	5.625	38	41	4,342	2099/10/1	
	COMMSCOPE FINANCE LLC	5.5	9	9	976	2024/3/1	
	COMMSCOPE FINANCE LLC	6.0	9	9	1,009	2026/3/1	
	COMMSCOPE FINANCE LLC	8.25	3	3	340	2027/3/1	
	CONSOLIDATED COMMUNICATI	6.5	31	33	3,532	2028/10/1	
	COVEY PARK ENERGY LLC/FI	7.5	19	19	2,037	2025/5/15	
	CVS HEALTH CORP	3.625	6	6	716	2027/4/1	
	CVS HEALTH CORP	4.78	30	37	3,926	2038/3/25	
	DANA INC	5.375	3	3	337	2027/11/15	
	DANA INC	5.625	4	4	451	2028/6/15	
	DELL INT LLC / EMC CORP	5.85	4	4	499	2025/7/15	
	DELL INT LLC / EMC CORP	4.9	11	12	1,340	2026/10/1	
	DELTA AIR LINES INC	7.0	23	26	2,739	2025/5/1	
	DELTA AIR LINES/SKYMILES	4.5	11	12	1,293	2025/10/20	
	DELTA AIR LINES/SKYMILES	4.75	13	13	1,448	2028/10/20	
	DISH DBS CORP	5.0	20	20	2,182	2023/3/15	
	DISH DBS CORP	7.75	2	2	235	2026/7/1	
	ECOPETROL SA	6.875	10	12	1,306	2030/4/29	
	ECOPETROL SA	5.875	2	2	243	2045/5/28	
	EMBRAER NETHERLANDS FINA	5.4	10	9	1,025	2027/2/1	
	EMERGENT BIOSOLUTIONS	3.875	4	4	431	2028/8/15	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	4.75	6	6	672	2028/6/15	
	ENERGY TRANSFER EQUITY	4.25	20	20	2,201	2023/3/15	
	ENLINK MIDSTREAM PARTNER	4.4	3	2	294	2024/4/1	
	ENOVA INTERNATIONAL INC	8.5	10	9	978	2025/9/15	
	EQT CORP	3.9	8	8	842	2027/10/1	
	EQT CORP	8.75	14	17	1,888	2030/2/1	
	FINANCIAL & RISK US HOLD	6.25	3	3	340	2026/5/15	
	FINANCIAL & RISK US HOLD	8.25	2	2	232	2026/11/15	
	FIRSTCASH INC	4.625	4	4	434	2028/9/1	

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）

銘柄	銘柄	第280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
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千米ドル	千米ドル	千円			
アメリカ	普通社債券							
	FMG RESOURCES AUG 2006	4.5	20	22	2,322	2027/9/15		
	FORD MOTOR CO	8.5	90	101	10,691	2023/4/21		
	FORD MOTOR CO	9.0	26	31	3,330	2025/4/22		
	FORD MOTOR CO	7.45	7	8	927	2031/7/16		
	FORESTAR GROUP INC	5.0	6	5	630	2028/3/1		
	FORTERRA FIN LLC/FRTA FI	6.5	5	5	565	2025/7/15		
	FOX CORP	4.709	35	41	4,413	2029/1/25		
	FREEPORT-MCMORAN INC	5.0	13	13	1,466	2027/9/1		
	FREEPORT-MCMORAN INC	5.25	13	14	1,543	2029/9/1		
	FRONT RANGE BIDCO INC	4.0	8	8	854	2027/3/1		
	GARDA WORLD SECURITY	4.625	15	15	1,578	2027/2/15		
	GARTNER INC	4.5	9	9	1,023	2028/7/1		
	GENERAL ELECTRIC CO	5.0	118	104	10,996	2099/12/15		
	GENERAL MOTORS CO	4.875	14	15	1,613	2023/10/2		
	GENERAL MOTORS FINL CO	3.7	2	2	222	2023/5/9		
	GENERAL MOTORS FINL CO	4.25	2	2	225	2023/5/15		
	GENERAL MOTORS FINL CO	4.15	6	6	675	2023/6/19		
	GENERAL MOTORS FINL CO	5.1	9	9	1,047	2024/1/17		
	GENERAL MOTORS FINL CO	3.95	3	3	339	2024/4/13		
	GENERAL MOTORS FINL CO	3.5	4	4	449	2024/11/7		
	GENERAL MOTORS FINL CO	4.3	7	7	813	2025/7/13		
	GENERAL MOTORS FINL CO	5.25	2	2	243	2026/3/1		
	GENERAL MOTORS FINL CO	5.65	20	24	2,534	2029/1/17		
	GENESIS ENERGY LP/FIN	6.25	7	5	627	2026/5/15		
	GEO GROUP INC	6.0	2	1	140	2026/4/15		
	GFL ENVIRONMENTAL INC	5.125	7	7	785	2026/12/15		
	GLOBAL PART/GLP FINANCE	7.0	8	8	882	2027/8/1		
	GLOBAL PART/GLP FINANCE	6.875	8	8	876	2029/1/15		
	GOEASY LTD	5.375	17	17	1,857	2024/12/1		
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	4.16525	30	29	3,126	2099/11/10		
	GRAPHIC PACKAGING INTL	4.75	12	13	1,387	2027/7/15		
	GRIFFON CORP	5.75	23	24	2,599	2028/3/1		
	GRINDING MED/MC GRINDING	7.375	10	10	1,073	2023/12/15		
	GULFPORT ENERGY CORP	6.375	12	7	738	2025/5/15		
	GULFPORT ENERGY CORP	6.375	13	7	813	2026/1/15		
	H&E EQUIPMENT SERVICES	5.625	9	9	987	2025/9/1		
	HANESBRANDS INC	4.625	15	15	1,666	2024/5/15		
	HARLEY-DAVIDSON FINL SER	3.35	31	33	3,483	2025/6/8		
	HCA INC	5.25	18	21	2,227	2026/6/15		
	HCA INC	4.5	10	11	1,203	2027/2/15		
	HERC HOLDINGS INC	5.5	12	12	1,341	2027/7/15		
	HESS MIDSTREAM PARTNERS	5.625	23	23	2,453	2026/2/15		
	HILTON DOMESTIC OPERATIN	5.375	6	6	672	2025/5/1		
	HILTON DOMESTIC OPERATIN	5.125	10	10	1,091	2026/5/1		
	HILTON DOMESTIC OPERATIN	5.75	6	6	690	2028/5/1		
	HULK FINANCE CORP	7.0	3	3	335	2026/6/1		

