

2021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) 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)
- (3) 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)
- (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) 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)
- (6) 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)
- (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

2021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	3.4%
2	ソニーグループ	電気機器	2.6%
3	キーエンス	電気機器	2.2%
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.7%
5	リクルートホールディングス	サービス業	1.6%
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.5%
7	日本電信電話	情報・通信業	1.2%
8	HOYA	精密機器	1.1%
9	信越化学工業	化学	1.1%
10	日立製作所	電気機器	1.1%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(2) 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	4.3%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	3.6%
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	2.7%
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	1.4%
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	1.4%
7	TESLA INC	アメリカ	自動車・自動車部品	1.1%
8	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	0.9%
9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	0.9%
10	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノ・ライフ	0.8%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(3) 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359回利付国債(10年)	0.100%	2030/06/20	1.3%
2	第144回利付国債(5年)	0.100%	2025/06/20	1.3%
3	第138回利付国債(5年)	0.100%	2023/12/20	1.2%
4	第134回利付国債(5年)	0.100%	2022/12/20	1.1%
5	第356回利付国債(10年)	0.100%	2029/09/20	1.1%
6	第333回利付国債(10年)	0.600%	2024/03/20	1.0%
7	第360回利付国債(10年)	0.100%	2030/09/20	1.0%
8	第348回利付国債(10年)	0.100%	2027/09/20	1.0%
9	第329回利付国債(10年)	0.800%	2023/06/20	1.0%
10	第358回利付国債(10年)	0.100%	2030/03/20	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	16.3%
2	第22回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2027/03/10	14.1%
3	第23回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2028/03/10	13.4%
4	第21回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2026/03/10	13.3%
5	第24回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2029/03/10	13.0%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(5) 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	0.75 T-NOTE 260331	国債	0.750%	2026/03/31	アメリカ	0.80%
2	0.125 T-NOTE 230331	国債	0.125%	2023/03/31	アメリカ	0.75%
3	1.625 T-NOTE 310515	国債	1.625%	2031/05/15	アメリカ	0.70%
4	2 T-NOTE 240531	国債	2.000%	2024/05/31	アメリカ	0.62%
5	1.625 T-NOTE 260515	国債	1.625%	2026/05/15	アメリカ	0.60%
6	2.75 T-NOTE 231115	国債	2.750%	2023/11/15	アメリカ	0.57%
7	2.875 T-NOTE 280515	国債	2.875%	2028/05/15	アメリカ	0.53%
8	2.25 T-BOND 410515	国債	2.250%	2041/05/15	アメリカ	0.53%
9	1.45 SPAIN GOVT 271031	国債	1.450%	2027/10/31	スペイン	0.52%
10	2.875 T-NOTE 280815	国債	2.875%	2028/08/15	アメリカ	0.50%

※比率は純資産総額に対する割合です。

(6) 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	2.75 T-NOTE 280215	国債	2.750%	2028/02/15	アメリカ	0.6%
2	2.875 T-NOTE 280815	国債	2.875%	2028/08/15	アメリカ	0.6%
3	2 T-NOTE 240531	国債	2.000%	2024/05/31	アメリカ	0.6%
4	0.875 T-NOTE 260630	国債	0.875%	2026/06/30	アメリカ	0.5%
5	0.625 T-NOTE 271231	国債	0.625%	2027/12/31	アメリカ	0.5%
6	2 T-NOTE 250815	国債	2.000%	2025/08/15	アメリカ	0.5%
7	2.125 T-NOTE 250515	国債	2.125%	2025/05/15	アメリカ	0.5%
8	1.125 T-NOTE 310215	国債	1.125%	2031/02/15	アメリカ	0.5%
9	0.875 T-NOTE 301115	国債	0.875%	2030/11/15	アメリカ	0.5%
10	2.5 O.A.T 300525	国債	2.500%	2030/05/25	フランス	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、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