



アライアンス・バーンスタイン・日本プレミア・バリュー株投信

追加型投信／国内／株式

第30期(決算日2024年2月27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／国内／株式	
信託期間	2009年2月24日(当初設定日)から2024年2月27日までです。	
運用方針	アライアンス・バーンスタイン・日本バリュー株マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式に分散投資することにより、長期的な信託財産の成長を目指します。	
主運用対象	アライアンス・バーンスタイン・日本プレミア・バリュー株投信	主としてアライアンス・バーンスタイン・日本バリュー株マザーファンド受益証券に投資します。
	アライアンス・バーンスタイン・日本バリュー株マザーファンド	主としてわが国の株式に投資します。
組入制限	アライアンス・バーンスタイン・日本プレミア・バリュー株投信	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②実質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・日本バリュー株マザーファンド	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①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。 ②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、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。 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「運用方針」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・日本プレミア・バリュー株投信」は、2024年2月27日をもちまして信託期間を満了し、償還いたしました。ここに、信託期間中の運用経過等についてご報告いたします。これまでのみなさまのご愛顧に対し、厚く御礼申し上げます。

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5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産額		
		税金	込	み	騰	落				騰	落
	円 銭	円	円	騰	落	騰	落	率	率	率	
26期(2022年2月28日)	26,395		340		1.6	3,012.57	△ 1.2	%	97.8	—	百万円 298
27期(2022年8月29日)	26,918		390		3.5	3,146.25	4.4	%	96.7	—	308
28期(2023年2月27日)	27,375		350		3.0	3,268.15	3.9	%	98.3	—	298
29期(2023年8月28日)	31,143		380		15.2	3,824.01	17.0	%	97.8	—	307
(償還時) 30期(2024年2月27日)	(償還価額) 34,735.40		—		11.5	4,502.49	17.7	%	—	—	287

(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、「株式組入比率」「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額	標準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
		騰	落	騰	落		
(期首)	円 銭	騰 落 率		騰 落 率		率	率
2023年8月28日	31,143	—		—		97.8	—
8月末	31,598	1.5		1.4		98.6	—
9月末	31,860	2.3		1.9		96.8	—
10月末	30,562	△ 1.9		△ 1.1		98.3	—
11月末	31,794	2.1		4.3		98.3	—
12月末	31,667	1.7		4.0		99.7	—
2024年1月末	33,774	8.4		12.1		99.3	—
(償還時) 2024年2月27日	(償還価額) 34,735.40	11.5		17.7		—	—

(注) 各騰落率は期首比です。

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

(注) 株式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

当ファンドのベンチマークは「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」です。

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

設定来の運用経過

アライアンス・バーンスタイン・日本プレミア・バリュー株投信(以下「当ファンド」ということがあります。)の設定来の運用状況をご報告いたします。

設定来の基準価額等の推移

(2009年2月24日～2024年2月27日)



設 定 日 : 10,000円
 第30期末(償還日) : 34,735円40銭 (既払分配金(税込み) : 4,410円)
 騰 落 率 : 314.9% (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ベンチマークは、設定日(2009年2月24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) ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)です。

○基準価額等の推移

償還価額は34,735円40銭となり、設定日比で上昇しました。ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数、配当込み)との比較では、同インデックスを下回るパフォーマンスとなりました。

○基準価額の主な変動要因

上昇要因

情報技術関連や一般消費財・サービス関連などの保有銘柄の価格上昇

下落要因

公益事業関連の保有銘柄などの価格下落

投資環境

(2009年2月24日～2024年2月27日)

【株式市場】

信託期間における日本株式市場は、上昇しました。

設定日から2012年11月半ばにかけては、横ばいに推移しました。2011年3月11日に発生した東日本大震災と東京電力・福島第一原子力発電所の事故などが重しとなったほか、為替市場での円高の進行も悪材料となりました。2012年11月後半には、産業促進的な政策を掲げた安倍総裁率いる自民党が政権を奪回したことなどから反発し、2013年4月以降は、日本銀行(日銀)による大胆な金融緩和実施を背景に株価は上昇幅を拡大しました。その後は、2020年3月の新型コロナウイルスの感染拡大のほか、2022年のロシアによるウクライナ侵攻、欧米の急速な利上げなどを嫌気して下落する場面があったものの、円安米ドル高の進行や、堅調な企業決算、海外投資家からの資金流入、人工知能(AI)関連銘柄を中心とする情報技術セクターの活況などを追い風に上昇基調が続きました。さらに2023年末にかけては欧米の早期利下げ観測もプラス材料となり、株価は上昇基調を維持して信託期間を終えました。

