

2024年9月13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

- 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)

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)
- (4) MFS メリディアン・ファンズ - プルーデント・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 - IJPY  
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) アムンディ・オルタナティブ・ファンズ・PLC - アムンディ・サンドラー・US エクイティ・  
ファンド - クラス I USD
- (10) アムンディ・オルタナティブ・ファンズ・PLC - アムンディ・サンドラー・US エクイティ・  
ファンド - クラス I JPY
- (11) アムンディ・オルタナティブ・ファンズ・PLC - アムンディ・ティーダーマン・アービトラ

ーシ戦略ファンド - クラス I USD

(12) アムンディ・オルタナティブ・ファンズ・PLC-アムンディ・ティーダーマン・アービトラ  
ーシ戦略ファンド - クラス I JPY

(13) SPDR ポートフォリオ米国物価連動国債 ETF

### 3. 開示基準日

2024年6月末日基準

(2ファンド \*2024年4月末 \*\*2023年12月末)

### 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	MSCI 業種分類	国	比率
1	イーライリリー	ヘルスケア	アメリカ	8.10%
2	マイクロソフト	情報技術	アメリカ	7.49%
3	ASML ホールディング	情報技術	オランダ	6.27%
4	台湾セミコンダクター (TSMC)	情報技術	台湾	5.14%
5	インテュイット	情報技術	アメリカ	4.23%
6	リンデ	素材	イギリス	4.06%
7	エシロールルックスオティカ	ヘルスケア	フランス	3.51%
8	エクスペリアン	資本財・サービス	イギリス	3.43%
9	ビザ	金融	アメリカ	3.42%
10	ジョンソン・エンド・ジョンソン	ヘルスケア	アメリカ	3.37%

※国別は Comgest S.A.による分類に基づいています。

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

	Top 10 Names	Country	Sector	Weight
1	PulteGroup Inc	United States	Consumer Discretionary	0.57%
2	Hewlett Packard Enterprise Co	United States	Information Technology	0.55%
3	Hartford Financial Services Group Inc/The	United States	Financials	0.50%
4	M&T Bank Corp	United States	Financials	0.47%
5	First Citizens BancShares Inc/NC	United States	Financials	0.46%
6	Fifth Third Bancorp	United States	Financials	0.46%
7	International Flavors & Fragrances Inc	United States	Materials	0.46%
8	Steel Dynamics Inc	United States	Materials	0.44%

9	State Street Corp	United States	Financials	0.43%
10	Devon Energy Corp	United States	Energy	0.43%

(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)

	Top Positions NMV	Coupon	Maturity Date	NMV%
1	PEGA 0.75%	0.75%	2025/3/1	2.77%
2	LMCA / SIRI 2.75%	2.75%	2049/12/1	2.59%
3	SQ 0.125%	0.125%	2025/3/1	2.31%
4	SHOPCN 0.125%	0.125%	2025/11/1	2.28%
5	MTCH 0.875%	0.875%	2026/6/15	2.24%
6	DOCN 0%	0%	2026/12/1	2.04%
7	GOLLBZ DIP	—	2025/1/27	1.98%
8	ABRAGF 11.5%	11.5%	2028/3/2	1.98%
9	W 0.625%	0.625%	2025/10/1	1.94%
10	JAZZ 1.5%	1.5%	2024/8/15	1.86%

(4) MFS メリディアン・ファンズ - プルーデント・キャピタル・ファンド(I1 USD)

①株式保有上位 10 銘柄

	銘柄名	業種 (※1)	国	比率 (%)
1	Alphabet Inc Class A	コミュニケーション・サービス	米国	3.65
2	Samsung Electronics Co Ltd	情報技術	韓国	3.58
3	iShares Physical Gold ETC ETF	その他	アイルランド	3.48
4	Amadeus IT Group SA	一般消費財・サービス	スペイン	3.03
5	Booking Holdings Inc	一般消費財・サービス	米国	2.63
6	Euronext NV	金融	フランス	2.49
7	LEG Immobilien SE	不動産	ドイツ	2.44
8	Edenred SE	金融	フランス	2.33
9	Knorr-Bremse AG	資本財・サービス	ドイツ	2.31
10	Heineken Holding NV	生活必需品	オランダ	2.20

※1 株式の業種は GICS11 業種です。ETF はその他に分類しています。

②社債保有上位 10 銘柄

	銘柄名	クーポン	償還日	比率 (%)
1	Standard Industries Inc/NJ 144A	3.375%	2031/1/15	0.57
2	Ginnie Mae II	5.500%	2053/2/20	0.53
3	IAMGOLD Corp 144A	5.750%	2028/10/15	0.52
4	Arches Buyer Inc 144A	6.125%	2028/12/1	0.52

5	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	5.804%	2029/3/25	0.50
6	Thermo Fisher Scientific Inc	1.215%	2024/10/18	0.49
7	Global Aircraft Leasing Co Ltd 144A	6.500%	2024/9/15	0.48
8	Foundation Building Materials Inc 144A	6.000%	2029/3/1	0.46
9	Clearway Energy Operating LLC 144A	4.750%	2028/3/15	0.45
10	Venture Global LNG Inc 144A	8.375%	2031/6/1	0.45

