

2016年10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、運用するファンド・オブ・ファンズ(以下)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

「投資信託等の運用に関する規則」(投資信託協会規則)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

2016年9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	3.49%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.90%
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.73%
4	日本電信電話	情報・通信業	1.67%
5	KDDI	情報・通信業	1.44%
6	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.27%
7	ホンダ	輸送用機器	1.23%
8	JT	食料品	1.21%
9	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.13%
10	ソニー	電気機器	1.10%

※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。

(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	1.98%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.38%
3	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.15%
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	1.07%
5	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノ・ライフ	1.04%
6	FACEBOOK INC-A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.95%
7	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	資本財	0.87%
8	NESTLE SA-REG	スイス	食品・飲料・タバコ	0.82%
9	AT&T INC	アメリカ	電気通信サービス	0.81%
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	0.77%

※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113回利付国債(5年)	0.300%	2018/06/20	1.12%
2	第339回利付国債(10年)	0.400%	2025/06/20	1.08%
3	第340回利付国債(10年)	0.400%	2025/09/20	1.06%
4	第128回利付国債(5年)	0.100%	2021/06/20	1.05%
5	第124回利付国債(5年)	0.100%	2020/06/20	1.05%
6	第342回利付国債(10年)	0.100%	2026/03/20	1.04%
7	第341回利付国債(10年)	0.300%	2025/12/20	1.02%
8	第329回利付国債(10年)	0.800%	2023/06/20	1.02%
9	第127回利付国債(5年)	0.100%	2021/03/20	1.01%
10	第343回利付国債(10年)	0.100%	2026/06/20	1.01%

※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	39.42%
2	第19回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2024/09/10	17.89%
3	第18回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2024/03/10	15.86%
4	第21回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2026/03/10	15.63%
5	第17回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2023/09/10	10.47%
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	2.5 T-NOTE 240515	国債	2.500%	2024/05/15	アメリカ	0.45%
2	2 T-NOTE 250815	国債	2.000%	2025/08/15	アメリカ	0.45%
3	2 T-NOTE 250215	国債	2.000%	2025/02/15	アメリカ	0.43%
4	0.625 T-NOTE 170831	国債	0.625%	2017/08/31	アメリカ	0.43%
5	2.25 T-NOTE 251115	国債	2.250%	2025/11/15	アメリカ	0.43%
6	2.25 T-NOTE 241115	国債	2.250%	2024/11/15	アメリカ	0.43%
7	2.125 T-NOTE 250515	国債	2.125%	2025/05/15	アメリカ	0.42%
8	2.375 T-NOTE 240815	国債	2.375%	2024/08/15	アメリカ	0.42%
9	0.75 T-NOTE 171031	国債	0.750%	2017/10/31	アメリカ	0.40%
10	4.25 O.A.T 231025	国債	4.250%	2023/10/25	フランス	0.39%

※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	0.74%
2	1 T-NOTE 180315	国債	1.000%	2018/03/15	アメリカ	0.72%
3	3 T-BOND 420515	国債	3.000%	2042/05/15	アメリカ	0.68%
4	0.75 T-NOTE 171231	国債	0.750%	2017/12/31	アメリカ	0.63%
5	3.125 T-BOND 420215	国債	3.125%	2042/02/15	アメリカ	0.62%
6	1.25 T-NOTE 200229	国債	1.250%	2020/02/29	アメリカ	0.61%
7	1.875 T-NOTE 220531	国債	1.875%	2022/05/31	アメリカ	0.58%
8	1.625 T-NOTE 260215	国債	1.625%	2026/02/15	アメリカ	0.58%
9	0.75 T-NOTE 180131	国債	0.750%	2018/01/31	アメリカ	0.55%
10	3.5 O.A.T 260425	国債	3.500%	2026/04/25	フランス	0.48%

※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459回東北電力	事業債	0.869%	2017/02/24	3.16%
2	第3回コニカミノルタホールディングス	事業債	0.610%	2016/12/02	3.16%
3	第282回四国電力	事業債	0.350%	2016/12/22	3.15%
4	第300回北陸電力	事業債	0.500%	2016/11/30	2.81%
5	第113回オリックス	事業債	2.190%	2017/04/18	1.61%
6	第156回オリックス	事業債	1.140%	2017/01/27	1.58%
7	第3回興銀リース	事業債	0.267%	2016/12/02	1.58%
8	(以下、余白)				
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