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）

銘	柄	第280期末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	普通社債券					
	HUSKY ENERGY INC	4.4	40	41	4,358	2029/4/15
	HYUNDAI CAPITAL AMERICA	5.875	58	67	7,128	2025/4/7
	IAA SPINCO INC	5.5	6	6	668	2027/6/15
	IHEARTCOMMUNICATIONS INC	5.25	15	15	1,610	2027/8/15
	INDIGO NATURAL RES LLC	6.875	10	10	1,062	2026/2/15
	INRETAIL PHARMA SA	5.375	16	16	1,750	2023/5/2
	INSTALLED BUILDING PRODU	5.75	4	4	442	2028/2/1
	INTELLIGENT PACKAGING	6.0	18	18	1,968	2028/9/15
	INTERPUBLIC GROUP COS	4.75	30	36	3,830	2030/3/30
	IRB HOLDING CORP	7.0	9	9	1,026	2025/6/15
	IRB HOLDING CORP	6.75	23	23	2,450	2026/2/15
	IRON MOUNTAIN INC	5.0	14	14	1,564	2028/7/15
	IRON MOUNTAIN INC	4.5	40	41	4,353	2031/2/15
	JELD-WEN INC	4.625	3	3	323	2025/12/15
	JOSEPH T RYERSON & SON I	8.5	9	9	1,033	2028/8/1
	JPMORGAN CHASE & CO	6.75	19	20	2,206	2099/8/1
	JPMORGAN CHASE & CO	4.01438	1	0.99491	104	2099/11/1
	KAISER ALUMINUM CORP	6.5	6	6	680	2025/5/1
	KAR AUCTION SERVICES INC	5.125	9	9	983	2025/6/1
	KB HOME	7.0	65	68	7,158	2021/12/15
	KRAFT HEINZ FOODS CO	3.95	9	10	1,054	2025/7/15
	L BRANDS INC	6.875	3	3	343	2025/7/1
	L BRANDS INC	5.25	7	7	753	2028/2/1
	L BRANDS INC	7.5	7	7	806	2029/6/15
	L BRANDS INC	6.95	18	17	1,871	2033/3/1
	L BRANDS INC	6.875	13	13	1,439	2035/11/1
	L BRANDS INC	6.75	34	35	3,762	2036/7/1
	LAMAR MEDIA CORP	4.875	7	7	784	2029/1/15
	LAMB WESTON HLD	4.625	12	12	1,331	2024/11/1
	LAMB WESTON HLD	4.875	12	12	1,329	2026/11/1
	LEAR CORP	3.8	50	53	5,657	2027/9/15
	LEAR CORP	4.25	7	7	807	2029/5/15
	LEIDOS INC	4.375	30	35	3,694	2030/5/15
	LENNAR CORP	4.75	64	64	6,786	2021/4/1
	LEVI STRAUSS & CO	5.0	21	21	2,274	2025/5/1
	LEVIATHAN BOND LTD	6.5	20	21	2,295	2027/6/30
	LIBERTY MUTUAL GROUP	7.8	30	37	3,940	2037/3/15
	LIFEPOINT HEALTH INC	6.75	20	21	2,286	2025/4/15
	LIFEPOINT HEALTH INC	4.375	38	39	4,113	2027/2/15
	LOGAN MERGER SUB INC	5.5	5	5	545	2027/9/1
	LPL HOLDINGS INC	5.75	8	8	877	2025/9/15
	LYB INT FINANCE III	3.375	30	33	3,480	2030/5/1
	MARATHON PETROLEUM CORP	3.8	30	32	3,385	2028/4/1
	MARRIOTT INTERNATIONAL	5.75	7	8	844	2025/5/1
	MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	6.125	19	20	2,156	2025/9/15
	MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	6.5	24	25	2,671	2026/9/15

