

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

- ちばぎんコア投資ファンド(安定型)
- ちばぎんコア投資ファンド(成長型)
- むさしのコア投資ファンド(安定型)
- むさしのコア投資ファンド(成長型)

2.開示対象の組入ファンド

- (1) FOFs 用国内株式インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (2) FOFs 用日本株式 ESG セレクト・リーダーズ・インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (3) 国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)
- (4) 日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)
- (5) FOFs 用国内株式 EVI バリューファンド(適格機関投資家専用)
- (6) FOFs 用日本債券ツイン戦略ファンド S(適格機関投資家専用)
- (7) マニュアルイフ FOFs 用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)
- (8) 明治安田 FOFs 用日本債券アクティブ戦略ファンド(適格機関投資家専用)
- (9) FOFs 用外国株式インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (10) FOFs 用外国株式 ESG リーダーズ・インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (11) グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)
- (12) ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)
- (13) Capital Group New Economy Fund(LUX) Class ZL
- (14) Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J
- (15) FOFs 用外国債券インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (16) フィデリティ 外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)
- (17) FOFs 用新興国債券インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (18) ウェスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)
- (19) FOFs 用 J-REIT インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (20) FOFs 用グローバル REIT インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (21) FOFs 用グローバル・コモディティ(米ドル建て)・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (22) 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)
- (23) BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund — クラス S-JPY
- (24) FOFs 用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド S(適格機関投資家専用)
- (25) FOFs 用米国株式 LS ファンド S(適格機関投資家専用)
- (26) FOFs 用コモディティ LS アルファ・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (27) FOFs 用米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド S(適格機関投資家専用)
- (28) ノムラ FOFs 用日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)
- (29) ウェスタン・カレンシー・アルファ・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (30) MA Hedge Fund Strategies Limited

3.開示基準日

2023年1月末日基準

4.保有銘柄明細

(1) FOFs 用国内株式インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.65%
2	ソニーグループ	電気機器	2.87%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.09%
4	キーエンス	電気機器	2.08%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.75%
6	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.42%
7	武田薬品工業	医薬品	1.27%
8	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.25%
9	任天堂	その他製品	1.24%
10	第一三共	医薬品	1.24%

※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) FOFs 用日本株式 ESG セレクト・リーダーズ・インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	6.93%
2	ソニーグループ	電気機器	5.03%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3.92%
4	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.54%
5	第一三共	医薬品	2.45%
6	東京エレクトロン	電気機器	2.31%
7	日立製作所	電気機器	2.27%
8	KDDI	情報・通信業	2.25%
9	任天堂	その他製品	2.14%
10	リクルートホールディングス	サービス業	2.06%

※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) 国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)

	銘柄	業種	比率
1	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3.1%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3.1%
3	ソニーグループ	電気機器	3.0%
4	本田技研工業	輸送用機器	2.9%
5	レンゴー	パルプ・紙	2.5%
6	オリンパス	精密機器	2.4%
7	日立製作所	電気機器	2.4%
8	富士フイルムホールディングス	化学	2.1%
9	日本電信電話	情報・通信業	2.0%
10	アマノ	機械	2.0%

※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) 日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)

	銘柄	業種	比率
1	ソニーグループ	電気機器	6.1%
2	ニトリホールディングス	小売業	5.2%
3	オリックス	その他金融業	4.8%
4	オリンパス	精密機器	4.8%
5	エヌ・ティ・ティ・データ	情報・通信業	4.6%
6	東京海上ホールディングス	保険業	4.5%
7	アドバンテスト	電気機器	4.5%
8	アシックス	その他製品	4.3%
9	HOYA	精密機器	3.9%
10	リクルートホールディングス	サービス業	3.9%

※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。

(5) FOFs 用国内株式 EVI バリュースケールファンド(適格機関投資家専用)

	銘柄	業種	比率
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5.60%
2	日立製作所	電気機器	3.89%
3	信越化学工業	化学	3.78%
4	日本製鉄	鉄鋼	3.76%
5	トヨタ自動車	輸送用機器	3.61%
6	スズキ	輸送用機器	3.51%
7	パナソニック ホールディングス	電気機器	3.50%
8	日本郵政	サービス業	3.28%
9	武田薬品工業	医薬品	2.93%
10	三菱商事	卸売業	2.89%

※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) FOFs 用日本債券ツイン戦略ファンド S(適格機関投資家専用)

