

【表紙】

【提出書類】 臨時報告書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 2024年4月23日提出

【ファンド名】 アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・ファンド

【発行者名】 アライアンス・バーンスタイン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 阪口 和子

【本店の所在の場所】 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

【事務連絡者氏名】 岡本 元樹

【連絡場所】 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

【電話番号】 03 - 5962 - 9165

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

【臨時報告書の提出理由】

「アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・ファンド」（以下「当ファンド」といいます。）について、運用の基本方針等の変更にかかる信託約款等の変更を行うことが決定いたしましたので、金融商品取引法第24条の5第4項及び特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令第29条第2項第3号の規定に基づき、本臨時報告書を提出するものです。

【報告内容】

イ 変更の内容についての概要

当ファンドが投資するマザーファンドの入替え

< 追加 >

・アライアンス・バーンスタイン・世界債券マザーファンド

< 削除 >

・アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・マザーファンド

当ファンドの信託約款に定める投資制限等の変更

マザーファンドの入替えに伴い、信託約款におけるデリバティブ取引等の利用目的について、運用の実態に即した内容に変更いたします。

当ファンドの信託報酬率の引き下げ

	信託報酬率（年率）			
	合計	委託会社	販売会社	受託会社
変更前	1.287%（税抜 1.17%）	税抜 0.54%	税抜 0.58%	税抜 0.05%
変更後	1.067%（税抜 0.97%）	税抜 0.44%	税抜 0.48%	税抜 0.05%

当ファンドのベンチマークの変更

変更前	FTSE世界国債インデックス（円ベース）
変更後	FTSE世界国債インデックス（含む日本、除く中国、円ベース）

< 投資信託約款に係る新旧対照表 >

以下の新旧対照表の下線____の部分が変更箇所です。

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・ファンド

新	旧
---	---

運用の基本方針

2. 運用方法

(1) 投資対象

アライアンス・バーンスタイン・世界債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

(2) 運用態度

主としてアライアンス・バーンスタイン・世界債券マザーファンド受益証券に投資します。

(削除)

— 信託財産の効率的運用ならびに運用の安定化をはかるため、信託財産の一部解約または再投資に係る収益分配金の支払資金の不足額が生じた場合には、資金の借入れを行うことができます。

(3) 投資制限

～ (略)

— デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

— 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

— 委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

— 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超え

運用の基本方針

2. 運用方法

(1) 投資対象

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

(2) 運用態度

主としてアライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・マザーファンド受益証券に投資します。

— 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避または軽減するため、有価証券先物取引等を行うことができます。

— 信託財産の効率的運用ならびに運用の安定化をはかるため、信託財産の一部解約または再投資に係る収益分配金の支払資金の不足額が生じた場合には、資金の借入れを行うことができます。

(3) 投資制限

～ (同左)

(新設)

(新設)

— 委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

— 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を

ることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。	超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
追加型証券投資信託 アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ ボンド・ファンド 信 託 約 款 第17条（運用の指図範囲等） 委託者（第18条に規定する委託者から運用の指図に関する権限の委託を受けた者を含みます。以下関連する条項において同じ。）は、信託金を、主としてアライアンス・バーンスタイン株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された「アライアンス・バーンスタイン・<u>世界債券マザーファンド</u>」（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。 （略）	追加型証券投資信託 アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ ボンド・ファンド 信 託 約 款 第17条（運用の指図範囲等） 委託者（第18条に規定する委託者から運用の指図に関する権限の委託を受けた者を含みます。以下関連する条項において同じ。）は、信託金を、主としてアライアンス・バーンスタイン株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された「アライアンス・バーンスタイン・<u>グローバル・ボンド・マザーファンド</u>」（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。 （同左）

第24条（先物取引等の運用指図・目的・範囲）

委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、および投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権付取引は、オプション取引に含めるものとします。（以下、同じ。）

（略）

委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、および投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

（略）

委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、および投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

（略）

第24条（先物取引等の運用指図・目的・範囲）

委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権付取引は、オプション取引に含めるものとします。（以下、同じ。）

（同左）

委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

（同左）

委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

（同左）

第25条（スワップ取引の運用指図・目的・範囲） 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下、「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。 （略）	第25条（スワップ取引の運用指図・目的・範囲） 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下、「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。 （同左）
第26条（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲） 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。 （略）	第26条（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲） 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。 （同左）
第29条（外国為替予約の指図） 委託者は、信託財産の為替変動リスクを回避するため、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額を限度として、外国為替の売買の予約を指図することができます。	第29条（外国為替予約の指図） 委託者は、外貨建資産の為替ヘッジのため、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額を限度として、外国為替の売買の予約を指図することができます。
第41条（信託報酬の額および支弁の方法） 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第38条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の97の率を乗じて得た金額とします。なお、委託者と受託者との間の配分は、別に定めます。 （略）	第41条（信託報酬の額および支弁の方法） 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第38条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の117の率を乗じて得た金額とします。なお、委託者と受託者との間の配分は、別に定めます。 （同左）

□ 当該変更の年月日
2024年 5 月20日

以上