

2024年7月4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) 日本債券インデックス・ファンド<適格機関投資家限定>
- (7) 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)
- (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) 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)
- (10) FOFs 用ゴールド・ファンド為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)

3.開示基準日

- 2024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	日立製作所	電気機器	3.6
2	東京エレクトロン	電気機器	3.1
3	ソニーグループ	電気機器	3.0
4	リクルートホールディングス	サービス業	2.7
5	トヨタ自動車	輸送用機器	2.7
6	キーエンス	電気機器	2.6
7	東京海上ホールディングス	保険業	2.6
8	第一三共	医薬品	2.5
9	信越化学工業	化学	2.0
10	ソフトバンク	情報・通信業	1.8

※業種は、東証 33 業種分類によるものです。

※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	MARUWA	ガラス・土石製品	2.0
2	Macbee Planet	サービス業	1.8
3	日本マイクロニクス	電気機器	1.6
4	ジャパンエレベーターサービスホールディングス	サービス業	1.5
5	メイコー	電気機器	1.5
6	日本製鋼所	機械	1.3
7	フィックスターズ	情報・通信業	1.3
8	ユニオンツール	機械	1.3
9	QPS研究所	情報・通信業	1.3
10	リンテック	その他製品	1.3

※業種は、東証 33 業種分類によるものです。

※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	比率(%)
1	MICROSOFT CORP	米国	7.11
2	ALPHABET INC	米国	3.49
3	VISA INC	米国	3.45
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR	台湾	3.35
5	TENCENT HOLDINGS LIMITED	中国	3.05
6	NVIDIA CORP	米国	2.71
7	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	カナダ	2.33
8	APPLE INC	米国	2.29
9	HDFC BANK	インド	2.11
10	ACCENTURE PLC	米国	2.09

※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	8.27
2	SAP SE	6.23
3	VISA INC-CLASS A SHARES	5.87
4	ACCENTURE PLC-CL A	4.81
5	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	4.38
6	UNITEDHEALTH GROUP INC	3.63
7	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3.60
8	BECTON DICKINSON AND COMPANY	3.33
9	RELX PLC	3.12
10	ABBOTT LABORATORIES	3.09

※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	比率(%)
1	MICROSOFT CORP	米国	4.55
2	APPLE INC	米国	4.54
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	台湾	2.86
4	UNITEDHEALTH GROUP INC	米国	2.46
5	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	米国	2.44
6	BROADCOM INC	米国	2.39
7	PEPSICO INC	米国	2.34
8	ASTRAZENECA PLC	英国	2.24
9	JOHNSON & JOHNSON	米国	2.22
10	MASTERCARD INC	米国	2.20

※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) 日本債券インデックス・ファンド<適格機関投資家限定>

	銘柄名	利率(%)	償還日	比率(%)
1	第 361 回利付国債(10 年)	0.10	2030/12/20	1.90
2	第 1 回クライメート・トランジション利付国債(10 年)	0.70	2033/12/20	1.65
3	第 150 回利付国債(5 年)	0.01	2026/12/20	1.26
4	第 348 回利付国債(10 年)	0.10	2027/9/20	1.26
5	第 151 回利付国債(5 年)	0.01	2027/3/20	1.26
6	第 451 回利付国債(2 年)	0.01	2025/8/1	1.13
7	第 346 回利付国債(10 年)	0.10	2027/3/20	1.12
8	第 363 回利付国債(10 年)	0.10	2031/6/20	1.12
9	第 347 回利付国債(10 年)	0.10	2027/6/20	1.05
10	第 340 回利付国債(10 年)	0.40	2025/9/20	1.01

※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) 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	1.625	2029/8/15	1.2
2	中国国債	2.690	2026/8/12	0.9
3	中国国債	2.910	2028/10/14	0.9
4	アメリカ国債	4.250	2029/2/28	0.8
5	アメリカ国債	0.625	2027/11/30	0.8
6	アメリカ国債	2.875	2025/7/31	0.8
7	アメリカ国債	1.500	2027/1/31	0.7
8	アメリカ国債	2.000	2025/8/15	0.7
9	中国国債	2.240	2025/5/25	0.7
10	アメリカ国債	2.125	2025/5/15	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。

(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	1.625	2029/8/15	1.2
2	中国国債	2.690	2026/8/12	0.9
3	中国国債	2.910	2028/10/14	0.9
4	アメリカ国債	4.250	2029/2/28	0.8
5	アメリカ国債	0.625	2027/11/30	0.8
6	アメリカ国債	2.875	2025/7/31	0.8
7	アメリカ国債	1.500	2027/1/31	0.7
8	アメリカ国債	2.000	2025/8/15	0.7
9	中国国債	2.240	2025/5/25	0.7
10	アメリカ国債	2.125	2025/5/15	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) 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	比率(%)
1	PROLOGIS INC	米国	7.90
2	EQUINIX INC	米国	5.10
3	PUBLIC STORAGE	米国	4.13
4	AVALONBAY COMMUNITIES INC	米国	4.08
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	米国	3.72
6	REALTY INCOME CORP	米国	3.45
7	SIMON PROPERTY GROUP INC	米国	2.83
8	AMERICAN TOWER CORP	米国	2.61
9	VICI PROPERTIES INC	米国	2.55
10	WELLTOWER INC	米国	2.46

※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) FOFs 用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)

	銘柄名	通貨名	比率(%)
1	SPDR GOLD MINISHARES TRUST-ETF	米ドル	50.18
2	ISHARES GOLD TRUST-ETF	米ドル	40.82
3	ISHARES GOLD TRUST MICRO-ETF	米ドル	8.06
4	SPDR GOLD TRUST-ETF	米ドル	0.90

※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