

2024年3月12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

- 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) マニュアルIF 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)
- (7) 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)
- (8) ニッセイ国内債券アクティブプラス(FOFs 用)(適格機関投資家専用)
- (9) SMDAM 日本債券ファンド(適格機関投資家専用)
- (10) 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)
- (11) 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)
- (12) 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)
- (13) ブランディアウィン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)
- (14) ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)
- (15) 世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)
- (16) Capital Group New Economy Fund(LUX) Class ZL
- (17) FOFs 用世界債券総合インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (18) 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)
- (19) FOFs 用新興国株式インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (20) 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)
- (21) FOFs 用 J-REIT インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)
- (22) 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)
- (23) 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)
- (24) 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)
- (25) BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラス S-JPY
- (26) 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)
- (27) FOFs 用米国株式 LS ファンド S(適格機関投資家専用)
- (28) 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)

- (29) 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)
- (30) FOFs 用 GBCA ファンド S (ミドルリスク型) (適格機関投資家専用)
- (31) 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)
- (32) 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)
- (33) MA Hedge Fund Strategies Limited

3.開示基準日

2024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	4.52
2	ソニーグループ	電気機器	2.85
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.30
4	キーエンス	電気機器	1.83
5	東京エレクトロン	電気機器	1.62
6	日立製作所	電気機器	1.56
7	日本電信電話	情報・通信業	1.53
8	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.48
9	三菱商事	卸売業	1.48
10	信越化学工業	化学	1.46

※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。

(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	8.65
2	ソニーグループ	電気機器	5.04
3	東京エレクトロン	電気機器	3.56
4	日立製作所	電気機器	2.94
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.66
6	任天堂	その他製品	2.35
7	リクルートホールディングス	サービス業	2.32
8	第一三共	医薬品	2.23
9	伊藤忠商事	卸売業	2.18
10	KDDI	情報・通信業	1.99

※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	ソニーグループ	電気機器	4.23
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3.42
3	トヨタ自動車	輸送用機器	3.34
4	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.98
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.62
6	日立製作所	電気機器	2.52
7	三菱商事	卸売業	2.11
8	アルバック	電気機器	1.65
9	本田技研工業	輸送用機器	1.60
10	日本製鉄	鉄鋼	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。

(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	6.43
2	信越化学工業	化学	5.10
3	アドバンテスト	電気機器	4.80
4	リクルートホールディングス	サービス業	4.62
5	ニトリホールディングス	小売業	4.50
6	日立製作所	電気機器	4.48
7	東京海上ホールディングス	保険業	4.39
8	カブコン	情報・通信業	4.38
9	味の素	食料品	4.28
10	ファーストリテイリング	小売業	3.90

※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。

(5) FOFs 用国内株式 EVI バリューストックファンド(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	5.46
2	日立製作所	電気機器	4.97
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4.88
4	ゆうちょ銀行	銀行業	4.17
5	三井不動産	不動産業	4.06
6	三菱商事	卸売業	4.05
7	スズキ	輸送用機器	3.30
8	日本製鉄	鉄鋼	2.93
9	アイシン	輸送用機器	2.64
10	日本郵政	サービス業	2.54

※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) 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	クーポン(%)	償還日	比率(%)
1	第164回利付国債(5年)	0.200	2028/12/20	16.94
2	第146回利付国債(20年)	1.700	2033/9/20	5.49
3	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	3.000	2056/2/04	4.20
4	第186回利付国債(20年)	1.500	2043/9/20	3.04
5	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	1.720	2079/6/06	2.56
6	第16回利付国債(40年)	1.300	2063/3/20	2.48
7	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	1.390	2076/2/10	2.23
8	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	1.200	-	2.19
9	第75回利付国債(30年)	1.300	2052/6/20	2.03
10	第55回利付国債(30年)	0.800	2047/6/20	1.87

※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) 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	クーポン(%)	償還日	比率(%)
1	第456回利付国債2年	0.100	2026/1/1	11.80
2	第361回利付国債10年	0.100	2030/12/20	6.19
3	第80回利付国債30年	1.800	2053/9/20	3.81
4	第185回利付国債20年	1.100	2043/6/20	3.54
5	第2回ビューリック無担保社債(劣後特約付)	1.280	2025/7/2	2.67
6	第15回みずほフィナンシャルグループ無担保永久社債(劣後特約付)	1.785	2028/12/15	2.33
7	第1回商船三井無担保社債(劣後特約付)	1.600	2026/4/27	2.04
8	第3回野村ホールディングス無担保永久社債(劣後特約付)	1.300	2026/7/15	2.01
9	第2回パナソニック無担保社債(劣後特約付)	0.885	2028/10/14	1.97
10	第81回利付国債30年	1.600	2053/12/20	1.72

