

2022年9月28日

お客様各位

キャピタル アセットマネジメント株式会社

『オーケストラ ファンド (安定コース)』『オーケストラ ファンド (成長コース)』の
組入ファンドの保有明細開示について

弊社が設定、運用する下記のファンド・オブ・ファンズにつきまして、一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第22条第4項に基づき、組入ファンドの保有明細開示を下記のとおりご報告いたします。

記

1. 対象ファンド・オブ・ファンズ

- (1) オーケストラ ファンド (安定コース)
- (2) オーケストラ ファンド (成長コース)

2. 開示対象の組入れファンド

- (1) コムジェスト世界株式ファンド (適格機関投資家限定)
- (2) デイメンショナル・ファンズ・PLC-グローバル・ターゲットィッド・バリュー・ファンド
JPY アキュムレーション シェアーズ
- (3) ラザード・グローバル・インベスメント・ファンズ・PLC-ラザード・ラスモア・
オルタナティブ・ファンド (C Acc USD)
- (4) MFS メリディアン・ファンズ-プルードント・キャピタル・ファンド (i1 USD)
- (5) ノムラ・ファンズ・アイルランド-グローバル・ダイナミック・ボンド・ファンド-
I JPY ヘッジドクラス
- (6) システムティック・グローバル・マクロ戦略ファンド F (適格機関投資家専用)
- (7) MontLake コリブ UCITS プラットフォーム ICAV -ABR ダイナミック・ブレンド
エクイティ & ボラティリティ・ファンド I クラス
- (8) マン・アンブレラ・SICAV -マン・AHL・アルファコア・オルタナティブ-
日本円クラス (ヘッジ付)

3. 開示基準日

2022年6月末日基準 (1 ファンド ※2021年12月末基準)

4. 保有銘柄明細

(1) コムジェスト世界株式ファンド（適格機関投資家限定）

	銘柄名	業種	国	比率
1	イーライリリー	ヘルスケア	米国	6.2%
2	マイクロソフト	情報技術	米国	5.7%
3	アルファベット	コミュニケーション・サービス	米国	4.5%
4	インテュイット	情報技術	米国	4.3%
5	ジョンソン・エンド・ジョンソン	ヘルスケア	米国	3.9%
6	ロREAL	生活必需品	フランス	3.3%
7	インナ・モンゴル・イーリー・インダストリアル・グループ (内蒙古伊利実業集団)	生活必需品	中国	3.3%
8	台湾セミコンダクター (TSMC)	情報技術	台湾	3.2%
9	LVMH モエ・ヘネシー・ルイ・ヴィトン	一般消費財・サービス	フランス	3.1%
10	HDFC	金融	インド	3.0%

(2) デイメンショナル・ファンズ・PLC - グローバル・ターゲットィッド・バリュー・ファンド JPY アキュムレーション シェアーズ

	銘柄名	業種	国	比率
1	M&T バンク	金融	米国	0.53%
2	ダラー ツリー	一般消費財・サービス	米国	0.47%
3	クレスト ダイアグノスティクス	ヘルスケア	米国	0.41%
4	レナー	一般消費財・サービス	米国	0.39%
5	ダイヤモンドバック エナジー	エネルギー	米国	0.38%
6	モザイク	素材	米国	0.36%
7	マラソン オイル	エネルギー	米国	0.36%
8	プリンシパル ファイナンシャル グループ	金融	米国	0.35%
9	ハートフォード ファイナンシャル サービスズ グループ	金融	米国	0.35%
10	リージョンズ ファイナンシャル	金融	米国	0.35%

(3) ラザード・グローバル・インベスメント・ファンズ・PLC - ラザード・ラスモア・ オルタナティブ・ファンド (C Acc USD)

	銘柄名	クーポン	償還日	比率
1	ハーバーライフ・ニュートリション	2.625%	2024/03/15	1.90%
2	ニューベイシブ	1.000%	2023/06/01	1.72%

3	OSI システム	1.250%	2022/09/01	1.39%
4	PRA グループ	3.500%	2023/06/01	1.39%
5	バーリントン・ストアーズ	2.250%	2025/04/15	1.34%
6	アーバー・リアルティ・トラスト	4.750%	2022/11/01	1.32%
7	リバティ・メディア	2.750%	2049/12/01	1.28%
8	NCL コープ	5.375%	2025/08/01	1.23%
9	エンリアン キャピタル	0.000%	2025/02/05	1.23%
10	アメリカン航空グループ	6.500%	2025/07/01	1.20%

