

2020年10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	3.2%
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.1%
3	ソニー	電気機器	2.1%
4	キーエンス	電気機器	1.9%
5	任天堂	その他製品	1.5%
6	武田薬品工業	医薬品	1.3%
7	リクルートホールディングス	サービス業	1.2%
8	日本電信電話	情報・通信業	1.2%
9	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.2%
10	第一三共	医薬品	1.2%

※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	4.6%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	3.5%
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	3.1%
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	メディア・娯楽	1.5%
5	ALPHABET INC-CL 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	0.9%
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	0.8%
8	NESTLE SA-REG	スイス	食品・飲料・タバコ	0.8%
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134回利付国債(5年)	0.100%	2022/12/20	1.4%
2	第144回利付国債(5年)	0.100%	2025/06/20	1.3%
3	第359回利付国債(10年)	0.100%	2030/06/20	1.3%
4	第333回利付国債(10年)	0.600%	2024/03/20	1.1%
5	第329回利付国債(10年)	0.800%	2023/06/20	1.0%
6	第138回利付国債(5年)	0.100%	2023/12/20	1.0%
7	第356回利付国債(10年)	0.100%	2029/09/20	1.0%
8	第334回利付国債(10年)	0.600%	2024/06/20	0.9%
9	第351回利付国債(10年)	0.100%	2028/06/20	0.9%
10	第355回利付国債(10年)	0.100%	2029/06/20	0.9%

※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	17.8%
2	第22回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2027/03/10	14.9%
3	第21回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2026/03/10	14.3%
4	第23回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2028/03/10	14.2%
5	第24回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2029/03/10	13.5%

※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	0.125 T-NOTE 230515	国債	0.125%	2023/05/15	アメリカ	0.8%
2	3.125 T-NOTE 281115	国債	3.125%	2028/11/15	アメリカ	0.7%
3	5.9 SPAIN GOVT 260730	国債	5.900%	2026/07/30	スペイン	0.6%
4	2.75 T-NOTE 231115	国債	2.750%	2023/11/15	アメリカ	0.6%
5	2.25 T-NOTE 241115	国債	2.250%	2024/11/15	アメリカ	0.5%
6	1.625 T-NOTE 220831	国債	1.625%	2022/08/31	アメリカ	0.5%
7	2.25 T-NOTE 240131	国債	2.250%	2024/01/31	アメリカ	0.5%
8	2.25 T-NOTE 251115	国債	2.250%	2025/11/15	アメリカ	0.5%
9	0.25 BUND 290215	国債	0.250%	2029/02/15	ドイツ	0.5%
10	2 T-NOTE 250815	国債	2.000%	2025/08/15	アメリカ	0.4%

※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	2.75 T-NOTE 280215	国債	2.750%	2028/02/15	アメリカ	0.6%
2	2 T-NOTE 250815	国債	2.000%	2025/08/15	アメリカ	0.6%
3	2.125 T-NOTE 250515	国債	2.125%	2025/05/15	アメリカ	0.6%
4	3.125 T-NOTE 281115	国債	3.125%	2028/11/15	アメリカ	0.6%
5	1.625 T-NOTE 221115	国債	1.625%	2022/11/15	アメリカ	0.5%
6	1.875 T-NOTE 220430	国債	1.875%	2022/04/30	アメリカ	0.5%
7	2.375 T-NOTE 270515	国債	2.375%	2027/05/15	アメリカ	0.5%
8	2 T-NOTE 250215	国債	2.000%	2025/02/15	アメリカ	0.5%
9	2.875 T-NOTE 280515	国債	2.875%	2028/05/15	アメリカ	0.5%
10	2.25 T-NOTE 270815	国債	2.250%	2027/08/15	アメリカ	0.5%

※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