※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。

(8) ニッセイ国内債券アクティブプラス(FOFs用)(適格機関投資家専用)

ニッセイ国内債券アクティブプラス(FOFs用)(適格機関投資家専用)	100.00%
ニッセイ国内債券アクティブプラス(金利戦略型)マザーファンド	49.82%
ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンド	50.18%

※純資産総額に対する比率で表示しています。

○ニッセイ国内債券アクティブプラス(金利戦略型)マザーファンド

	銘柄	クーポン(%)	償還日	比率(%)
1	第163回 利付国債(5年)	0.400	2028/9/20	8.84
2	第367回 利付国債(10年)	0.200	2032/6/20	7.72
3	第150回 利付国債(5年)	0.005	2026/12/20	6.85
4	第363回 利付国債(10年)	0.100	2031/6/20	6.68
5	第186回 利付国債(20年)	1.500	2043/9/20	6.60
6	第356回 利付国債(10年)	0.100	2029/9/20	5.43
7	第360回 利付国債(10年)	0.100	2030/9/20	4.58
8	第159回 利付国債(20年)	0.600	2036/12/20	4.19
9	第156回 利付国債(5年)	0.200	2027/12/20	4.12
10	第154回 利付国債(5年)	0.100	2027/9/20	4.11

※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。

○ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンド

	銘柄	クーポン(%)	償還日	比率(%)
1	第366回 利付国債(10年)	0.200	2032/3/20	3.64
2	第358回 利付国債(10年)	0.100	2030/3/20	3.48
3	第173回 利付国債(20年)	0.400	2040/6/20	1.75
4	第149回 利付国債(20年)	1.500	2034/6/20	1.73
5	第170回 利付国債(20年)	0.300	2039/9/20	1.58
6	第166回 利付国債(20年)	0.700	2038/9/20	1.49
7	第364回 利付国債(10年)	0.100	2031/9/20	1.41
8	第176回 利付国債(20年)	0.500	2041/3/20	1.38
9	第153回 利付国債(20年)	1.300	2035/6/20	1.31
10	第162回 利付国債(20年)	0.600	2037/9/20	1.22

※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) SMDAM 日本債券ファンド(適格機関投資家専用)

	銘柄	クーポン(%)	償還日	比率(%)
1	455 2 年国債	0.005	2025/12/1	15.32
2	162 5 年国債	0.300	2028/9/20	4.55
3	372 10 年国債	0.800	2033/9/20	4.06
4	186 20 年国債	1.500	2043/9/20	3.91
5	456 2 年国債	0.100	2026/1/1	3.54
6	80 30 年国債	1.800	2053/9/20	2.80
7	373 10 年国債	0.600	2033/12/20	1.59
8	453 2 年国債	0.005	2025/10/1	1.22
9	166 20 年国債	0.700	2038/9/20	1.18
10	78 30 年国債	1.400	2053/3/20	1.07

※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。

(10) 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	国	業種	比率(%)
1	APPLE INC	米国	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.03
2	MICROSOFT CORP	米国	ソフトウェア・サービス	4.93
3	NVIDIA CORP	米国	半導体・半導体製造装置	2.65
4	AMAZON.COM	米国	一般消費財・サービス流通・小売り	2.53
5	ALPHABET INC-CL A	米国	メディア・娯楽	1.54
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	米国	メディア・娯楽	1.52
7	ALPHABET INC-CL C	米国	メディア・娯楽	1.37
8	TESLA INC	米国	自動車・自動車部品	0.94
9	BROADCOM INC	米国	半導体・半導体製造装置	0.92
10	ELI LILLY & CO	米国	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.89

※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。

(11) 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	国	業種	比率(%)
1	MICROSOFT CORP	米国	ソフトウェア・サービス	9.57
2	NVIDIA CORP	米国	半導体・半導体製造装置	5.15
3	ALPHABET INC-CL A	米国	メディア・娯楽	2.98
4	ALPHABET INC-CL C	米国	メディア・娯楽	2.65
5	TESLA INC	米国	自動車・自動車部品	1.82
6	ELI LILLY & CO	米国	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.73
7	VISA INC-CLASS A SHARES	米国	金融サービス	1.48
8	JOHNSON & JOHNSON	米国	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.27
9	MASTERCARD INC-CLASS A	米国	金融サービス	1.24
10	PROCTER & GAMBLE CO	米国	家庭用品・パーソナル用品	1.23