運用概況

(2009年2月24日～2024年2月27日)

【当ファンド】

当ファンドはアライアンス・バーンスタイン・日本バリュー株マザーファンド(以下「マザーファンド」ということがあります。)受益証券への投資を通じて、わが国の株式を中心に投資し、長期的な信託財産の成長を目指し、信託期間を通じてほぼ全額をマザーファンド受益証券に投資しました。

【マザーファンド】

運用にあたっては、信託期間を通じて、ファンダメンタル分析と定量分析の融合によって中期的な収益性と比較して株価が割安になっている銘柄を厳選するという投資方針を維持しました。

具体的には、計量収益モデルによる絞り込みにより割安な投資機会として抽出された銘柄を中心に、ファンダメンタル・アナリストが徹底したリサーチを行ったうえで、ポートフォリオ・マネジャーとアナリストの議論を通じてリサーチ品質が承認された銘柄のうち、株価と長期的な潜在収益力との関係から見て割安と認められた銘柄を組み入れました。

なお、2024年2月以降は償還に向けて組入株式の売却を進めました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2009年2月24日～2024年2月27日)

ベンチマークとの比較では、信託期間中は、セクター配分、銘柄選択ともにマイナス要因となりました。

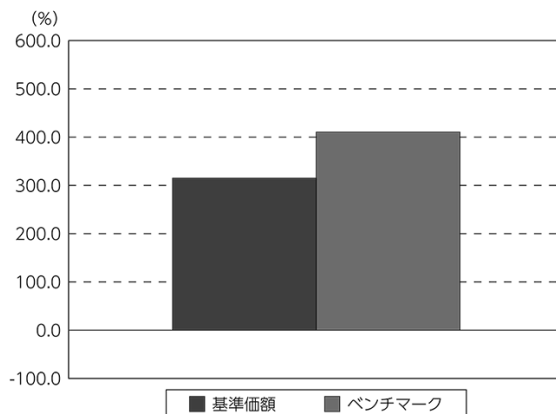
セクター配分では、エネルギー・セクターや素材セクターのオーバーウェイトなどはマイナス要因となりましたが、ヘルスケア・セクターのアンダーウェイトなどはプラス要因となりました。

銘柄選択では、一般消費財・サービス・セクターや資本財・サービス・セクターなどでの選択はマイナス要因となりましたが、情報技術セクターや金融セクターなどでの選択はプラス要因となりました。

個別銘柄では、東京電力、ENEOSホールディングス、SUBARUなどの保有がマイナス要因となりました。一方、SCREENホールディングス、富士通、オリックスなどの保有はプラス要因となりました。

(注) セクターは、MSCI/S&PのGlobal Industry Classification Standard (GICS) の分類で表示しています。

基準価額とベンチマークの対比 (設定日比騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、TOPIX (東証株価指数、配当込み) です。

分配金

(2009年2月24日～2024年2月27日)

信託期間中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、合計4,410円 (1万口当たり、税込み) としました。なお、収益分配に充てなかった利益については、信託財産内に留保し「運用の基本方針」に基づいて運用を行いました。

【当ファンド】

当ファンドは2024年2月27日をもちまして、償還いたしました。長らくのご愛顧に対し、心より厚く御礼申し上げます。

【マザーファンド】

マザーファンドは2024年2月26日をもちまして、繰上げ償還いたしました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年8月29日～2024年2月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 235	% 0.736	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(114)	(0.357)	委託した資金の運用、基準価額の算出等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(114)	(0.357)	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 ）	(7)	(0.021)	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	5	0.016	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
（ 株 式 ）	(5)	(0.016)	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	16	0.050	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ そ の 他 ）	(16)	(0.050)	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、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	256	0.802	
期中の平均基準価額は、31,875円です。			

