

2024 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

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

2024 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	3.6%
2	ソニーグループ	電気機器	2.6%
3	日立製作所	電気機器	2.4%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.3%
5	キーエンス	電気機器	1.8%
6	リクルートホールディングス	サービス業	1.7%
7	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.7%
8	三菱商事	卸売業	1.6%
9	伊藤忠商事	卸売業	1.4%
10	信越化学工業	化学	1.4%

※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	4.9%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	4.5%
3	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	4.4%
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	2.6%
5	META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	メディア・娯楽	1.8%
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	1.4%
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	1.2%
8	BROADCOM INC	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.1%
9	TESLA INC	アメリカ	自動車・自動車部品	1.1%
10	ELI LILLY & CO	アメリカ	医薬品・バイオテクノ・ライフ	1.0%

※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149回利付国債(5年)	0.005%	2026/09/20	1.30%
2	第359回利付国債(10年)	0.100%	2030/06/20	1.03%
3	第369回利付国債(10年)	0.500%	2032/12/20	1.03%
4	第171回利付国債(5年)	0.400%	2029/06/20	1.01%
5	第370回利付国債(10年)	0.500%	2033/03/20	1.00%
6	第373回利付国債(10年)	0.600%	2033/12/20	1.00%
7	第368回利付国債(10年)	0.200%	2032/09/20	0.99%
8	第356回利付国債(10年)	0.100%	2029/09/20	0.97%
9	第371回利付国債(10年)	0.400%	2033/06/20	0.96%
10	第363回利付国債(10年)	0.100%	2031/06/20	0.95%

※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22回利付国債(物価連動・10年)	0.1000%	2027/03/10	16.1%
2	第21回利付国債(物価連動・10年)	0.1000%	2026/03/10	15.8%
3	第23回利付国債(物価連動・10年)	0.1000%	2028/03/10	15.8%
4	第24回利付国債(物価連動・10年)	0.1000%	2029/03/10	15.4%
5	第28回利付国債(物価連動・10年)	0.0050%	2033/03/10	8.9%

※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 T-NOTE 340215	国債	4.000%	2034/02/15	アメリカ	0.54%
2	4.375 T-NOTE 340515	国債	4.375%	2034/05/15	アメリカ	0.52%
3	1.25 T-NOTE 310815	国債	1.250%	2031/08/15	アメリカ	0.50%
4	4.5 T-NOTE 331115	国債	4.500%	2033/11/15	アメリカ	0.46%
5	4.625 T-NOTE 260228	国債	4.625%	2026/02/28	アメリカ	0.44%
6	1.625 T-NOTE 310515	国債	1.625%	2031/05/15	アメリカ	0.42%
7	4.625 T-NOTE 270615	国債	4.625%	2027/06/15	アメリカ	0.41%
8	3.875 T-NOTE 330815	国債	3.875%	2033/08/15	アメリカ	0.41%
9	2.375 T-NOTE 270515	国債	2.375%	2027/05/15	アメリカ	0.40%
10	0.875 T-NOTE 301115	国債	0.875%	2030/11/15	アメリカ	0.40%

※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	4.375 T-NOTE 340515	国債	4.3750%	2034/05/15	アメリカ	0.5%
2	4.5 T-NOTE 331115	国債	4.5000%	2033/11/15	アメリカ	0.5%
3	3.875 T-NOTE 330815	国債	3.8750%	2033/08/15	アメリカ	0.4%
4	4 T-NOTE 340215	国債	4.0000%	2034/02/15	アメリカ	0.4%
5	1.25 T-NOTE 310815	国債	1.2500%	2031/08/15	アメリカ	0.4%
6	4.125 T-NOTE 321115	国債	4.1250%	2032/11/15	アメリカ	0.4%
7	2.875 T-NOTE 320515	国債	2.8750%	2032/05/15	アメリカ	0.4%
8	3.375 T-NOTE 330515	国債	3.3750%	2033/05/15	アメリカ	0.4%
9	3.5 T-NOTE 330215	国債	3.5000%	2033/02/15	アメリカ	0.4%
10	1.375 T-NOTE 311115	国債	1.3750%	2031/11/15	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