※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) 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	8.35
2	SAP SE	ドイツ	ユーロ	情報技術	6.48
3	ACCENTURE PLC-CL A	米国	米ドル	情報技術	6.09
4	VISA INC-CLASS A SHARES	米国	米ドル	金融	5.82
5	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	米国	米ドル	生活必需品	4.87
6	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	英国	英ポンド	生活必需品	4.36
7	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	米国	米ドル	金融	4.12
8	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	米国	米ドル	ヘルスケア	3.52
9	BECTON DICKINSON AND CO	米国	米ドル	ヘルスケア	3.37
10	ABBOTT LABORATORIES	米国	米ドル	ヘルスケア	3.35

※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) 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・地域	通貨	業種	比率(%)
1	サンゴバン	フランス	ユーロ	資本財・サービス	2.96
2	エアキャップ・ホールディングス	アイルランド	米ドル	資本財・サービス	2.95
3	BNP パリバ	フランス	ユーロ	金融	2.88
4	CVS ヘルス	米国	米ドル	ヘルスケア	2.56
5	FMC	米国	米ドル	素材	2.47
6	シティグループ	米国	米ドル	金融	2.26
7	サンタンデール銀行	スペイン	ユーロ	金融	2.25
8	デルタ航空	米国	米ドル	資本財・サービス	2.19
9	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	2.13
10	台湾積体回路製造(TSMC)	台湾	米ドル	情報技術	2.10

※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。

(14) ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)

	銘柄	国・地域	通貨	業種	比率(%)
1	META PLATFORMS INC-A	米国	米ドル	コミュニケーション・サービス	6.34
2	MICROSOFT CORP	米国	米ドル	情報技術	5.92
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	台湾	米ドル	情報技術	5.52
4	ALPHABET INC-CL C	米国	米ドル	コミュニケーション・サービス	5.00
5	SAMSUNG ELECTRONICS-GDR 144A	韓国	米ドル	情報技術	4.61
6	APPLE INC	米国	米ドル	情報技術	3.81
7	HCA HEALTHCARE INC	米国	米ドル	ヘルスケア	3.73
8	ELEVANCE HEALTH, INC	米国	米ドル	ヘルスケア	3.02
9	BNP PARIBAS	フランス	ユーロ	金融	2.91
10	UNITEDHEALTH GROUP INC	米国	米ドル	ヘルスケア	2.88

※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。

(15) 世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)

	銘柄	国・地域	通貨	業種	比率(%)
1	MICROSOFT CORP	米国	米ドル	情報技術	8.08
2	NVIDIA CORP	米国	米ドル	情報技術	4.99
3	META PLATFORMS INC-CLASS A	米国	米ドル	コミュニケーション・サービス	3.82
4	NETFLIX INC	米国	米ドル	コミュニケーション・サービス	3.66
5	ABBOTT LABORATORIES	米国	米ドル	ヘルスケア	3.10
6	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	台湾	米ドル	情報技術	3.08
7	BROADCOM INC	米国	米ドル	情報技術	2.83
8	COMPASS GROUP PLC	英国	英ポンド	一般消費財・サービス	2.83
9	ACCENTURE PLC-CL A	アイルランド	米ドル	情報技術	2.73
10	CENCORA INC	米国	米ドル	ヘルスケア	2.70

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

	銘柄	国・地域	通貨	業種	比率(%)
1	MICROSOFT CORP.	米国	米ドル	情報技術	6.77
2	BROADCOM INC.	米国	米ドル	情報技術	6.49
3	ALPHABET INC.	米国	米ドル	コミュニケーション・サービス	3.01
4	AMAZON.COM, INC.	米国	米ドル	一般消費財・サービス	2.41
5	UNITEDHEALTH GROUP INC.	米国	米ドル	ヘルスケア	2.38
6	META PLATFORMS, INC.	米国	米ドル	コミュニケーション・サービス	2.37
7	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO., LTD.	台湾	米ドル	情報技術	2.25
8	NVIDIA CORP.	米国	米ドル	情報技術	2.11
9	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC.	米国	米ドル	ヘルスケア	2.03
10	ELI LILLY AND CO.	米国	米ドル	ヘルスケア	1.95

