

2021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) MUKAM 外国株式インデックスファンド2(適格機関投資家限定)
- (4) MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)
- (5) MUKAM 日本債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)
- (6) 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)
- (7) MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)
- (8) MUKAM 外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)
- (9) 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)
- (10) MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)
- (11) 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

2021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	2.9%
2	ソニー	電気機器	2.4%
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.4%
4	キーエンス	電気機器	1.6%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.3%
6	リクルートホールディングス	サービス業	1.2%
7	任天堂	その他製品	1.2%
8	信越化学工業	化学	1.1%
9	武田薬品工業	医薬品	1.1%
10	日本電信電話	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)

※基準日現在、対象ファンド・オブ・ファンズにおいて組入れはありません。

(3) MUKAM 外国株式インデックスファンド 2(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	4.0%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	3.3%
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	2.6%
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	1.6%
5	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	メディア・娯楽	1.4%
6	TESLA INC	アメリカ	自動車・自動車部品	0.9%
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	0.9%
8	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノ・ライフ	0.9%
9	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	0.8%
10	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.7%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(4) MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)

※基準日現在、対象ファンド・オブ・ファンズにおいて組入れはありません。

(5) MUKAM 日本債券インデックスファンド 2 (適格機関投資家限定)

	銘柄	クーポン	償還日	比率
1	第144回利付国債(5年)	0.100%	2025/06/20	1.3%
2	第359回利付国債(10年)	0.100%	2030/06/20	1.3%
3	第134回利付国債(5年)	0.100%	2022/12/20	1.2%
4	第138回利付国債(5年)	0.100%	2023/12/20	1.2%
5	第146回利付国債(5年)	0.100%	2025/12/20	1.1%
6	第348回利付国債(10年)	0.100%	2027/09/20	1.1%
7	第333回利付国債(10年)	0.600%	2024/03/20	1.1%
8	第329回利付国債(10年)	0.800%	2023/06/20	1.0%
9	第346回利付国債(10年)	0.100%	2027/03/20	1.0%
10	第360回利付国債(10年)	0.100%	2030/09/20	1.0%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(6) 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	17.1%
2	第21回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2026/03/10	14.1%
3	第22回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2027/03/10	14.0%
4	第23回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2028/03/10	14.0%
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。

(7) MUAM 外国債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)

※基準日現在、対象ファンド・オブ・ファンズにおいて組入れはありません。

(8) MUKAM 外国債券インデックスファンド 2 (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	0.6%
2	0.75 T-NOTE 280131	国債	0.750%	2028/01/31	アメリカ	0.6%
3	5.5 O.A.T 290425	国債	5.500%	2029/04/25	フランス	0.5%
4	0.125 T-NOTE 240115	国債	0.125%	2024/01/15	アメリカ	0.5%
5	2.75 T-NOTE 231115	国債	2.750%	2023/11/15	アメリカ	0.5%
6	0.125 T-NOTE 231215	国債	0.125%	2023/12/15	アメリカ	0.5%
7	2.875 T-NOTE 280815	国債	2.875%	2028/08/15	アメリカ	0.5%
8	2.75 T-NOTE 280215	国債	2.750%	2028/02/15	アメリカ	0.5%
9	5.9 SPAIN GOVT 260730	国債	5.900%	2026/07/30	スペイン	0.5%
10	1.625 T-NOTE 220831	国債	1.625%	2022/08/31	アメリカ	0.4%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(9) 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)

※基準日現在、対象ファンド・オブ・ファンズにおいて組入れはありません。

(10) MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド 2(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	2.875 T-NOTE 250731	国債	2.875%	2025/07/31	アメリカ	0.6%
2	2 T-NOTE 250815	国債	2.000%	2025/08/15	アメリカ	0.5%
3	2.125 T-NOTE 250515	国債	2.125%	2025/05/15	アメリカ	0.5%
4	2.75 T-NOTE 280215	国債	2.750%	2028/02/15	アメリカ	0.5%
5	2.25 T-NOTE 270815	国債	2.250%	2027/08/15	アメリカ	0.5%
6	3.125 T-NOTE 281115	国債	3.125%	2028/11/15	アメリカ	0.5%
7	0.625 T-NOTE 300815	国債	0.625%	2030/08/15	アメリカ	0.5%
8	3 T-NOTE 250930	国債	3.000%	2025/09/30	アメリカ	0.5%
9	2.5 O.A.T 300525	国債	2.500%	2030/05/25	フランス	0.5%
10	2.375 T-NOTE 270515	国債	2.375%	2027/05/15	アメリカ	0.5%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(11) 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、対象ファンド・オブ・ファンズにおいて組入れはありません。

以上