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）

銘柄	銘柄	第280期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		千円	
				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						
	MATTAMY GROUP CORP	5.25	9	9	1,003	2027/12/15	
	MATTEL INC	6.75	2	2	222	2025/12/31	
	MATTEL INC	5.875	15	16	1,751	2027/12/15	
	MDGH - GMTN BV	2.875	200	214	22,574	2030/5/21	
	MEDNAX INC	5.25	3	3	320	2023/12/1	
	MEDNAX INC	6.25	5	5	563	2027/1/15	
	MEREDITH CORP	6.875	22	20	2,161	2026/2/1	
	MERITOR INC	6.25	7	7	783	2025/6/1	
	MFT 2018-4A C	4.91	3	3	398	2028/12/15	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4.25	12	12	1,332	2025/9/1	
	MICRON TECHNOLOGY INC	5.327	35	42	4,468	2029/2/6	
	MORGAN STANLEY	3.95	40	45	4,787	2027/4/23	
	MORGAN STANLEY	4.04688	5	4	523	2099/7/15	
	MPH ACQUISITION HOLDINGS	5.75	24	24	2,556	2028/11/1	
	MPLX LP	4.5	10	10	1,138	2023/7/15	
	MPLX LP	4.125	14	15	1,627	2027/3/1	
	MPLX LP	2.65	45	44	4,674	2030/8/15	
	MSC 2019-BPR D	4.14838	13	10	1,085	2036/5/15	
	MURPHY OIL USA INC	5.625	3	3	335	2027/5/1	
	NABORS INDUSTRIES LTD	7.25	10	4	475	2026/1/15	
	NABORS INDUSTRIES LTD	7.5	13	5	571	2028/1/15	
	NATIONAL CINEMEDIA LLC	5.75	11	5	599	2026/8/15	
	NATIONAL CINEMEDIA LLC	5.875	12	8	871	2028/4/15	
	NATIONWIDE MUTUAL INSURA	9.375	62	105	11,071	2039/8/15	
	NAVIENT CORP	6.625	12	12	1,298	2021/7/26	
	NCR CORP	8.125	9	10	1,057	2025/4/15	
	NCR CORP	5.75	9	9	1,009	2027/9/1	
	NCR CORP	6.125	9	9	1,028	2029/9/1	
	NETFLIX INC	4.375	29	32	3,434	2026/11/15	
	NETFLIX INC	4.875	21	24	2,591	2028/4/15	
	NEW FORTRESS ENERGY INC	6.75	24	25	2,699	2025/9/15	
	NEXSTAR ESCROW INC	5.625	10	10	1,132	2027/7/15	
	NGL ENRGY PART LP/FIN CO	7.5	17	8	884	2023/11/1	
	NIELSEN FINANCE LLC/CO	5.0	5	5	527	2022/4/15	
	NIELSEN FINANCE LLC/CO	5.625	9	9	1,019	2028/10/1	
	NIELSEN FINANCE LLC/CO	5.875	8	8	920	2030/10/1	
	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE	2.8	3	3	320	2022/1/13	
	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE	2.6	6	6	640	2022/9/28	
	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE	3.45	3	3	324	2023/3/15	
	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE	3.875	8	8	879	2023/9/21	
	NOVELIS CORP	5.875	29	30	3,238	2026/9/30	
	NXP BV/NXP FDG/NXP USA	2.7	5	5	560	2025/5/1	
	NXP BV/NXP FDG/NXP USA	3.875	9	10	1,066	2026/6/18	
	NXP BV/NXP FUNDING LLC	4.875	18	20	2,132	2024/3/1	
	NXP BV/NXP FUNDING LLC	5.35	16	19	2,010	2026/3/1	
	OCCIDENTAL PETROLEUM COR	2.9	27	24	2,628	2024/8/15	

