

2023年7月6日

お客様各位

ちばぎん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、運用する以下のファンド・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

「投資信託等の運用に関する規則」(投資信託協会規則)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

- グローバル厳選バランスファンド

## 2.開示対象の組入ファンド

- (1) 日本株グロースファンド(適格機関投資家限定)
- (2) 日本中小型株ファンド(適格機関投資家限定)
- (3) MFS 外国株グロース・ファンド F(適格機関投資家専用)
- (4) グローバル・フランチャイズ・ファンド M-2(適格機関投資家専用)
- (5) ノムラ FOFs 用・グローバル・クオリティ・セレクト(適格機関投資家専用)
- (6) ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)
- (7) PIMCO Bermuda Trust IV PIMCO Global Bond Strategy Fund-C(JPY,Hedged)
- (8) ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン
- (9) 日本債券インデックス・ファンド<適格機関投資家限定>
- (10) グローバル・リアルエステート・ファンド(適格機関投資家向け)
- (11) シュローダー・マルチアセット・ターゲット・ファンド(少人数私募)

## 3.開示基準日

- 2023年5月末日基準

#### 4.保有銘柄明細

##### (1) 日本株グロースファンド(適格機関投資家限定)

	銘柄	業種	比率
1	ソニーグループ	電気機器	3.6%
2	キーエンス	電気機器	3.2%
3	トヨタ自動車	輸送用機器	2.7%
4	日本電信電話	情報・通信業	2.3%
5	東京エレクトロン	電気機器	2.1%
6	リクルートホールディングス	サービス業	2.1%
7	HOYA	精密機器	1.9%
8	第一三共	医薬品	1.9%
9	オリエンタルランド	サービス業	1.9%
10	KDDI	情報・通信業	1.9%

※マザーファンドにおける組入状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

##### (2) 日本中小型株ファンド(適格機関投資家限定)

	銘柄	業種	比率
1	ジャパンマテリアル	サービス業	1.7%
2	ビジョン	情報・通信業	1.5%
3	ソシオネクスト	電気機器	1.5%
4	FPパートナー	保険業	1.5%
5	JMDC	情報・通信業	1.4%
6	ベース	情報・通信業	1.3%
7	ENECHANGE	情報・通信業	1.3%
8	日置電機	電気機器	1.2%
9	日総工産	サービス業	1.1%
10	SHIFT	情報・通信業	1.1%

※マザーファンドにおける組入状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

##### (3) MFS 外国株グロース・ファンド F(適格機関投資家専用)

	会社	国	セクター	比率
1	MICROSOFT CORP	米国	情報技術	5.78%
2	ALPHABET INC	米国	コミュニケーション・サービス	5.75%
3	ACCENTURE PLC	米国	情報技術	3.07%
4	VISA INC	米国	金融	2.89%
5	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	カナダ	資本財・サービス	2.63%
6	APPLE INC	米国	情報技術	2.48%
7	TAIWAN SEMICONDUCTOR	台湾	情報技術	2.27%
8	TENCENT HOLDINGS LIMITED	中国	コミュニケーション・サービス	2.24%
9	ICON PLC	米国	ヘルスケア	2.09%
10	ADOBE SYSTEMS INC	米国	情報技術	2.07%

※マザーファンドにおける組入状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

## (4) グローバル・フランチャイズ・ファンド M-2(適格機関投資家専用)

	銘柄名	比率
1	MICROSOFT CORP	8.84%
2	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	6.38%
3	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	6.15%
4	SAP SE	6.13%
5	ACCENTURE PLC-CL A	5.96%
6	VISA INC-CLASS A SHARES	5.53%
7	DANAHER CORP	4.69%
8	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4.57%
9	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	3.80%
10	ABBOTT LABORATORIES	3.42%

※保有状況は月末の前営業日、比率は対純資産総額比(マザーファンドベース)です。

## (5) ノムラ FOFs 用・グローバル・クオリティ・セレクト(適格機関投資家専用)

	銘柄	国	業種	比率
1	APPLE INC	米国	情報技術	4.80%
2	MICROSOFT CORP	米国	情報技術	4.62%
3	CISCO SYSTEMS	米国	情報技術	2.94%
4	JOHNSON & JOHNSON	米国	ヘルスケア	2.94%
5	BROADCOM INC	米国	情報技術	2.60%
6	TAIWAN SEMICONDUCTOR	台湾	情報技術	2.55%
7	PEPSICO INC	米国	生活必需品	2.51%
8	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	米国	生活必需品	2.45%
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	米国	ヘルスケア	2.40%
10	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	スイス	ヘルスケア	2.36%

※マザーファンドにおける組入状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

## (6) ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)

	銘柄名	利率	償還日	比率
1	アメリカ国債	2.375%	2024/8/15	1.1%
2	アメリカ国債	2.250%	2024/11/15	1.0%
3	アメリカ国債	2.500%	2024/5/15	1.0%
4	アメリカ国債	0.500%	2025/3/31	0.9%
5	アメリカ国債	0.625%	2027/11/30	0.9%
6	中国国債	2.910%	2028/10/14	0.8%
7	中国国債	2.690%	2026/8/12	0.8%
8	アメリカ国債	2.000%	2024/5/31	0.7%
9	アメリカ国債	1.625%	2029/8/15	0.7%
10	アメリカ国債	2.125%	2024/9/30	0.7%

