

2017年4月21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

2017年3月末日基準

#### 4. 保有銘柄明細

##### (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	3.15%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.25%
3	日本電信電話	情報・通信業	1.62%
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.50%
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.37%
6	ホンダ	輸送用機器	1.30%
7	KDDI	情報・通信業	1.23%
8	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.17%
9	ソニー	電気機器	1.14%
10	ファナック	電気機器	0.99%

※マザーファンドにおける組入れ状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

##### (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	2.27%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.43%
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	1.04%
4	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.02%
5	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノ・ライフ	1.00%
6	FACEBOOK INC-A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.98%
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	0.94%
8	WELLS FARGO & CO	アメリカ	銀行	0.79%
9	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	資本財	0.78%
10	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.76%

※マザーファンドにおける組入れ状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

##### (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122回利付国債(5年)	0.100%	2019/12/20	1.26%
2	第130回利付国債(5年)	0.100%	2021/12/20	1.20%
3	第124回利付国債(5年)	0.100%	2020/06/20	1.10%
4	第329回利付国債(10年)	0.800%	2023/06/20	1.08%
5	第333回利付国債(10年)	0.600%	2024/03/20	1.00%
6	第128回利付国債(5年)	0.100%	2021/06/20	0.99%
7	第312回利付国債(10年)	1.200%	2020/12/20	0.94%
8	第344回利付国債(10年)	0.100%	2026/09/20	0.93%
9	第339回利付国債(10年)	0.400%	2025/06/20	0.93%
10	第338回利付国債(10年)	0.400%	2025/03/20	0.93%

※マザーファンドにおける組入れ状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

## (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	33.20%
2	第21回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2026/03/10	26.99%
3	第19回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2024/09/10	16.98%
4	第18回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2024/03/10	13.06%
5	第17回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2023/09/10	9.99%
6	(以下、余白)			
7				
8				
9				
10				

※純資産総額に対する比率で表示しています。

## (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	2.125 T-NOTE 250515	国債	2.125%	2025/05/15	アメリカ	0.71%
2	2.125 T-NOTE 210815	国債	2.125%	2021/08/15	アメリカ	0.44%
3	1.5 T-NOTE 260815	国債	1.500%	2026/08/15	アメリカ	0.44%
4	2.75 T-NOTE 231115	国債	2.750%	2023/11/15	アメリカ	0.43%
5	2.5 T-NOTE 240515	国債	2.500%	2024/05/15	アメリカ	0.41%
6	2.25 T-NOTE 251115	国債	2.250%	2025/11/15	アメリカ	0.40%
7	1.375 T-NOTE 201031	国債	1.375%	2020/10/31	アメリカ	0.38%
8	2.25 T-NOTE 241115	国債	2.250%	2024/11/15	アメリカ	0.38%
9	2 T-NOTE 250815	国債	2.000%	2025/08/15	アメリカ	0.38%
10	2 T-NOTE 250215	国債	2.000%	2025/02/15	アメリカ	0.37%

※マザーファンドにおける組入れ状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

## (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	2 T-NOTE 250215	国債	2.000%	2025/02/15	アメリカ	1.16%
2	1.375 T-NOTE 200115	国債	1.375%	2020/01/15	アメリカ	1.03%
3	0.75 T-NOTE 180930	国債	0.750%	2018/09/30	アメリカ	0.98%
4	0.875 T-NOTE 190415	国債	0.875%	2019/04/15	アメリカ	0.98%
5	1.375 T-NOTE 200930	国債	1.375%	2020/09/30	アメリカ	0.93%
6	2.125 T-NOTE 210815	国債	2.125%	2021/08/15	アメリカ	0.85%
7	1.375 T-NOTE 200331	国債	1.375%	2020/03/31	アメリカ	0.83%
8	4.75 T-BOND 410215	国債	4.750%	2041/02/15	アメリカ	0.81%
9	0.75 T-NOTE 180430	国債	0.750%	2018/04/30	アメリカ	0.78%
10	1.75 T-NOTE 211130	国債	1.750%	2021/11/30	アメリカ	0.75%

※マザーファンドにおける組入れ状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

(7) マネープールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)

	銘柄	種別	クーポン	償還日	比率
1	第113回オリックス	事業債	2.190%	2017/04/18	6.28%
2	(以下、余白)				
3					
4					
5					
6					
7					
8					
9					
10					

※マザーファンドにおける組入れ状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

以上