	銘柄名	種類	クーポン	償還日	比率
1	第364回利付国債(10年)	国債	0.100%	2031/9/20	8.00%
2	第369回利付国債(10年)	国債	0.500%	2032/12/20	6.56%
3	第154回利付国債(5年)	国債	0.100%	2027/9/20	4.67%
4	第366回利付国債(10年)	国債	0.200%	2032/3/20	3.75%
5	第443回利付国債(2年)	国債	0.005%	2024/12/1	3.51%
6	第182回利付国債(20年)	国債	1.100%	2042/9/20	2.80%
7	第365回利付国債(10年)	国債	0.100%	2031/12/20	2.36%
8	第76回利付国債(30年)	国債	1.400%	2052/9/20	2.20%
9	第1回東京海上日動火災保険利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	事業債	0.960%	2029/12/24	1.67%
10	第5回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	事業債	1.020%	2031/2/8	1.31%

※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。

※コーラブル債は初回コール日を償還日として記載しています。

(7) マニユライフ FOFs 用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)

	銘柄名	クーポン	償還日	比率
1	第71回利付国債(30年)	0.70%	2051/06/20	7.82%
2	第155回利付国債(5年)	0.30%	2027/12/20	5.89%
3	第182回利付国債(20年)	1.10%	2042/09/20	5.81%
4	第369回利付国債(10年)	0.50%	2032/12/20	5.66%
5	第4回ソフトバンクグループ株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	3.00%	2056/02/04	4.25%
6	第15回利付国債(40年)	1.00%	2062/03/20	3.77%
7	第1回武田薬品工業株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	1.72%	2079/06/06	2.73%
8	第72回利付国債(30年)	0.70%	2051/09/20	2.73%
9	第2回三井住友海上火災保険株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	1.39%	2076/02/10	2.37%
10	第1回株式会社大和証券グループ本社任意償還条項付無担保永久社債	1.20%	-	2.32%

※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) 明治安田 FOFs 用日本債券アクティブ戦略ファンド(適格機関投資家専用)

	銘柄名	クーポン	償還日	比率
1	第155回利付国債5年	0.300%	2027/12/20	7.65%
2	第1059回国庫短期証券	-	2023/2/20	4.05%
3	第24回ルノー円貨社債	1.540%	2024/7/5	3.21%
4	第1回武田薬品工業無担保社債(劣後特約付)	1.720%	2024/10/6	2.98%
5	第154回利付国債5年	0.100%	2027/9/20	2.87%
6	第363回利付国債10年	0.100%	2031/6/20	2.87%
7	第354回利付国債10年	0.100%	2029/3/20	2.49%
8	第1回アサヒグループホールディングス無担保社債(劣後特約付)	0.970%	2025/10/15	2.49%
9	第356回利付国債10年	0.100%	2029/9/20	2.31%
10	第153回利付国債20年	1.300%	2035/6/20	2.05%

※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。

※コーラブル債は初回コール日を償還日として記載しています。

(9) FOFs 用外国株式インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)

	銘柄	業種	国	比率
1	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	米国	4.54%
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	米国	3.40%
3	AMAZON.COM	小売	米国	1.82%
4	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	米国	1.15%
5	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	米国	1.07%
6	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	米国	0.94%
7	EXXON MOBIL	エネルギー	米国	0.93%
8	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	米国	0.90%
9	TESLA INC	自動車・自動車部品	米国	0.87%
10	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	米国	0.84%

※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 用外国株式 ESG リーダーズ・インデックス・ファンド S (適格機関投資家専用)

	銘柄	業種	国	比率
1	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	米国	6.66%
2	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	米国	2.26%
3	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	米国	2.10%
4	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	米国	1.85%
5	TESLA INC	自動車・自動車部品	米国	1.73%
6	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	米国	1.66%
7	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	米国	1.46%
8	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	米国	1.31%
9	HOME DEPOT	小売	米国	1.25%
10	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	米国	1.24%

※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) グローバル株式コンセントレイト・ファンド (適格機関投資家専用)

	銘柄	国	通貨	業種	比率
1	MICROSOFT CORP	米国	米ドル	情報技術	9.03%
2	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	米国	米ドル	生活必需品	7.53%
3	VISA INC-CLASS A SHARES	米国	米ドル	情報技術	6.61%
4	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	英国	英ポンド	生活必需品	5.69%
5	SAP SE	ドイツ	ユーロ	情報技術	5.53%
6	DANAHER CORP	米国	米ドル	ヘルスケア	5.20%
7	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	米国	米ドル	ヘルスケア	4.59%
8	ACCENTURE PLC-CL A	米国	米ドル	情報技術	4.53%
9	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	米国	米ドル	金融	3.95%
10	ABBOTT LABORATORIES	米国	米ドル	ヘルスケア	3.78%