アラリアンス・バーンスタイン・グローバル・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）

銘	柄	第280期末				
		利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	普通社債券					
	OCCIDENTAL PETROLEUM COR	8.0	10	10	1,119	2025/7/15
	OCCIDENTAL PETROLEUM COR	3.2	8	6	725	2026/8/15
	OLIN CORP	5.625	25	27	2,867	2029/8/1
	OMNICOM GROUP INC	4.2	42	49	5,196	2030/6/1
	ONEOK INC	4.35	26	27	2,944	2029/3/15
	OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	4.625	6	5	624	2030/3/15
	OWENS CORNING	7.0	24	32	3,432	2036/12/1
	PANTHER BF AGGREGATOR 2	6.25	16	17	1,816	2026/5/15
	PAR PHARMACEUTICAL INC	7.5	17	18	1,940	2027/4/1
	PARKLAND FUEL CORP	6.0	19	19	2,103	2026/4/1
	PBF HOLDING CO LLC	9.25	20	20	2,123	2025/5/15
	PDC ENERGY INC	6.125	10	10	1,063	2024/9/15
	PDC ENERGY INC	5.75	21	21	2,212	2026/5/15
	PEABODY SEC FIN CORP	6.0	12	4	508	2022/3/31
	PENSKE AUTOMOTIVE GROUP	3.5	10	10	1,074	2025/9/1
	PENSKE AUTOMOTIVE GROUP	5.5	4	4	442	2026/5/15
	PETROBRAS GLOBAL FINANCE	5.093	20	21	2,280	2030/1/15
	PETROLEOS DE VENEZ 5.375	—	18	0.558	58	2027/4/12
	PETROLEOS DE VENEZ 6	—	99	2	312	2026/11/15
	PETROLEOS MEXICANOS	6.49	12	11	1,230	2027/1/23
	PETROLEOS MEXICANOS	6.5	10	9	987	2029/1/23
	PETROLEOS MEXICANOS	6.84	13	12	1,289	2030/1/23
	PETROLEOS MEXICANOS	5.95	47	41	4,378	2031/1/28
	PETROLEOS MEXICANOS	7.69	12	10	1,134	2050/1/23
	PLAINS ALL AMER PIPELINE	4.65	31	33	3,512	2025/10/15
	PLAINS ALL AMER PIPELINE	4.5	11	11	1,250	2026/12/15
	POLYONE CORP	5.75	8	8	911	2025/5/15
	POST HOLDINGS INC	5.0	28	29	3,087	2026/8/15
	POST HOLDINGS INC	5.625	15	16	1,706	2028/1/15
	PRESIDIO HOLDINGS INC	4.875	3	3	330	2027/2/1
	PROVIDENCE SERVICE CORP	5.875	4	4	444	2025/11/15
	PULTE GROUP INC	5.0	45	52	5,510	2027/1/15
	PULTE GROUP INC	7.875	3	4	453	2032/6/15
	PULTE GROUP INC	6.375	4	5	543	2033/5/15
	QEP RESOURCES INC	5.25	13	10	1,093	2023/5/1
	QEP RESOURCES INC	5.625	4	2	282	2026/3/1
	RALPH LAUREN CORP	2.95	40	41	4,390	2030/6/15
	RANGE RESOURCES CORP	5.0	3	3	317	2023/3/15
	REALOGY GROUP/CO-ISSUER	9.375	17	18	1,980	2027/4/1
	REGENCY ENERGY PARTNERS	5.0	17	17	1,886	2022/10/1
	REGIONS FINANCIAL	7.375	45	66	6,952	2037/12/10
	REINSURANCE GRP OF AMER	3.9	30	34	3,607	2029/5/15
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5.375	8	8	869	2025/1/15
	ROSS STORES INC	4.7	15	17	1,848	2027/4/15
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES	10.875	23	25	2,718	2023/6/1
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES	11.5	39	45	4,799	2025/6/1

