

2020年4月21日

お客さま各位

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、運用しております以下のファンド・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> 愛称:コア安定
- (2) 先進国資産配分コントロールファンド<成長型> 愛称:コア成長

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

2020年3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	3.4%
2	ソニー	電気機器	1.9%
3	日本電信電話	情報・通信業	1.6%
4	キーエンス	電気機器	1.5%
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.4%
6	武田薬品工業	医薬品	1.3%
7	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.3%
8	任天堂	その他製品	1.2%
9	NTTドコモ	情報・通信業	1.2%
10	KDDI	情報・通信業	1.1%

※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	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	3.4%
2	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェア・機器	3.3%
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	2.4%
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	1.5%
5	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	メディア・娯楽	1.2%
6	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノ・ライフ	1.0%
7	NESTLE SA-REG	スイス	食品・飲料・タバコ	0.9%
8	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	0.9%
9	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	0.8%
10	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.8%

※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408回利付国債(2年)	0.100%	2022/01/01	1.6%
2	第342回利付国債(10年)	0.100%	2026/03/20	1.4%
3	第134回利付国債(5年)	0.100%	2022/12/20	1.4%
4	第339回利付国債(10年)	0.400%	2025/06/20	1.2%
5	第333回利付国債(10年)	0.600%	2024/03/20	1.2%
6	第329回利付国債(10年)	0.800%	2023/06/20	1.0%
7	第137回利付国債(5年)	0.100%	2023/09/20	1.0%
8	第348回利付国債(10年)	0.100%	2027/09/20	1.0%
9	第354回利付国債(10年)	0.100%	2029/03/20	1.0%
10	第344回利付国債(10年)	0.100%	2026/09/20	1.0%

※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	18.2%
2	第22回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2027/03/10	15.2%
3	第21回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2026/03/10	15.0%
4	第23回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2028/03/10	14.9%
5	第24回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2029/03/10	14.2%

※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	3.125 T-NOTE 281115	国債	3.125%	2028/11/15	アメリカ	0.9%
2	2.75 T-NOTE 210815	国債	2.750%	2021/08/15	アメリカ	0.9%
3	2.75 T-NOTE 231115	国債	2.750%	2023/11/15	アメリカ	0.6%
4	1.375 T-NOTE 250131	国債	1.375%	2025/01/31	アメリカ	0.6%
5	1.75 O.A.T 230525	国債	1.750%	2023/05/25	フランス	0.6%
6	2.25 T-NOTE 241115	国債	2.250%	2024/11/15	アメリカ	0.6%
7	1.625 T-NOTE 220831	国債	1.625%	2022/08/31	アメリカ	0.6%
8	2.25 T-NOTE 240131	国債	2.250%	2024/01/31	アメリカ	0.6%
9	2.25 T-NOTE 270815	国債	2.250%	2027/08/15	アメリカ	0.6%
10	2.75 T-NOTE 280215	国債	2.750%	2028/02/15	アメリカ	0.5%

※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	3.125 T-NOTE 281115	国債	3.125%	2028/11/15	アメリカ	0.8%
2	1.875 T-NOTE 220228	国債	1.875%	2022/02/28	アメリカ	0.8%
3	1.625 T-NOTE 221115	国債	1.625%	2022/11/15	アメリカ	0.8%
4	1.875 T-NOTE 220430	国債	1.875%	2022/04/30	アメリカ	0.8%
5	1.5 T-NOTE 230115	国債	1.500%	2023/01/15	アメリカ	0.7%
6	2.375 T-NOTE 270515	国債	2.375%	2027/05/15	アメリカ	0.7%
7	2.375 T-NOTE 240229	国債	2.375%	2024/02/29	アメリカ	0.6%
8	6.125 T-BOND 271115	国債	6.125%	2027/11/15	アメリカ	0.6%
9	2.875 T-NOTE 250430	国債	2.875%	2025/04/30	アメリカ	0.6%
10	2.875 T-NOTE 280815	国債	2.875%	2028/08/15	アメリカ	0.6%

※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