※純資産総額に対する比率で表示しています。

(17) FOFs 用世界債券総合インデックス・ファンド S(適格機関投資家専用)

	銘柄	通貨	クーポン(%)	比率(%)
1	ISHARES MBS ETF	米ドル	-	13.16
2	T 0.25% 10/31/25	米ドル	0.250	0.41
3	T 3.5% 09/15/25	米ドル	3.500	0.39
4	T 0.875% 09/30/26	米ドル	0.875	0.36
5	T 1.25% 04/30/28	米ドル	1.250	0.35
6	T 1.25% 08/15/31	米ドル	1.250	0.34
7	T 2.25% 11/15/27	米ドル	2.250	0.34
8	T 2.25% 11/15/25	米ドル	2.250	0.31
9	T 0.25% 06/30/25	米ドル	0.250	0.31
10	CGB 4.08% 10/22/48	中国元	4.080	0.29

※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。

※「ISHARES MBS ETF」は、ブルームバーグ米国 MBS インデックスに連動した投資成果を目指す上場投資信託(ETF)です。

(18)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	種類	通貨	クーポン(%)	償還日	比率(%)
1	ドイツ国債	国債	ユーロ	2.300	2033/2/15	7.00
2	米国国債	国債	米ドル	4.000	2028/2/29	5.37
3	米国国債	国債	米ドル	4.000	2030/2/28	4.62
4	米国国債	国債	米ドル	4.125	2032/11/15	2.73
5	英国国債	国債	英ポンド	0.875	2033/7/31	2.68
6	米国国債	国債	米ドル	3.875	2033/8/15	2.45
7	UMBS	モーゲージ債	米ドル	3.000	2054/2/01	2.29
8	中国国債	国債	中国元	2.800	2032/11/15	2.28
9	米国国債	国債	米ドル	4.625	2028/9/30	2.08
10	ジニーメイ	モーゲージ債	米ドル	3.500	2054/2/01	1.97

※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 用新興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	国・地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾	半導体・半導体製造装置	7.11
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.74
3	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	メディア・娯楽	3.29
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	ケイマン島	一般消費財・サービス流通・小売り	2.09
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	エネルギー	1.47
6	PDD HOLDINGS INC-ADR	ケイマン島	一般消費財・サービス流通・小売り	1.06
7	INFOSYS LTD	インド	ソフトウェア・サービス	0.93
8	ICICI BANK LTD	インド	銀行	0.91
9	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	銀行	0.78
10	SK HYNIX INC	韓国	半導体・半導体製造装置	0.78

※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。

(20) 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	通貨	クーポン(%)	償還日	比率(%)
1	米国国債	米ドル	0.375	2026/1/31	7.95
2	米国国債	米ドル	0.375	2024/8/15	4.01
3	WA CHINA BOND	中国元	-	-	3.65
4	米国国債	米ドル	2.625	2027/5/31	2.59
5	米国国債	米ドル	0.750	2026/4/30	2.53
6	メキシコ国債	メキシコ・ペソ	7.750	2042/11/13	2.51
7	米国国債	米ドル	1.375	2050/8/15	2.45
8	米国国債	米ドル	1.375	2033/7/15	2.12
9	ドイツ国債	ユーロ	1.700	2032/8/15	1.76
10	米国国債	米ドル	0.375	2025/12/31	1.67

※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 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	6.55
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	オフィス	5.47
3	野村不動産マスターファンド投資法人	オフィス	4.91
4	日本都市ファンド投資法人	商業・物流等	4.52
5	KDX不動産投資法人	オフィス	4.34
6	日本プロロジスリート投資法人	商業・物流等	4.30
7	GLP投資法人	商業・物流等	4.19
8	大和ハウスリート投資法人	商業・物流等	3.70
9	オリックス不動産投資法人	オフィス	3.20
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	商業・物流等	3.14

※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	8.75
2	EQUINIX INC	米国	5.91
3	WELLTOWER INC	米国	3.60
4	REALTY INCOME CORP	米国	3.44
5	SIMON PROPERTY GROUP	米国	3.40
6	PUBLIC STORAGE	米国	3.38
7	DIGITAL REALTY TRUST INC	米国	3.27
8	VICI PROPERTIES INC	米国	2.34
9	EXTRA SPACE STORAGE INC	米国	2.30
10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	2.15