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）

銘	柄	第280期末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	普通社債券					
	SABRE GBLB INC	5.25	10	10	1,066	2023/11/15
	SABRE GBLB INC	9.25	10	11	1,235	2025/4/15
	SANTANDER HOLDINGS USA	3.244	12	12	1,362	2026/10/5
	SANTANDER HOLDINGS USA	4.4	18	20	2,118	2027/7/13
	SCIENCE APPLICATIONS INT	4.875	3	3	334	2028/4/1
	SCRIPPS ESCROW INC	5.875	18	17	1,874	2027/7/15
	SEAGATE HDD CAYMAN	4.091	18	19	2,069	2029/6/1
	SHEA HOMES LP/FNDG CP	4.75	7	7	758	2028/2/15
	SHEA HOMES LP/FNDG CP	4.75	10	10	1,073	2029/4/1
	SILVERSEA CRUISE FINANCE	7.25	25	25	2,665	2025/2/1
	SINCLAIR TELEVISION GROU	5.5	14	13	1,435	2030/3/1
	SIRIUS XM RADIO INC	4.625	18	18	1,972	2024/7/15
	SIX FLAGS THEME PARKS	7.0	14	15	1,608	2025/7/1
	SM ENERGY CO	6.125	4	3	338	2022/11/15
	SM ENERGY CO	5.625	24	10	1,070	2025/6/1
	SM ENERGY CO	6.75	4	1	165	2026/9/15
	SOUTHERN STAR CENTRAL CO	5.125	10	10	1,052	2022/7/15
	SOUTHWEST AIRLINES CO	5.25	41	46	4,893	2025/5/4
	SPECIALTY BUILDING PRODU	6.375	15	15	1,645	2026/9/30
	SPECTRUM BRANDS INC	6.125	9	9	970	2024/12/15
	SPECTRUM BRANDS INC	5.75	5	5	542	2025/7/15
	SPIRIT LOYALTY KY LTD/IP	8.0	28	32	3,369	2025/9/20
	SPRINT NEXTEL CORP	6.0	25	26	2,836	2022/11/15
	STACR 2015-HQA1 M3	4.84925	184	190	20,084	2028/3/25
	STACR 2016-HQA1 M3	6.49925	195	205	21,588	2028/9/25
	STACR 2019-DNA3 M2	2.19925	11	11	1,157	2049/7/25
	STACR 2019-DNA4 M2	2.09925	31	31	3,314	2049/10/25
	STACR 2019-HQA1 M2	2.49925	15	15	1,633	2049/2/25
	STACR 2020-DNA1 M2	1.84925	95	93	9,844	2050/1/25
	STANDARD INDUSTRIES INC	4.375	26	27	2,909	2030/7/15
	STAPLES INC	7.5	21	20	2,184	2026/4/15
	STARS GRP HLDS/STARS GRP	7.0	18	19	2,035	2026/7/15
	STEVENS HOLDING CO INC	6.125	4	4	457	2026/10/1
	SUGAR HSP GMNG PROP/FIN	5.875	15	14	1,552	2025/5/15
	SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	5.25	5	5	562	2029/1/15
	SUNOCO LOGISTICS PARTNER	3.9	8	8	871	2026/7/15
	SUNOCO LP/FINANCE CORP	5.5	14	14	1,513	2026/2/15
	SUNOCO LP/FINANCE CORP	5.875	12	12	1,347	2028/3/15
	SYNCHRONY FINANCIAL	2.85	11	11	1,194	2022/7/25
	SYNCHRONY FINANCIAL	4.375	6	6	690	2024/3/19
	SYNCHRONY FINANCIAL	4.5	14	15	1,644	2025/7/23
	SYSCO CORPORATION	5.95	5	6	685	2030/4/1
	T-MOBILE USA INC	3.875	30	34	3,613	2030/4/15
	TALEN ENERGY SUPPLY LLC	6.5	10	6	658	2025/6/1
	TALEN ENERGY SUPPLY LLC	7.25	6	6	644	2027/5/15
	TARGA RESOURCES PARTNERS	6.5	15	16	1,706	2027/7/15