※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。

(12) ブランディワイン・グローバル株式ファンド (適格機関投資家専用)

	銘柄	国	通貨	業種	比率
1	BNP パリバ	フランス	ユーロ	金融	3.71%
2	アリババ・グループ・ホールディング	中国	米ドル	一般消費財・サービス	3.35%
3	バイドウ	中国	米ドル	コミュニケーション・サービス	3.07%
4	サンタンデール銀行	スペイン	ユーロ	金融	2.73%
5	サンゴバン	フランス	ユーロ	資本財・サービス	2.65%
6	LG	韓国	韓国ウォン	資本財・サービス	2.52%
7	ドイツ・テレコム	ドイツ	ユーロ	コミュニケーション・サービス	2.45%
8	ハスクパーナ	スウェーデン	スウェーデン・クローナ	資本財・サービス	2.01%
9	ウェルズ・ファーゴ	米国	米ドル	金融	1.97%
10	オートリブ	スウェーデン	スウェーデン・クローナ	一般消費財・サービス	1.93%

※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。

(13)Capital Group New Economy Fund(LUX)Class ZL

	銘柄	国	通貨	業種	比率
1	BROADCOM INC.	米国	米ドル	情報技術	4.07%
2	MICROSOFT CORP.	米国	米ドル	情報技術	3.74%
3	MICRON TECHNOLOGY, INC.	米国	米ドル	情報技術	2.44%
4	UNITEDHEALTH GROUP INC.	米国	米ドル	ヘルスケア	2.44%
5	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC.	米国	米ドル	ヘルスケア	2.08%
6	CERIDIAN HCM HOLDING INC.	米国	米ドル	情報技術	1.66%
7	KOTAK MAHINDRA BANK LTD.	インド	インド・ルピー	金融	1.59%
8	APPLIED MATERIALS, INC.	米国	米ドル	情報技術	1.50%
9	NETFLIX, INC.	米国	米ドル	コミュニケーション・サービス	1.47%
10	AMAZON.COM, INC.	米国	米ドル	一般消費財・サービス	1.46%

※純資産総額に対する比率で表示しています。

(14)Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J

	銘柄	国・地域	比率
1	Taiwan Semiconductor Manufacturing	台湾	6.04%
2	Tencent	中国	5.98%
3	Samsung Electronics	韓国	3.56%
4	Alibaba Group	中国	2.92%
5	Contemporary Amperex Technology	中国	2.11%
6	China Merchants Bank	中国	1.95%
7	Reliance Industries	インド	1.86%
8	Axis Bank	インド	1.82%
9	Vale	ブラジル	1.78%
10	Bank Rakyat Indonesia	インドネシア	1.75%

※純資産総額に対する比率で表示しています。

(15)FOFs 用外国債券インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)

	銘柄名	クーポン	通貨	比率
1	T 2.75% 08/15/32	2.750%	米ドル	0.59%
2	T 2.625% 02/15/29	2.625%	米ドル	0.57%
3	T 0.25% 03/15/24	0.250%	米ドル	0.56%
4	CGB 1.99% 04/09/25	1.990%	中国元	0.53%
5	T 1.25% 08/15/31	1.250%	米ドル	0.50%
6	T 2.375% 05/15/27	2.375%	米ドル	0.50%
7	T 2.25% 08/15/27	2.250%	米ドル	0.49%
8	T 0.75% 08/31/26	0.750%	米ドル	0.48%
9	T 0.5% 04/30/27	0.500%	米ドル	0.47%
10	T 1.875% 02/15/32	1.875%	米ドル	0.46%

※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。

(16)フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)

	銘柄名	種類	通貨	クーポン	償還日	比率
1	米国国債	国債	米ドル	4.125%	2032/11/15	5.61%
2	ドイツ国債	国債	ユーロ	0.000%	2032/02/15	5.09%
3	中国国債	国債	中国元	1.990%	2025/04/09	5.01%
4	米国国債	国債	米ドル	4.125%	2027/09/30	4.98%
5	米国国債	国債	米ドル	4.000%	2029/10/31	3.14%
6	米国国債	国債	米ドル	3.875%	2027/12/31	2.83%
7	ジニーメイ	モーゲージ債	米ドル	3.000%	2053/02/01	2.03%
8	韓国国債	国債	韓国ウォン	1.500%	2030/12/10	1.70%
9	英国国債	国債	英ポンド	0.875%	2033/07/31	1.63%
10	UMBS	モーゲージ債	米ドル	3.000%	2053/02/01	1.37%