※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) 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 10/24/24	米ドル	45.10
2	SG ISSUER 037 12/30/24	米ドル	13.51
3	SG ISSUER 036 10/31/24	米ドル	11.40
4	SG ISSUER 033 03/28/24	米ドル	10.18
5	SG ISSUER 035 08/30/24	米ドル	9.14
6	BAR USD COM 041 05/31/24	米ドル	3.76
7	IPATH DOW COMM 06/12/36	米ドル	2.56
8	ETFS ALL COMMODITIES	米ドル	2.39

※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。

(24) 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	44.82
2	SPDR GOLD MINISHARES TRUST-ETF	米ドル	44.34
3	ISHARES GOLD TRUST MICRO-ETF	米ドル	7.12
4	SPDR GOLD TRUST-ETF	米ドル	3.71

※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。

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

	銘柄	国	セクター	比率(%)
1	MBONO 5 1/2 03/04/27	メキシコ	国債	5.00
2	MEX 4 03/15/2115	メキシコ	国債	2.17
3	GGB 4 3/8 07/18/38	ギリシャ	国債	1.76
4	V 1 1/2 06/15/26	米国	テクノロジー	1.65
5	ICEGB 4 1/2 02/17/42	アイスランド	国債	1.63
6	CZGB 2 3/4 07/23/29	チェコ	国債	1.48
7	SAGB 8 7/8 02/28/35 #2035	南アフリカ	国債	1.45
8	ISRAEL 0 5/8 01/32 REGS	イスラエル	国債	1.33
9	BNP 1 3/8 05/29 REGS	フランス	銀行	1.21
10	POLAND 3 5/8 01/34 REGS	ポーランド	国債	1.20

※純資産総額に対する比率で表示しています。

(26) 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	Vivendi Se	Equity	2.09
2	Vietnam (Rep Of) 4.8% 19.11.2024 'Regs' Sr	Fixed Income	1.33
3	Rio Tinto Plc	Equity	1.27
4	Relx Plc	Equity	1.21
5	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co, LTD.	Equity	1.20
6	Publicis Groupe	Equity	1.16
7	Microsoft Corp	Equity	1.11
8	Visa Inc-Class A Shares	Equity	1.10
9	Jet2 Plc	Equity	1.03
10	Crh Plc	Equity	0.99

※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。

(27) 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	96.72

※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) 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	通貨	比率(%)
1	STAR HELIOS 0% 07/16/24	日本円	89.60
2	ソシエテ・ジェネラル 0% 2024/05/31	日本円	9.58

※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。

(29) 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	通貨	比率(%)
1	STAR HELIOS 0% 10/18/24	日本円	98.52

※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) FOFs 用 GBCA ファンド S(ミドルリスク型) (適格機関投資家専用)

○ロング

	銘柄	比率(%)
1	長期国債標準物先物 2403	45.51
2	第1152回国庫短期証券	35.14
3	第1189回国庫短期証券	10.04
4	第1145回国庫短期証券	8.53
5	第1183回国庫短期証券	5.02

○ショート

	銘柄	比率(%)
1	EURO-BUND 2403	-48.82
2	LONG GILT FU 2403	-46.39
3	US 10YR NOTE 2403	-1.41

※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。

(31) 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	2.70
2	ユニ・チャーム	化学	2.19
3	信越化学工業	化学	1.88
4	KDDI	情報・通信業	1.86
5	ファーストリテイリング	小売業	1.83
6	GMOペイメントゲートウェイ	情報・通信業	1.80
7	キーエンス	電気機器	1.72
8	日立製作所	電気機器	1.58
9	エムスリー	サービス業	1.48
10	東京海上ホールディングス	保険業	1.39

※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。

(32)ウエスタン・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1198回国庫短期証券	0.000	2024/3/11	16.59
2	第1192回国庫短期証券	0.000	2024/2/13	15.48
3	第1203回国庫短期証券	0.000	2024/4/4	12.16
4	第1201回国庫短期証券	0.000	2024/3/25	9.73
5	第1197回国庫短期証券	0.000	2024/3/4	9.47

※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。

(33)MA Hedge Fund Strategies Limited

	銘柄	比率(%)
1	スブランク	8.97
2	パイオニア・ナチュラル・リソーシズ	8.68
3	ヘス	5.83
4	クリスチャン・ハンセン・ホールディング	4.23
5	カルナ・セラピューティクス	2.80

※純資産総額に対する比率で表示しています。

以上