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）

銘柄	銘柄	第280期末				
		利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	普通社債券					
	TAYLOR MORR COMM/HLDGS	5.875	24	25	2,673	2023/4/15
	TAYLOR MORR COMM/HLDGS	5.625	5	5	559	2024/3/1
	TAYLOR MORRISON COMM	5.875	7	7	837	2027/6/15
	TEGNA INC	4.75	10	10	1,112	2026/3/15
	TEGNA INC	5.0	25	26	2,761	2029/9/15
	TENET HEALTHCARE CORP	4.875	9	9	988	2026/1/1
	TENET HEALTHCARE CORP	5.125	9	9	998	2027/11/1
	TENNECO INC	5.0	11	9	979	2026/7/15
	TEREX CORP	5.625	8	8	869	2025/2/1
	TRANSCANADA PIPELINES	4.1	35	40	4,248	2030/4/15
	TRANSDIGM INC	8.0	70	77	8,124	2025/12/15
	TRANSDIGM INC	6.25	25	26	2,806	2026/3/15
	TRANSOCEAN PHOENIX 2 LTD	7.75	13	12	1,344	2024/10/15
	TRIPADVISOR INC	7.0	7	7	783	2025/7/15
	TRIUMPH GROUP INC	8.875	7	7	805	2024/6/1
	TRIUMPH GROUP INC	6.25	10	8	939	2024/9/15
	TRUIST FINANCIAL CORP	5.1	12	13	1,420	2099/9/1
	TRUIST FINANCIAL CORP	4.95	43	46	4,914	2099/12/1
	UNITED STATES STEEL CORP	12.0	27	30	3,247	2025/6/1
	UNIVISION COMMUNICATIONS	5.125	7	7	751	2025/2/15
	UNIVISION COMMUNICATIONS	9.5	17	18	1,975	2025/5/1
	VAIL RESORTS INC	6.25	6	6	675	2025/5/15
	VALEANT PHARMACEUTICALS	5.5	14	14	1,474	2023/3/1
	VALERO ENERGY CORP	4.0	40	42	4,490	2029/4/1
	VALVOLINE INC	4.375	15	15	1,633	2025/8/15
	VERITAS US INC/BERMUDA L	7.5	40	41	4,387	2025/9/1
	VF CORP	2.8	12	12	1,366	2027/4/23
	VIACOMCBS INC	4.95	35	43	4,527	2031/1/15
	VINE OIL & GAS LP / FIN	8.75	7	5	581	2023/4/15
	VISTRA OPERATIONS CO LLC	5.625	20	21	2,264	2027/2/15
	VMWARE INC	4.5	32	36	3,810	2025/5/15
	VOC ESCROW LTD	5.0	16	15	1,632	2028/2/15
	WABTEC CORP	4.4	5	5	574	2024/3/15
	WESCO DISTRIBUTION INC	7.125	7	7	811	2025/6/15
	WESCO DISTRIBUTION INC	7.25	6	6	717	2028/6/15
	WESTERN MIDSTREAM OPERAT	4.0	7	7	743	2022/7/1
	WESTERN MIDSTREAM OPERAT	3.95	5	4	513	2025/6/1
	WESTERN MIDSTREAM OPERAT	4.5	2	1	201	2028/3/1
	WESTERN MIDSTREAM OPERAT	4.75	19	18	1,932	2028/8/15
	WESTERN MIDSTREAM OPERAT	5.05	16	15	1,681	2030/2/1
	WESTINGHOUSE AIR BRAKE	3.2	3	3	335	2025/6/15
	WILLIAM CARTER	5.5	14	15	1,591	2025/5/15
	WILLIAM CARTER	5.625	11	11	1,248	2027/3/15
	WR GRACE & CO-CONN	4.875	7	7	784	2027/6/15
	WYNDHAM DESTINATIONS INC	6.625	9	10	1,059	2026/7/31
	WYNDHAM HOTELS & RESORTS	5.375	10	10	1,090	2026/4/15

アラリアンス・バーンスタイン・グローバル・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）

銘柄			第280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	WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	5.5	19	19	2,006	2025/3/1		
		WYNN RESORTS FINANCE LLC	5.125	16	16	1,720	2029/10/1		
		XEROX CORPORATION	4.375	12	12	1,336	2023/3/15		
		XPO LOGISTICS INC	6.125	13	13	1,394	2023/9/1		
		YUM! BRANDS INC	7.75	25	27	2,937	2025/4/1		
		ZIMMER BIOMET HOLDINGS	3.55	45	50	5,320	2030/3/20		
小	計					1,496,640			
カナダ				千カナダドル	千カナダドル				
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	2.5	230	247	20,000	2024/6/1		
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	55	73	5,934	2048/12/1		
小	計					25,934			
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ				
	国債証券	MEXICAN BONOS	8.0	1,198	1,315	6,790	2023/12/7		
		MEXICAN BONOS	10.0	3,644	4,335	22,369	2024/12/5		
		MEXICAN BONOS	5.75	2,715	2,787	14,385	2026/3/5		
小	計					43,545			
ブラジル				千ブラジルレアル	千ブラジルレアル				
	国債証券	REPUBLIC OF BRAZIL	10.0	528	580	11,339	2023/1/1		
		REPUBLIC OF BRAZIL	10.0	44	49	972	2025/1/1		
小	計					12,311			
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ				
	ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	6.25	30	49	6,132	2030/1/4	
		フランス	国債証券	FRENCH TREASURY	3.25	49	83	10,364	2045/5/25
		スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	4.2	75	117	14,640	2037/1/31
		ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.75	64	116	14,531	2045/6/22
		その他	国債証券	IVORY COAST	5.875	100	103	12,877	2031/10/17
小	計					58,545			
イギリス				千英ポンド	千英ポンド				
	国債証券	UK TREASURY	4.25	170	276	38,283	2040/12/7		
		UK TREASURY	3.25	53	78	10,887	2044/1/22		
小	計					49,171			
スウェーデン				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ				
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	5.0	1,500	1,504	18,337	2020/12/1		
小	計					18,337			
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	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	209	228	17,521	2022/7/15		
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	50	68	5,244	2037/4/21		
小	計					22,766			
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	5.5	161	182	13,089	2023/4/15		
		NEW ZEALAND I/L	2.2154	67	83	6,003	2025/9/20		
小	計					19,092			
合	計					1,746,346			