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

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

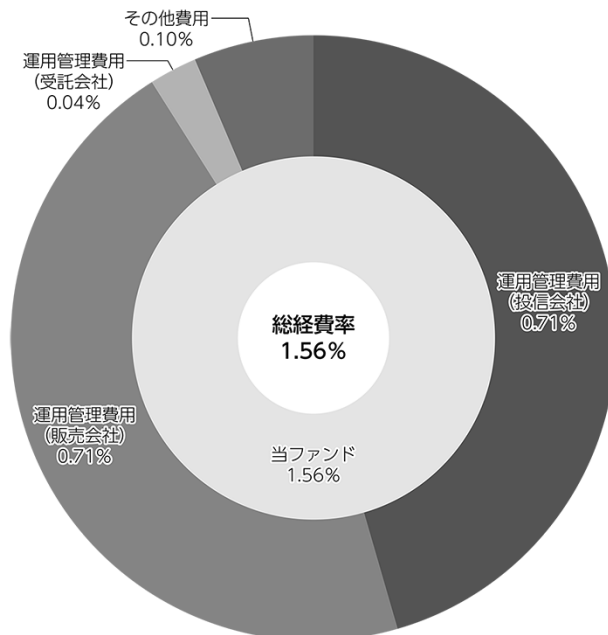
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.56%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) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(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

(2023年8月29日～2024年2月27日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アライアンス・バーンスタイン・日本バリュース株マザーファンド	千口 3,533	千円 15,877	千口 72,185	千円 356,894

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2023年8月29日～2024年2月27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	当 期	
	アライアンス・バーンスタイン・日本バリュース株マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	439,676千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	296,957千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.48	

(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

(2023年8月29日～2024年2月27日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2024年2月27日現在)

2024年2月27日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	
	口 数	
アライアンス・バーンスタイン・日本バリュース株マザーファンド	千口 68,651	

(注) 単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年2月27日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 290,002	% 100.0
投資信託財産総額	290,002	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2024年2月27日現在)

○損益の状況 (2023年8月29日～2024年2月27日)

項 目	償 還 時
(A) 資産	290,002,831 円
コール・ローン等	290,002,831
(B) 負債	2,384,604
未払信託報酬	2,232,253
未払利息	850
その他未払費用	151,501
(C) 純資産総額(A-B)	287,618,227
元本	82,802,617
償還差益金	204,815,610
(D) 受益権総口数	82,802,617口
1万口当たり償還価額(C/D)	34,735円40銭

(注) 期首元本額98,880,666円、期中追加設定元本額5,654,835円、期中一部解約元本額21,732,884円。当期末現在における1口当たり純資産額3,473540円。

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 964 円
支払利息	△ 964
(B) 有価証券売買損益	31,979,433
売買益	34,004,386
売買損	△ 2,024,953
(C) 信託報酬等	△ 2,383,755
(D) 当期損益金(A+B+C)	29,594,714
(E) 前期繰越損益金	63,258,825
(F) 追加信託差損益金	111,962,071
(配当等相当額)	(91,364,788)
(売買損益相当額)	(20,597,283)
償還差益金(D+E+F)	204,815,610

(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。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2009年2月24日			投資信託契約終了時の状況		
	投資信託契約終了日	2024年2月27日			資産総額	290,002,831円	
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	2,384,604円	純資産総額	287,618,227円
受益権口数	5,306,756,820口	82,802,617口	△5,223,954,203口	受益権口数	82,802,617口		
元本額	5,306,756,820円	82,802,617円	△5,223,954,203円	1万口当たり償還金	34,735円40銭		
毎計算期末の状況							
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金			
				金額	分配率		
第10期	1,247,034,780円	2,415,529,668円	19,370円	130円	1.3%		
第11期	1,077,636,742	2,170,802,484	20,144	220	2.2		
第12期	665,714,792	1,602,633,558	24,074	210	2.1		
第13期	583,466,865	1,325,855,953	22,724	250	2.5		
第14期	473,621,240	929,921,170	19,634	0	0.0		
第15期	456,526,947	920,153,471	20,156	270	2.7		
第16期	304,864,292	732,597,981	24,030	220	2.2		
第17期	237,687,450	590,756,027	24,854	340	3.4		
第18期	207,814,692	577,111,509	27,770	270	2.7		
第19期	191,619,204	505,041,934	26,357	0	0.0		
第20期	182,609,827	437,556,261	23,961	0	0.0		
第21期	174,934,817	378,634,619	21,644	0	0.0		
第22期	156,371,343	350,440,351	22,411	330	3.3		
第23期	161,214,830	355,487,795	22,051	0	0.0		
第24期	146,123,858	381,905,807	26,136	280	2.8		
第25期	118,568,797	311,938,984	26,309	360	3.6		
第26期	113,049,704	298,398,279	26,395	340	3.4		
第27期	114,729,800	308,826,590	26,918	390	3.9		
第28期	109,131,261	298,748,574	27,375	350	3.5		
第29期	98,880,666	307,943,252	31,143	380	3.8		

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税込み）	34,735円40銭
----------------	------------



