

2023年3月16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・バリュアー・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)
- (9) SPDR ポートフォリオ米国物価連動国債 ETF

3. 開示基準日

2022年12月末日基準

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	国別	比率
1	イーライリリー	ヘルスケア	米国	5.95%
2	マイクロソフト	情報技術	米国	4.90%
3	ジョンソン・エンド・ジョンソン	ヘルスケア	米国	4.74%
4	エシロールルックスオティカ	ヘルスケア	フランス	4.28%
5	リンデ	素材	イギリス	4.06%
6	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	3.86%
7	ASML ホールディング	情報技術	オランダ	3.72%
8	HDFC	金融	インド	3.66%
9	ロレアル	生活必需品	フランス	3.61%
10	台湾セミコンダクター（TSMC）	情報技術	台湾	3.53%

(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・バリュアー・ファンド

JPY アキュムレーション シェアーズ

	銘柄名	業種	国別	比率
1	ダイヤモンドバック エナジー	エネルギー	米国	0.53%
2	ヒューレット・パッカード・エンタープライズ	情報技術	米国	0.48%
3	レナー	一般消費財・サービス	米国	0.48%
4	マラソン・オイル	エネルギー	米国	0.47%
5	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	0.46%
6	アーチ・キャピタル・グループ	金融	米国	0.46%
7	ハンチントン・バンクシェアーズ	金融	米国	0.44%
8	リージョンズ・ファイナンシャル	金融	米国	0.43%
9	フィフス・サード・バンコープ	金融	米国	0.42%
10	シチズンズ・ファイナンシャル・グループ	金融	米国	0.42%

(3) ラザード・グローバル・インベストメント・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	ニューベイシブ	1.000%	2023/06/01	1.68%
2	NCL コープ	5.375%	2025/08/01	1.62%
3	PRA グループ	3.500%	2023/06/01	1.58%
4	リバティ・メディア	2.750%	2049/12/01	1.49%
5	シネマーク・ホールディングス	4.500%	2025/08/15	1.40%

6	モンゴ DB	0.250%	2026/01/15	1.23%
7	アメリカン航空グループ	6.500%	2025/07/01	1.18%
8	ロイヤル・カリビアン・クルーズ	6.000%	2025/08/15	1.14%
9	シー	2.375%	2025/12/01	1.13%
10	エンリアン・キャピタル	0.000%	2025/02/05	1.09%

(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)

	銘柄名	クーポン	償還日/業種	比率
1	米国国債	1.375%	2023/09/30	3.64%
2	米国国債	0.500%	2023/03/15	3.63%
3	米国国債	1.375%	2023/06/30	3.61%
4	米国国債	2.625%	2023/12/31	3.58%
5	米国国債	2.250%	2024/03/31	3.47%
6	LEG インモビリエン		不動産	3.31%
7	アルファベット Class A		コミュニケーション・サービス	3.18%
8	米国国債	0.500%	2024/04/15	3.13%
9	iシェアーズ・フィジカル・ゴールド ETC ETF		素材	2.32%
10	米国国債	0.125%	2027/04/15	2.14%

(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	7.04%
2	米国国債	3.250%	2042/05/15	6.04%
3	米国国債	2.375%	2029/03/31	5.91%
4	南アフリカ共和国国債	9.000%	2040/01/31	2.56%
5	米国国債	0.000%	2023/01/24	2.29%
6	米国国債	4.125%	2027/10/31	1.92%
7	南アフリカ共和国国債	8.875%	2035/02/28	1.90%
8	(スペイン) イベルカハ・バンク金融債	7.000%	永久債	1.51%
9	英国国債	6.250%	2051/01/25	1.43%
10	英国国債	5.450%	2032/09/16	1.40%

(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	先物長期国債 2303 限月			-62.51%
2	第362回利付国債(10年債)	0.1%	2031/03/20	39.27%

3	第360回利付国債(10年債)	0.1%	2030/09/20	23.18%
4	BUNDS先物 2303 EUR			-7.24%
5	T-NOTE先物 2303 USD			-6.77%
6	GILTS先物 2303 GBP			-2.29%
7	NASDAQミニ先物 2303 USD			-1.40%
8	日経平均225先物 2303 JPY			1.25%
9	FT100先物 2303 GBP			0.29%

*金融エクスポージャー絶対値順

(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
 エクイティ & ボラティリティ・ファンド I クラス

	銘柄名	クーポン	償還日	比率
1	米国国債	0%	2023/05/18	9.01%
2	米国国債	0%	2023/09/07	8.50%
3	米国国債	0%	2023/08/10	7.87%
4	米国国債	0%	2023/10/05	7.82%
5	米国国債	0%	2023/03/23	7.08%
6	米国国債	0%	2023/02/23	6.97%
7	米国国債	0%	2023/04/20	6.92%
8	米国国債	0%	2023/06/15	6.87%
9	米国国債	0%	2023/07/13	6.85%
10	米国国債	0%	2023/01/26	6.72%

(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	メキシコペソ/米ドル			17.71%
2	ユーロ/米ドル			11.86%
3	スイスフラン/米ドル			-11.13%
4	イタリア10年国債	6%	2023/03/10	-10.85%
5	ユーロ/ポーランドズロチ			-9.16%
6	ニュージーランドドル/米ドル			8.63%
7	イスラエルシェケル/米ドル			-8.29%
8	ポーランドズロチ/米ドル			8.22%
9	シンガポールドル/米ドル			7.68%
10	英国10年国債	4%	2023/03/31	-7.64%

*金融エクスポージャー絶対値順

(9) SPDR ポートフォリオ米国物価連動国債 ETF

	銘柄名	クーポン	償還日	比率
1	米国国債（物価連動）	2.000%	2026/01/15	0.15%
2	米国国債（物価連動）	3.875%	2029/04/15	0.15%
3	米国国債（物価連動）	2.375%	2025/01/15	0.15%
4	米国国債（物価連動）	2.500%	2029/01/15	0.15%
5	米国国債（物価連動）	0.625%	2026/01/15	0.15%
6	米国国債（物価連動）	3.375%	2032/04/15	0.15%
7	米国国債（物価連動）	0.125%	2030/07/15	0.15%
8	米国国債（物価連動）	0.375%	2025/07/15	0.15%
9	米国国債（物価連動）	0.875%	2029/01/15	0.15%
10	米国国債（物価連動）	1.375%	2044/02/15	0.15%