

2018年10月19日

お客様各位

中銀アセットマネジメント株式会社

弊社ファンド・オブ・ファンズの組入ファンドの保有明細開示について

拝啓 時下ますますご清栄のこととお喜び申し上げます。

弊社が設定、運用する以下のファンド・オブ・ファンズについて、組入ファンドの保有明細開示を、下記の通りご報告申し上げます。

敬具

記

一般社団法人投資信託協会規則「投資信託等の運用に関する規則」第22条第4項に基づき作成しております。

1. 対象ファンド・オブ・ファンズ

- (1) 先進国資産配分コントロールファンド<安定型>
- (2) 先進国資産配分コントロールファンド<成長型>

2. 開示対象の組入ファンド

- (1) MUAM インデックスファンド TOPIXi (適格機関投資家限定)
- (2) MUAM 外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)
- (3) MUAM 日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)
- (4) 国内物価連動国債インデックスファンド (適格機関投資家限定)
- (5) MUAM 外国債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)
- (6) MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド (適格機関投資家転売制限付)
- (7) マネープールファンド (FOFs 用) (適格機関投資家限定)

3. 開示基準日

2018年9月末日基準

4. 保有銘柄明細(組入上位銘柄)

(1) MUAM インデックスファンド TOPIXi (適格機関投資家限定)

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.23%
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.91%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.83%
4	ソニー	電気機器	1.75%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.36%
6	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.27%
7	キーエンス	電気機器	1.22%
8	ホンダ	輸送用機器	1.16%
9	リクルートホールディングス	サービス業	1.05%
10	KDDI	情報・通信業	1.02%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(2) MUAM 外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)

	銘柄	国名	業種	比率
1	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェア・機器	2.77%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	2.09%
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	2.08%
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.01%
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	0.98%
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.94%
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノ・ライフ	0.93%
8	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	0.91%
9	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.90%
10	BANK OF AMERICA CO	アメリカ	銀行	0.72%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(3) MUAM 日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)

	銘柄	クーポン	償還日	比率
1	第312回利付国債(10年)	1.200%	2020/12/20	1.31%
2	第329回利付国債(10年)	0.800%	2023/06/20	1.13%
3	第134回利付国債(5年)	0.100%	2022/12/20	1.12%
4	第333回利付国債(10年)	0.600%	2024/03/20	1.09%
5	第135回利付国債(5年)	0.100%	2023/03/20	1.07%
6	第350回利付国債(10年)	0.100%	2028/03/20	1.01%
7	第332回利付国債(10年)	0.600%	2023/12/20	1.00%
8	第133回利付国債(5年)	0.100%	2022/09/20	0.92%
9	第346回利付国債(10年)	0.100%	2027/03/20	0.90%
10	第339回利付国債(10年)	0.400%	2025/06/20	0.89%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(4) 国内物価連動国債インデックスファンド(適格機関投資家限定)

	銘柄	クーポン	償還日	比率
1	第20回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2025/03/10	23.36%
2	第22回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2027/03/10	19.34%
3	第21回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2026/03/10	18.94%
4	第19回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2024/09/10	11.99%
5	第18回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2024/03/10	11.42%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(5) MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)

	銘柄	種別	クーポン	償還日	国名	比率
1	2.75 T-NOTE 210815	国債	2.750%	2021/08/15	アメリカ	1.06%
2	1.625 T-NOTE 220831	国債	1.625%	2022/08/31	アメリカ	0.46%
3	2 T-NOTE 261115	国債	2.000%	2026/11/15	アメリカ	0.45%
4	1.75 T-NOTE 220630	国債	1.750%	2022/06/30	アメリカ	0.44%
5	2.125 T-NOTE 250515	国債	2.125%	2025/05/15	アメリカ	0.44%
6	2.25 T-NOTE 241115	国債	2.250%	2024/11/15	アメリカ	0.42%
7	2.25 T-NOTE 270215	国債	2.250%	2027/02/15	アメリカ	0.42%
8	2 T-NOTE 250815	国債	2.000%	2025/08/15	アメリカ	0.41%
9	2.75 T-NOTE 280215	国債	2.750%	2028/02/15	アメリカ	0.40%
10	4.25 O.A.T 231025	国債	4.250%	2023/10/25	フランス	0.40%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(6) MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)

	銘柄	種別	クーポン	償還日	国名	比率
1	1.375 T-NOTE 200115	国債	1.375%	2020/01/15	アメリカ	1.29%
2	6.125 T-BOND 271115	国債	6.125%	2027/11/15	アメリカ	1.14%
3	2 T-NOTE 230215	国債	2.000%	2023/02/15	アメリカ	0.91%
4	2.625 T-NOTE 210515	国債	2.625%	2021/05/15	アメリカ	0.82%
5	1.125 T-NOTE 210630	国債	1.125%	2021/06/30	アメリカ	0.81%
6	1.375 T-NOTE 200930	国債	1.375%	2020/09/30	アメリカ	0.79%
7	2.25 T-NOTE 210215	国債	2.250%	2021/02/15	アメリカ	0.79%
8	2 T-NOTE 250215	国債	2.000%	2025/02/15	アメリカ	0.75%
9	2.375 T-NOTE 210315	国債	2.375%	2021/03/15	アメリカ	0.73%
10	1.625 T-NOTE 260215	国債	1.625%	2026/02/15	アメリカ	0.67%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(7) マネープールファンド(FOFs 用)(適格機関投資家限定)

※基準日現在、マザーファンドにおける債券の組入れはありません。

以上