

2017年10月20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	3.22%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.14%
3	日本電信電話	情報・通信業	1.61%
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.60%
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.35%
6	ホンダ	輸送用機器	1.18%
7	ソニー	電気機器	1.17%
8	KDDI	情報・通信業	1.13%
9	キーエンス	電気機器	1.07%
10	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.04%

※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	2.19%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.49%
3	FACEBOOK INC-A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.09%
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	0.96%
6	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	0.96%
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	0.93%
8	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.81%
9	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.79%
10	NESTLE SA-REG	スイス	食品・飲料・タバコ	0.71%

※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124回利付国債(5年)	0.100%	2020/06/20	1.17%
2	第333回利付国債(10年)	0.600%	2024/03/20	1.03%
3	第339回利付国債(10年)	0.400%	2025/06/20	1.00%
4	第338回利付国債(10年)	0.400%	2025/03/20	1.00%
5	第130回利付国債(5年)	0.100%	2021/12/20	0.99%
6	第125回利付国債(5年)	0.100%	2020/09/20	0.95%
7	第325回利付国債(10年)	0.800%	2022/09/20	0.95%
8	第342回利付国債(10年)	0.100%	2026/03/20	0.94%
9	第306回利付国債(10年)	1.400%	2020/03/20	0.90%
10	第122回利付国債(5年)	0.100%	2019/12/20	0.90%

※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	29.24%
2	第21回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2026/03/10	23.55%
3	第18回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2024/03/10	19.56%
4	第19回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2024/09/10	14.93%
5	第22回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2027/03/10	12.06%

※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 T-NOTE 261115	国債	2.000%	2026/11/15	アメリカ	0.58%
2	2.125 T-NOTE 211231	国債	2.125%	2021/12/31	アメリカ	0.55%
3	2.75 T-NOTE 240215	国債	2.750%	2024/02/15	アメリカ	0.55%
4	2.125 T-NOTE 250515	国債	2.125%	2025/05/15	アメリカ	0.51%
5	0.75 T-NOTE 181031	国債	0.750%	2018/10/31	アメリカ	0.51%
6	2.25 T-NOTE 270215	国債	2.250%	2027/02/15	アメリカ	0.50%
7	3 T-BOND 441115	国債	3.000%	2044/11/15	アメリカ	0.44%
8	3.25 O.A.T 211025	国債	3.250%	2021/10/25	フランス	0.43%
9	1.5 T-NOTE 260815	国債	1.500%	2026/08/15	アメリカ	0.42%
10	2.25 T-NOTE 241115	国債	2.250%	2024/11/15	アメリカ	0.41%

※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	2.125 T-NOTE 210815	国債	2.125%	2021/08/15	アメリカ	1.13%
2	1.625 T-NOTE 190731	国債	1.625%	2019/07/31	アメリカ	1.09%
3	2.25 T-NOTE 251115	国債	2.250%	2025/11/15	アメリカ	1.06%
4	1.125 T-NOTE 210630	国債	1.125%	2021/06/30	アメリカ	0.96%
5	1.375 T-NOTE 200930	国債	1.375%	2020/09/30	アメリカ	0.91%
6	2.5 T-NOTE 230815	国債	2.500%	2023/08/15	アメリカ	0.82%
7	1.75 T-NOTE 220228	国債	1.750%	2022/02/28	アメリカ	0.82%
8	1.625 T-NOTE 230430	国債	1.625%	2023/04/30	アメリカ	0.76%
9	1.375 T-NOTE 200115	国債	1.375%	2020/01/15	アメリカ	0.71%
10	2.375 T-NOTE 240815	国債	2.375%	2024/08/15	アメリカ	0.68%

※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