(注) 邦貨換算金額は、第280期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

直物為替先渡取引残高

銘柄別		取引契約残高			
		第280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	
(ブラジルリアル)	—	—	129	13	

(注) 邦貨換算金額は、第280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

（2020年11月10日現在）

項 目	第280期末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 2,906	% 0.2
公社債	1,746,347	95.5
コール・ローン等、その他	79,942	4.3
投資信託財産総額	1,829,195	100.0

（注）評価額の単位未満は切り捨て。

（注）第280期末における外貨建純資産（1,801,212千円）の投資信託財産総額（1,829,195千円）に対する比率は98.5%です。

（注）外貨建資産は、第280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=105.21円、1カナダドル=80.83円、1メキシコペソ=5.16円、1ブラジルレアル=19.54円、1ペルーソル=29.35円、1ユーロ=124.27円、1英ポンド=138.52円、1スウェーデンクローナ=12.19円、1オーストラリアドル=76.56円、1ニュージーランドドル=71.81円、1南アフリカランド=6.83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・ハイ・インカム・オープンB（為替ヘッジあり）において行った取引のうち、調査依頼を行った取引は2020年5月12日から2020年11月10日までの間で直物為替先渡取引（以下「NDF」といいます。）12件及び有価証券（非上場株式）取引1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額のほか、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275期末	第276期末	第277期末	第278期末	第279期末	第280期末
	2020年6月10日現在	2020年7月10日現在	2020年8月11日現在	2020年9月10日現在	2020年10月12日現在	2020年11月10日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	3,786,377,535	3,756,117,595	3,659,888,829	3,629,152,361	3,645,904,731	3,697,480,697
コール・ローン等	18,498,394	93,511,723	96,254,527	168,173,176	19,204,705	35,935,055
株式(評価額)	3,738,098	3,253,164	3,265,029	3,229,922	2,945,338	2,906,881
公社債(評価額)	1,827,847,860	1,725,067,256	1,718,216,841	1,649,051,761	1,780,059,055	1,746,347,108
未収入金	1,913,195,354	1,908,178,023	1,813,295,794	1,788,941,447	1,822,253,662	1,890,549,857
未収利息	22,028,867	24,845,064	27,790,687	18,469,359	17,377,127	18,860,463
前払費用	607,061	569,575	151,733	137,655	2,703,855	1,276,602
その他未収収益	461,901	692,790	914,218	1,149,041	1,360,989	1,604,731
(B) 負債	1,923,055,370	1,895,864,335	1,834,088,183	1,809,718,643	1,832,337,007	1,893,446,119
未払金	1,916,186,973	1,888,954,709	1,827,195,877	1,802,995,608	1,825,461,470	1,885,511,122
未払収益分配金	4,279,056	4,282,917	4,147,159	4,150,362	4,143,788	5,479,510
未払信託報酬	2,571,142	2,608,589	2,725,711	2,554,406	2,712,410	2,437,948
未払利息	11	—	108	147	11	23
その他未払費用	18,188	18,120	19,328	18,120	19,328	17,516
(C) 純資産総額(A-B)	1,863,322,165	1,860,253,260	1,825,800,646	1,819,433,718	1,813,567,724	1,804,034,578
元本	2,852,704,644	2,855,278,084	2,764,772,938	2,766,908,351	2,762,525,698	2,739,755,026
次期繰越損益金	△ 989,382,479	△ 995,024,824	△ 938,972,292	△ 947,474,633	△ 948,957,974	△ 935,720,448
(D) 受益権総口数	2,852,704,644口	2,855,278,084口	2,764,772,938口	2,766,908,351口	2,762,525,698口	2,739,755,026口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,532円	6,515円	6,604円	6,576円	6,565円	6,585円

(注) 第275期首元本額2,849,921,703円、第275～第280期中追加設定元本額23,943,258円、第275～第280期中一部解約元本額134,109,935円。第280期末現在における1口当たり純資産額0.6585円。