※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。

(17)FOFs用新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)

	銘柄名	クーポン	通貨	比率
1	BLTN 0% 01/01/24	0.000%	ブラジル・リアル	2.44%
2	COLOM 9.85% 06/28/27	9.850%	コロンビア・ペソ	1.83%
3	SAGB 10.5% 12/21/26	10.500%	南アフリカ・ランド	1.73%
4	BNTNF 10% 01/01/25	10.000%	ブラジル・リアル	1.61%
5	BLTN 0% 01/01/26	0.000%	ブラジル・リアル	1.41%
6	SAGB 8% 01/31/30	8.000%	南アフリカ・ランド	1.35%
7	BNTNF 10% 01/01/27	10.000%	ブラジル・リアル	1.22%
8	MBONO 5.75% 03/05/26	5.750%	メキシコ・ペソ	1.17%
9	SAGB 8.25% 03/31/32	8.250%	南アフリカ・ランド	1.15%
10	BLTN 0% 07/01/24	0.000%	ブラジル・リアル	1.13%

※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。

(18)ウェスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)

	銘柄名	通貨	クーポン	償還日	比率
1	米国国債	米ドル	0.375%	2026/01/31	7.67%
2	WA CHINA BOND	オフショア人民元	-	-	3.74%
3	米国国債	米ドル	0.250%	2023/09/30	3.67%
4	米国国債	米ドル	3.875%	2027/11/30	3.67%
5	米国国債	米ドル	0.750%	2026/04/30	3.01%
6	米国国債	米ドル	2.625%	2027/05/31	2.39%
7	メキシコ国債	メキシコ・ペソ	7.750%	2042/11/13	2.23%
8	米国国債	米ドル	0.375%	2025/12/31	1.99%
9	中国国債	オフショア人民元	4.000%	2035/11/30	1.62%
10	中国農業銀行	オフショア人民元	3.400%	2024/11/06	1.59%

※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。

(19) FOFs 用 J-REIT インデックス・ファンド S (適格機関投資家専用)

	銘柄	用途	比率
1	日本ビルファンド投資法人	オフィス	6.27%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	オフィス	5.28%
3	日本都市ファンド投資法人	商業・物流等	4.79%
4	日本プロロジスリート投資法人	商業・物流等	4.70%
5	野村不動産マスターファンド投資法人	オフィス	4.65%
6	GLP投資法人	商業・物流等	4.49%
7	大和ハウスリート投資法人	商業・物流等	4.04%
8	オリックス不動産投資法人	オフィス	3.37%
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	商業・物流等	3.13%
10	アドバンス・レジデンス投資法人	住宅	3.01%

※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。

(20) FOFs 用グローバル REIT インデックス・ファンド S (適格機関投資家専用)

	銘柄	国	比率
1	PROLOGIS INC	米国	8.64%
2	EQUINIX INC	米国	4.92%
3	PUBLIC STORAGE	米国	3.47%
4	REALTY INCOME CORP	米国	3.12%
5	SIMON PROPERTY GROUP	米国	3.02%
6	WELLTOWER INC	米国	2.59%
7	VICI PROPERTIES INC	米国	2.40%
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	米国	2.33%
9	GOODMAN GROUP	オーストラリア	1.79%
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC	米国	1.77%

※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。

(21) FOFs 用グローバル・コモディティ(米ドル建て)・ファンド S (適格機関投資家専用)

	銘柄	通貨	比率
1	STAR HELIOS 008 10/24/23	米ドル	45.12%
2	SG ISSUER 031 11/30/23	米ドル	13.66%
3	SG ISSUER 030 09/29/23	米ドル	11.25%
4	SG ISSUER 027 02/28/23	米ドル	9.95%
5	SG ISSUER 028 04/28/23	米ドル	9.48%
6	BAR USD COM 040 06/30/23	米ドル	2.93%
7	IPATH DOW COMM 06/12/36	米ドル	2.89%
8	ETFS ALL COMMODITIES	米ドル	2.68%