ALLIANCEBERNSTEIN®

償還運用報告書

アライアンス・バーンスタイン・日本バリュー株マザーファンド

第15期(償還日2024年2月26日)

(計算期間：2023年2月28日～2024年2月26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	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。
主要運用対象	主としてわが国の株式に投資します。
組入制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 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		参考指数		株式先物比率	株式組入比率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
	円 銭	%		%	%	%	百万円
11期(2020年2月27日)	28,310	△ 3.7	2,393.04	△ 0.8	96.9	—	349
12期(2021年3月1日)	33,834	19.5	2,973.96	24.3	98.3	—	381
13期(2022年2月28日)	35,617	5.3	3,012.57	1.3	98.1	—	297
14期(2023年2月27日)	38,558	8.3	3,268.15	8.5	98.5	—	298
(償還時) 15期(2024年2月26日)	(償還価額) 50,203.81	30.2	4,494.35	37.5	—	—	289

(注) 株式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		参考指数		株式先物比率	株式組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2023年2月27日	円 銭	%		%	%	%
2月末	38,668	0.3	3,269.12	0.0	97.2	—
3月末	38,891	0.9	3,324.74	1.7	97.0	—
4月末	40,073	3.9	3,414.45	4.5	97.6	—
5月末	41,114	6.6	3,537.93	8.3	97.7	—
6月末	43,933	13.9	3,805.00	16.4	97.3	—
7月末	44,902	16.5	3,861.80	18.2	98.7	—
8月末	45,398	17.7	3,878.51	18.7	98.6	—
9月末	45,833	18.9	3,898.26	19.3	96.6	—
10月末	44,042	14.2	3,781.64	15.7	97.8	—
11月末	45,845	18.9	3,986.65	22.0	98.0	—
12月末	45,716	18.6	3,977.63	21.7	99.2	—
2024年1月末	48,773	26.5	4,288.36	31.2	98.3	—
(償還時) 2024年2月26日	(償還価額) 50,203.81	30.2	4,494.35	37.5	—	—

(注) 各騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

(注) 月末は、各月の最終営業日です。

※参考指数について
当ファンドの参考指数は「TOPIX（東証株価指数、配当込み）」です。

設定来の運用経過

アラライアンス・バーンスタイン・日本バリュース株マザーファンド(以下「当マザーファンド」ということがあります。)の設定来の運用状況をご報告いたします。

設定来の基準価額等の推移

(2009年2月24日～2024年2月26日)

○基準価額等の推移

償還価額は50,203円81銭となり、設定日比で上昇しました。

○基準価額の主な変動要因

上昇要因

・情報技術関連や一般消費財・サービス関連などの保有銘柄の価格上昇

下落要因

・公益事業関連の保有銘柄などの価格下落

設定来の基準価額の推移
2009年2月24日～2024年2月26日



設定来の参考指数の推移
2009年2月24日～2024年2月26日



*参考指数については前ページ「※参考指数について」をご参照ください。

投資環境

(2009年2月24日～2024年2月26日)

【株式市場】

信託期間における日本株式市場は、上昇しました。

設定日から2012年11月半ばにかけては、横ばいに推移しました。2011年3月11日に発生した東日本大震災と東京電力・福島第一原子力発電所の事故などが重しとなったほか、為替市場での円高の進行も悪材料となりました。2012年11月後半には、産業促進的な政策を掲げた安倍総裁率いる自民党が政権を奪回したことなどから反発し、2013年4月以降は、日本銀行(日銀)による大胆な金融緩和実施を背景に株価は上昇幅を拡大しました。その後は、2020年3月の新型コロナウイルスの感染拡大のほか、2022年のロシアによるウクライナ侵攻、欧米の急激な利上げなどを嫌気して下落する場面があったものの、円安米ドル高の進行や、堅調な企業決算、海外投資家からの資金流入、人口知能(AI)関連銘柄を中心とする情報技術セクターの活況などを追い風に上昇基調が続きました。さらに2023年末にかけては欧米の早期利下げ観測もプラス材料となり、株価は上昇基調を維持して信託期間を終えました。

運用概況

(2009年2月24日～2024年2月26日)

運用にあたっては、信託期間を通じて、ファンダメンタル分析と定量分析の融合によって中期的な収益性と比較して株価が割安になっている銘柄を厳選するという投資方針を維持しました。

具体的には、計量収益モデルによる絞り込みにより割安な投資機会として抽出された銘柄を中心に、ファンダメンタル・アナリストが徹底したリサーチを行ったうえで、ポートフォリオ・マネジャーとアナリストの議論を通じてリサーチ品質が承認された銘柄のうち、株価と長期的な潜在収益力との関係から見て割安と認められた銘柄を組み入れました。