(注) 第280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△935,720,448円です。

○損益の状況

項 目	第275期	第276期	第277期	第278期	第279期	第280期
	2020年5月12日～ 2020年6月10日	2020年6月11日～ 2020年7月10日	2020年7月11日～ 2020年8月11日	2020年8月12日～ 2020年9月10日	2020年9月11日～ 2020年10月12日	2020年10月13日～ 2020年11月10日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	7,571,540	7,530,968	7,980,977	7,232,550	7,522,143	6,654,196
受取利息	7,340,434	7,300,325	7,784,292	7,001,818	7,313,665	6,413,426
その他収益金	231,554	230,692	198,623	234,660	210,967	241,412
支払利息	△ 448	△ 49	△ 1,938	△ 3,928	△ 2,489	△ 642
(B) 有価証券売買損益	51,181,931	△ 6,533,924	23,154,628	△ 7,786,173	△ 4,150,878	7,176,898
売買益	103,049,767	30,671,312	68,010,673	12,375,398	19,352,836	25,709,558
売買損	△ 51,867,836	△ 37,205,236	△ 44,856,045	△ 20,161,571	△ 23,503,714	△ 18,532,660
(C) 先物取引等取引損益	△ 2,249,811	1,251,399	327,162	△ 456,503	553,575	△ 383,483
取引益	-	1,598,004	818,672	304,926	876,219	540,303
取引損	△ 2,249,811	△ 346,605	△ 491,510	△ 761,429	△ 322,644	△ 923,786
(D) 信託報酬等	△ 2,617,892	△ 2,715,471	△ 2,802,743	△ 2,616,701	△ 2,765,154	△ 2,554,184
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	53,885,768	△ 467,028	28,660,024	△ 3,626,827	1,159,686	10,893,427
(F) 前期繰越損益金	△ 581,861,675	△ 531,994,579	△ 519,009,117	△ 494,304,734	△ 500,702,739	△ 498,536,975
(G) 追加信託差損益金	△ 457,127,516	△ 458,280,300	△ 444,476,040	△ 445,392,710	△ 445,271,133	△ 442,597,390
(配当等相当額)	(442,950,439)	(444,046,485)	(430,645,041)	(431,542,924)	(431,426,707)	(428,835,368)
(売買損益相当額)	(△ 900,077,955)	(△ 902,326,785)	(△ 875,121,081)	(△ 876,935,634)	(△ 876,697,840)	(△ 871,432,758)
(H) 計(E+F+G)	△ 985,103,423	△ 990,741,907	△ 934,825,133	△ 943,324,271	△ 944,814,186	△ 930,240,938
(I) 収益分配金	△ 4,279,056	△ 4,282,917	△ 4,147,159	△ 4,150,362	△ 4,143,788	△ 5,479,510
次期繰越損益金(H+I)	△ 989,382,479	△ 995,024,824	△ 938,972,292	△ 947,474,633	△ 948,957,974	△ 935,720,448
追加信託差損益金	△ 457,127,516	△ 458,280,300	△ 444,476,040	△ 445,392,710	△ 445,271,133	△ 442,597,390
(配当等相当額)	(442,950,439)	(444,046,485)	(430,645,041)	(431,542,924)	(431,426,707)	(428,835,368)
(売買損益相当額)	(△ 900,077,955)	(△ 902,326,785)	(△ 875,121,081)	(△ 876,935,634)	(△ 876,697,840)	(△ 871,432,758)
分配準備積立金	500,566,915	500,854,612	487,427,860	487,704,566	486,978,077	481,909,924
繰越損益金	△ 1,032,821,878	△ 1,037,599,136	△ 981,924,112	△ 989,786,489	△ 990,664,918	△ 975,032,982

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

(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275期計算期間末における費用控除後の配当等収益額（7,220,742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（442,950,439円）および分配準備積立金額（497,625,229円）より分配対象収益額は947,796,410円（10,000口当たり3,322円）であり、うち4,279,056円（10,000口当たり15円）を分配金額としております。
- * 第276期計算期間末における費用控除後の配当等収益額（4,815,497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（444,046,485円）および分配準備積立金額（500,322,032円）より分配対象収益額は949,184,014円（10,000口当たり3,324円）であり、うち4,282,917円（10,000口当たり15円）を分配金額としております。
- * 第277期計算期間末における費用控除後の配当等収益額（7,269,921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（430,645,041円）および分配準備積立金額（484,305,098円）より分配対象収益額は922,220,060円（10,000口当たり3,335円）であり、うち4,147,159円（10,000口当たり15円）を分配金額としております。
- * 第278期計算期間末における費用控除後の配当等収益額（4,615,849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（431,542,924円）および分配準備積立金額（487,239,079円）より分配対象収益額は923,397,852円（10,000口当たり3,337円）であり、うち4,150,362円（10,000口当たり15円）を分配金額としております。
- * 第279期計算期間末における費用控除後の配当等収益額（4,756,989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（431,426,707円）および分配準備積立金額（486,364,876円）より分配対象収益額は922,548,572円（10,000口当たり3,339円）であり、うち4,143,788円（10,000口当たり15円）を分配金額としております。
- * 第280期計算期間末における費用控除後の配当等収益額（5,390,386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（428,835,368円）および分配準備積立金額（481,999,048円）より分配対象収益額は916,224,802円（10,000口当たり3,344円）であり、うち5,479,510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275期	第276期	第277期	第278期	第279期	第280期
1万口当たり分配金（税込み）	15円	15円	15円	15円	15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。