※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。

(22) 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	通貨	比率
1	ISHARES GOLD TRUST-ETF	米ドル	47.67%
2	SPDR GOLD MINISHARES TRUST-ETF	米ドル	36.18%
3	SPDR GOLD TRUST-ETF	米ドル	10.23%
4	ISHARES GOLD TRUST MICRO-ETF	米ドル	5.90%

※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。

(23) BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラス S-JPY

	銘柄	国	セクター	比率
1	DBR 0 02/32 REGS	ドイツ	国債	9.90%
2	DBR 0 08/30 REGS	ドイツ	国債	3.90%
3	GS 0.01 04/24 REGS	米国	銀行	2.44%
4	MEX 4 03/15/2115	メキシコ	国債	2.14%
5	DBR 1.7 08/32 REGS	ドイツ	国債	2.05%
6	SAGB 8 1/2 01/31/37 #2037	南アフリカ	国債	2.02%
7	ILDFP 0 3/4 02/24 REGS	フランス	通信	1.75%
8	V 1 1/2 06/15/26	米国	テクノロジー	1.62%
9	ICEGB 4 1/2 02/17/42	アイスランド	国債	1.47%
10	COLOBD FLOAT 05/24 REGS	デンマーク	非シクリカル消費関連	1.46%

※純資産総額に対する比率で表示しています。

(24) FOFs 用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド S(適格機関投資家専用)

	銘柄	種類	比率
1	Treasury Bill Zero% 16.05.2023 Uns	Fixed Income	10.64%
2	Alibaba Group Holding Ltd	Equity	1.58%
3	Cie Financiere Richemont-Reg	Equity	1.22%
4	Roche Holding Ag-Genusschein	Equity	1.21%
5	Tencent Holdings Ltd	Equity	1.19%
6	Nestle Sa-Reg	Equity	1.17%
7	Oz Minerals Ltd	Equity	1.09%
8	Philip Morris International	Equity	1.05%
9	Saudi Int Bond 4.875% 18.07.2033 'Regs' Sr	Fixed Income	1.01%
10	Safran Sa	Equity	0.91%

※上記ファンドの連動対象である「Pictet TR-Diversified Alpha」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。

(25) FOFs 用米国株式 LS ファンド S(適格機関投資家専用)

	銘柄	国	比率
1	STAR HELIOS 004 10/18/27	アイルランド	92.53%

※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。

(26) FOFs 用コモディティ LS アルファ・ファンド S(適格機関投資家専用)

	銘柄名	通貨	比率
1	STAR HELIOS 0% 07/13/23	日本円	98.02%
2	ソシエテ・ジェネラル 0% 2023/06/30	日本円	1.36%

※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。

(27) FOFs 用米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド S(適格機関投資家専用)

	銘柄名	通貨	比率
1	STAR HELIOS 0% 10/18/23	日本円	99.07%

※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。

(28) ノムラ FOFs 用日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)

	銘柄	業種	比率
1	日本電信電話	情報・通信業	2.33%
2	信越化学工業	化学	2.05%
3	ユニ・チャーム	化学	2.04%
4	キーエンス	電気機器	1.94%
5	エムスリー	サービス業	1.74%
6	伊藤忠商事	卸売業	1.63%
7	中外製薬	医薬品	1.63%
8	東京海上ホールディングス	保険業	1.60%
9	KDDI	情報・通信業	1.55%
10	ダイキン工業	機械	1.55%

※投資信託証券の純資産比と当ファンドが保有する投資信託証券の組入比率から算出しています。

(29) ウェスタン・カレンシー・アルファ・ファンド S(適格機関投資家専用)

	銘柄	クーポン	償還日	比率
1	第1080回国庫短期証券	0.00%	2023/5/22	15.90%
2	第1118回国庫短期証券	0.00%	2023/2/13	12.98%
3	第1112回国庫短期証券	0.00%	2023/4/10	12.12%
4	第1124回国庫短期証券	0.00%	2023/3/13	8.42%
5	第1130回国庫短期証券	0.00%	2023/7/10	6.74%
6	第1119回国庫短期証券	0.00%	2023/5/10	5.80%

※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。

(30) MA Hedge Fund Strategies Limited

	銘柄	比率
1	ホライゾン・セラピューティクス	4.85%
2	アクティビジョン・プリザード	4.77%
3	ストア・キャピタル	4.66%
4	ショー・コミュニケーションズ	2.69%
5	ファースト・ホライゾン	2.56%

※純資産総額に対する比率で表示しています。

以上