

2023年10月20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

2023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	4.4%
2	ソニーグループ	電気機器	2.6%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.3%
4	日本電信電話	情報・通信業	1.7%
5	キーエンス	電気機器	1.7%
6	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.5%
7	三菱商事	卸売業	1.4%
8	日立製作所	電気機器	1.4%
9	東京エレクトロン	電気機器	1.3%
10	武田薬品工業	医薬品	1.2%

※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	5.1%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	4.2%
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	2.2%
4	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	2.0%
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	1.5%
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	1.3%
7	TESLA INC	アメリカ	自動車・自動車部品	1.3%
8	META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	メディア・娯楽	1.3%
9	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	0.9%
10	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	0.9%

※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160回利付国債(5年)	0.200%	2028/06/20	1.3%
2	第359回利付国債(10年)	0.100%	2030/06/20	1.0%
3	第365回利付国債(10年)	0.100%	2031/12/20	1.0%
4	第356回利付国債(10年)	0.100%	2029/09/20	1.0%
5	第363回利付国債(10年)	0.100%	2031/06/20	1.0%
6	第364回利付国債(10年)	0.100%	2031/09/20	0.9%
7	第358回利付国債(10年)	0.100%	2030/03/20	0.9%
8	第350回利付国債(10年)	0.100%	2028/03/20	0.9%
9	第354回利付国債(10年)	0.100%	2029/03/20	0.9%
10	第145回利付国債(5年)	0.100%	2025/09/20	0.8%

※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	17.2%
2	第22回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2027/03/10	14.8%
3	第23回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2028/03/10	14.4%
4	第21回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2026/03/10	14.4%
5	第24回利付国債(物価連動・10年)	0.100%	2029/03/10	13.8%

※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	4.125 T-NOTE 321115	国債	4.125%	2032/11/15	アメリカ	0.5%
2	3.5 T-NOTE 330215	国債	3.500%	2033/02/15	アメリカ	0.4%
3	1.25 T-NOTE 310815	国債	1.250%	2031/08/15	アメリカ	0.4%
4	2.875 T-NOTE 320515	国債	2.875%	2032/05/15	アメリカ	0.4%
5	2.75 T-NOTE 320815	国債	2.750%	2032/08/15	アメリカ	0.4%
6	3.375 T-NOTE 330515	国債	3.375%	2033/05/15	アメリカ	0.4%
7	1.875 T-NOTE 320215	国債	1.875%	2032/02/15	アメリカ	0.4%
8	1.375 T-NOTE 311115	国債	1.375%	2031/11/15	アメリカ	0.4%
9	1.125 T-NOTE 310215	国債	1.125%	2031/02/15	アメリカ	0.4%
10	0.875 T-NOTE 301115	国債	0.875%	2030/11/15	アメリカ	0.4%

※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	4.125 T-NOTE 321115	国債	4.1250%	2032/11/15	アメリカ	0.5%
2	1.25 T-NOTE 280630	国債	1.2500%	2028/06/30	アメリカ	0.5%
3	2.875 T-NOTE 320515	国債	2.8750%	2032/05/15	アメリカ	0.5%
4	2.75 T-NOTE 320815	国債	2.7500%	2032/08/15	アメリカ	0.4%
5	3.375 T-NOTE 330515	国債	3.3750%	2033/05/15	アメリカ	0.4%
6	3.5 T-NOTE 330215	国債	3.5000%	2033/02/15	アメリカ	0.4%
7	1.25 T-NOTE 310815	国債	1.2500%	2031/08/15	アメリカ	0.4%
8	1.375 T-NOTE 311115	国債	1.3750%	2031/11/15	アメリカ	0.4%
9	1.125 T-NOTE 310215	国債	1.1250%	2031/02/15	アメリカ	0.4%
10	0.625 T-NOTE 300815	国債	0.6250%	2030/08/15	アメリカ	0.4%

※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