(4) MFS メリディアン・ファンズ-プルデント・キャピタル・ファンド(i1 USD)

	銘柄名	クーポン	償還日/業種	比率
1	米国国債	1.375%	2023/09/30	6.40%
2	米国国債	2.625%	2023/12/31	5.59%
3	米国国債	1.375%	2023/06/30	5.51%
4	米国国債	0.500%	2023/03/15	5.46%
5	米国国債	1.625%	2022/12/15	5.20%
6	アルファベット Class A		コミュニケーション・サービス	3.86%
7	LEG インモビリエン		不動産	3.29%
8	米国国債	2.250%	2024/03/31	2.25%
9	ヴォノヴィア		不動産	2.20%
10	ヴォルタース・クルーワー		資本財・サービス	2.16%

(5) ノムラ・ファンズ・アイルランド-グローバル・ダイナミック・ボンド・ファンド-IJPY ヘッジドクラス

	銘柄名	クーポン	償還日	比率
1	米国国債	2.875%	2032/05/15	9.02%
2	米国国債	2.375%	2029/03/31	7.88%
3	米国国債	2.875%	2052/05/15	5.62%
4	米国国債	3.250%	2042/05/15	5.16%
5	米国国債	2.750%	2027/04/30	3.23%
6	英国国債	1.250%	2051/07/31	2.65%
7	米国国債	2.750%	2025/05/15	2.41%
8	南アフリカ共和国国債	9.000%	2040/01/31	1.93%
9	南アフリカ共和国国債	8.875%	2035/02/28	1.83%
10	スペイン国債	1.000%	2052/04/12	1.74%

(6) システマティック・グローバル・マクロ戦略ファンド F (適格機関投資家専用)

	銘柄名	クーポン	償還日	比率
1	第360回利付国債(10年債)	0.1%	2030/09/20	37.32%
2	第362回利付国債(10年債)	0.1%	2031/03/20	31.06%
3	先物長期国債 2209 限月			-43.63%
4	GILTS 先物 2209 GBP			7.45%
5	BUNDS 先物 2209 EUR			7.04%
6	T-NOTE 先物 2209 USD			6.74%
7	TOPIX 先物 2209			6.28%
8	DAX30 先物 2209 EUR			5.83%
9	SPE MINI 先物 2209 USD			2.19%
10	DJIIVMN 先物 2209 USD			1.33%

(7) MontLake コリブ UCITS プラットフォーム ICAV -ABR ダイナミック・ブレンド
 エクイティ & ボラティリティ・ファンド I クラス

※ 2021年12月末基準

	銘柄名	クーポン	償還日	比率
1	米国国債	0%	2022/06/16	7.02%
2	米国国債	0%	2022/03/24	6.87%
3	米国国債	0%	2022/04/21	6.87%
4	米国国債	0%	2022/05/19	6.72%
5	米国国債	0%	2022/07/14	6.71%
6	米国国債	0%	2022/09/08	6.71%
7	米国国債	0%	2022/10/06	6.71%
8	米国国債	0%	2022/08/11	6.51%
9	米国国債	0%	2022/01/27	6.36%
10	米国国債	0%	2022/02/24	6.36%

(8) マン・アンブレラ・SICAV -マン・AHL・アルファコア・オルタナティブ-
 日本円クラス (ヘッジ付)

	銘柄名	クーポン	償還日	比率
1	Euro-BTP 先物 2209			-12.76%
2	米国国債	0%	2022/8/18	12.62%
3	米国国債	0%	2022/8/25	12.61%
4	GILT 先物 2209			-9.96%
5	カナダ10年国債先物 2209			-9.89%

6	豪州 10 年国債先物 2209			-9.65%
7	米国国債	0%	2022/8/11	9.47%
8	米国国債	0%	2022/10/20	9.42%
9	EURO-BUXL 30 年国債先物 2209			-7.96%
10	韓国 10 年国債先物 2209			-6.84%

* 経済的エクスポージャー絶対値順