なお、2024年2月以降は償還に向けて組入株式の売却を進めました。

当マザーファンドは、同ファンドを投資対象とするベビーファンドが満期償還することに伴い、約款の規定に基づき2024年2月26日をもって繰上げ償還いたしました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年2月28日～2024年2月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 28 (28)	% 0.064 (0.064)	(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)	0.000 (0.000)	(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	28	0.064	
期中の平均基準価額は、43,599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

(2023年2月28日～2024年2月26日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		42	90,613	253	455,952
		(71)	(-)		

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 単位未満は切り捨て。

(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、上段の数字には含まれておりません。

(注) -印は該当なし。

○株式売買比率

(2023年2月28日～2024年2月26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	当 期
(a) 期中の株式売買金額	546,566千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	296,389千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.84

(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

(2023年2月28日～2024年2月26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

(2024年2月26日現在)

2024年2月26日現在、有価証券等の組入れはございません。

国内株式

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
食料品		
アサヒグループホールディングス	0.92	
キリンホールディングス	1.87	
ニチレイ	2.1	
パルプ・紙		
レンゴー	9.28	
化学		
東ソー	4.65	
エア・ウォーター	2.73	
日本ゼオン	5.39	
ポーラ・オルビスホールディングス	2.92	
医薬品		
日本新薬	1.04	
参天製薬	2.97	
石油・石炭製品		
ENEOSホールディングス	18.39	
非鉄金属		
住友金属鉱山	0.66	
住友電気工業	3.72	
機械		
アマダ	3.88	
オプトラン	1.19	
ローツェ	0.28	
グローリー	0.6	
I H I	0.865	
電気機器		
日立製作所	1.255	
沖電気工業	5.68	
ソニーグループ	0.995	
SCREENホールディングス	0.535	
輸送用機器		
豊田自動織機	0.685	
トヨタ自動車	2.63	
本田技研工業	2.08	
スズキ	1.745	
テイ・エス テック	1.9	

銘柄	柄	期首(前期末)	
		株数	
			千株
陸運業			
東日本旅客鉄道		0.74	
山九		0.37	
情報・通信業			
NECネットエスアイ		3.72	
大塚商会		1.365	
B I P R O G Y		2.195	
日本電信電話		3.77	
KADOKAWA		1.31	
コナミグループ		1.25	
卸売業			
三菱商事		1.55	
小売業			
ユービーシー・マート		0.51	
アスクル		3.63	
FOOD & LIFE COMPANIES		1	
しまむら		0.125	
サンドラッグ		1.1	
銀行業			
三菱UFJフィナンシャル・グループ		3.88	
りそなホールディングス		11.75	
三井住友フィナンシャルグループ		2.21	
その他金融業			
オリックス		2.36	
不動産業			
大東建託		0.27	
パーク24		3.39	
三井不動産		3.185	
サービス業			
UTグループ		2.32	
カカコム		1.4	
ディップ		1.32	
アウトソーシング		3.21	
計	株数	138	
銘柄	柄数	52	

○投資信託財産の構成

(2024年2月26日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 289,345	% 100.0
投資信託財産総額	289,345	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2024年2月26日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	289,345,801
コール・ローン等	289,345,801
(B) 負債	10,848
未払解約金	10,000
未払利息	848
(C) 純資産総額(A-B)	289,334,953
元本	57,632,069
償還差益金	231,702,884
(D) 受益権総口数	57,632,069口
1万口当たり償還価額(C/D)	50,203円81銭

(注) 期首元本額77,325,882円、期中追加設定元本額5,524,184円、期中一部解約元本額25,217,997円。当期末現在における1口当たり純資産額5,020381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>

アラライアンス・バーンスタイン・日本プレミア・バリュース株投信

57,632,069円

○損益の状況 (2023年2月28日～2024年2月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	7,454,009
受取配当金	7,465,762
受取利息	2
その他収益金	2,541
支払利息	△ 14,296
(B) 有価証券売買損益	71,520,151
売買益	81,654,395
売買損	△ 10,134,244
(C) 保管費用等	△ 291
(D) 当期損益金(A+B+C)	78,973,869
(E) 前期繰越損益金	220,826,346
(F) 追加信託差損益金	18,414,672
(G) 解約差損益金	△ 86,512,003
償還差益金(D+E+F+G)	231,702,884

(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) 損益の状況の中で(G)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。