※マザーファンドにおける組入状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

## (7) PIMCO Bermuda Trust IV PIMCO Global Bond Strategy Fund-C(JPY,Hedged)

	銘柄	セクター	通貨	利率	償還日	比率
1	FNMA TBA 4.5% JUL 30YR	モーゲージ証券・資産担保証券等	米ドル	4.500%	2053/7/13	5.65%
2	US TREASURY NOTE	国債	米ドル	2.750%	2025/2/28	4.75%
3	FNMA TBA 4.0% JUL 30YR	モーゲージ証券・資産担保証券等	米ドル	4.000%	2053/7/13	3.61%
4	FNMA TBA 5.5% JUL 30YR	モーゲージ証券・資産担保証券等	米ドル	5.500%	2053/7/13	3.16%
5	FNMA TBA 3.5% JUL 30YR	モーゲージ証券・資産担保証券等	米ドル	3.500%	2053/7/13	3.11%
6	FNMA TBA 5.0% JUL 30YR	モーゲージ証券・資産担保証券等	米ドル	5.000%	2053/7/13	2.62%
7	US TREASURY BOND	国債	米ドル	1.875%	2041/2/15	2.07%
8	FNMA TBA 3.0% JUL 30YR	モーゲージ証券・資産担保証券等	米ドル	3.000%	2053/7/13	1.98%
9	NYKREDIT REALKREDIT AS SEC REG	社債	デンマーククローネ	3.000%	2053/10/1	1.68%
10	US TREASURY INFLATE PROT BD	国債	米ドル	1.625%	2027/10/15	1.68%

※マザーファンドにおける組入状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

## (8) ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン

	銘柄名	利率	償還日	比率
1	アメリカ国債	2.375%	2024/8/15	1.1%
2	アメリカ国債	2.250%	2024/11/15	1.0%
3	アメリカ国債	2.500%	2024/5/15	1.0%
4	アメリカ国債	0.500%	2025/3/31	0.9%
5	アメリカ国債	0.625%	2027/11/30	0.9%
6	中国国債	2.910%	2028/10/14	0.8%
7	中国国債	2.690%	2026/8/12	0.8%
8	アメリカ国債	2.000%	2024/5/31	0.7%
9	アメリカ国債	1.625%	2029/8/15	0.7%
10	アメリカ国債	2.125%	2024/9/30	0.7%

※マザーファンドにおける組入状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

## (9) 日本債券インデックス・ファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;

	銘柄名	利率	償還日	比率
1	第 145 回利付国債(5 年)	0.10%	2025/9/20	1.31%
2	第 350 回利付国債(10 年)	0.10%	2028/3/20	1.30%
3	第 362 回利付国債(10 年)	0.10%	2031/3/20	1.21%
4	第 364 回利付国債(10 年)	0.10%	2031/9/20	1.21%
5	第 150 回利付国債(5 年)	0.01%	2026/12/20	1.16%
6	第 149 回利付国債(5 年)	0.01%	2026/9/20	1.09%
7	第 153 回利付国債(5 年)	0.01%	2027/6/20	1.08%
8	第 340 回利付国債(10 年)	0.40%	2025/9/20	1.07%
9	第 341 回利付国債(10 年)	0.30%	2025/12/20	0.95%
10	第 353 回利付国債(10 年)	0.10%	2028/12/20	0.94%

※マザーファンドにおける組入状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

## (10) グローバル・リアルエステート・ファンド(適格機関投資家向け)

	銘柄	国名	セクター名	比率
1	PROLOGIS INC	米国	産業施設(工場等)	7.58%
2	AVALONBAY COMMUNITIES INC	米国	住宅(マンション等)	3.86%
3	PUBLIC STORAGE	米国	特化型	3.81%
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	米国	特化型	3.77%
5	ESSEX PROPERTY TRUST INC	米国	住宅(マンション等)	3.56%
6	INVITATION HOMES INC	米国	住宅(マンション等)	3.47%
7	REALTY INCOME CORP	米国	小売(商業施設等)	3.33%
8	EQUINIX INC	米国	特化型	3.31%
9	VICI PROPERTIES INC	米国	特化型	2.96%
10	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	米国	産業施設(工場等)	2.92%

※マザーファンドにおける組入状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

## (11) シュローダー・マルチアセット・ターゲット・ファンド(少人数私募)

	銘柄名	資産概要	比率
1	ITALY 0% 30/01/24	欧州圏国債	12.1%
2	ISHARES EURO CORP LARGE CAP ETF	グローバル社債	9.8%
3	S&P500 EMINI JUN 23	米国株式	8.8%
4	AUST 10YR BOND JUN 23	その他国債	7.0%
5	ISHARES IBOXX INV GRA CORPORATE BOND ETF	グローバル社債	6.9%
6	AUSTRALIA 2.5% 21/05/30	その他国債	6.8%
7	KOREA 10 YR BOND JUN 23	その他国債	6.8%
8	LONG GILT JUN 22	欧州圏国債	5.3%
9	SPAIN 4.65% 25/07/30	欧州圏国債	5.0%
10	ITALY 3.75% 01/09/24	欧州圏国債	4.8%

※マザーファンドにおける組入状況を純資産総額に対する比率で表示しています。

以上