(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	債券種別	通貨	国/地域	比率
1	MEX BONOS DES 8% 07/31/53/MXN/	国債	メキシコペソ	メキシコ	2.78%
2	US TREAS NTS 5% 08/31/25	国債	米ドル	アメリカ	2.25%
3	UNITED KINGDO 4% 10/22/63/GBP/	国債	英ポンド	イギリス	1.99%
4	MEX BONOS 7.75% 05/29/31/MXN/	国債	メキシコペソ	メキシコ	1.37%
5	STANDARD CHARTERED V/R /PERP/	金融債	米ドル	アメリカ	1.35%
6	BARCLAYS PLC V/R /PERP//GBP/	金融債	英ポンド	イギリス	1.34%
7	KINGDOM OF BHR 6.25% 01/25/51	国債	米ドル	アメリカ	1.32%
8	US TREAS NTS 4.125% 01/31/25	国債	米ドル	アメリカ	1.25%
9	BULGARIA 4.875% 05/13/36/EUR/	国債	ユーロ	ブルガリア	1.22%
10	REPUBLIC O 8.75% 01/31/44/ZAR/	国債	南アフリカランド	南アフリカ	1.11%

(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)

(\* 2024年4月末)

①現物資産上位 10 銘柄

	銘柄名	種類	通貨	国/地域	投資比率(%)
1	国庫債券 利付 (10年) 第364回	国債証券	日本円	日本	24.87
2	国庫債券 利付 (10年) 第365回	国債証券	日本円	日本	24.79
3	国庫債券 利付 (10年) 第363回	国債証券	日本円	日本	17.61

組入銘柄数 3 銘柄

②派生商品上位 10 銘柄

	銘柄名	買建/売建	通貨	国/地域	投資比率(%)
1	BUNDS 先物(2024年06月限)	買建	ユーロ	ドイツ	47.92
2	FT100 株価指数先物(2024年06月限)	売建	英ポンド	イギリス	△27.19
3	DAX 株価指数先物(2024年06月限)	買建	ユーロ	ドイツ	22.27
4	GILT 先物(2024年06月限)	買建	英ポンド	イギリス	21.72

5	T-NOTE 先物(10年)(2024年06月限)	売建	米ドル	アメリカ	△19.35
6	TOPIX 先物(2024年06月限)	買建	日本円	日本	16.73
7	E-mini S&P500 株価指数先物(2024年06月限)	売建	米ドル	アメリカ	△15.37
8	日経平均株価先物(2024年06月限)	買建	日本円	日本	9.37
9	長期国債先物(6%、10年)(2024年06月限)	売建	日本円	日本	△4.40
10	NASDAQMN 株価指数先物(2024年06月限)	買建	米ドル	アメリカ	1.71

組入銘柄数 11 銘柄

(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 (\*\*2023年12月末)

①Government Bonds

	Description	Coupon	Maturity Date	% of Net Assets
1	United States Treasury Bill	0.000%	08/08/2024	12.65%
2	United States Treasury Bill	0.000%	11/07/2024	12.46%
3	United States Treasury Bill	0.000%	05/09/2024	12.37%
4	United States Treasury Bill	0.000%	13/06/2024	12.01%
5	United States Treasury Bill	0.000%	31/10/2024	10.39%
6	United States Treasury Bill	0.000%	03/10/2024	10.19%
7	United States Treasury Bill	0.000%	16/05/2024	9.64%

②Futures Contracts

	Description	Coupon	Maturity Date	% of Net Assets
1	S&P500 eMini Future March 2024	-	-	1.79%
2	CBOE VIX Future January 2024	-	-	-0.05%
3	CBOE VIX Future February 2024	-	-	-0.02%

(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	種類	比率	L/S
1	日本円/米ドル	通貨	-21.21%	S
2	韓国ウォン/米ドル	通貨	-19.30%	S
3	シンガポールドル/米ドル	通貨	-14.57%	S
4	カナダドル/米ドル	通貨	-12.60%	S
5	中国元/米ドル (オンショアデリバブル)	通貨	-12.18%	S

6	韓国 10 年国債先物	金利/債券	10.21%	L
7	ユーロ/米ドル	通貨	-9.04%	S
8	スイスフラン/米ドル	通貨	-8.79%	S
9	ユーロ/英ポンド	通貨	-8.75%	S
10	英ポンド/米ドル	通貨	-8.63%	S

(9) (10) アムンディ・オルタナティブ・ファンズ・PLC -アムンディ・サンドラー・US エク  
イティ・ファンド - クラス I USD / クラス I JPY

	Security Name	Sector	Long/Short	Net Exposure
1	CLEAN HARBORS INC	INDUSTRIAL	Long	2.89%
2	S & P 500 INDEX P @ 4900 SEP 24	INDEX	Long	2.52%
3	RUSSELL 2000 INDEX C @ 2010 AUG 24	INDEX	Long	2.09%
4	QUALCOMM INC C @ 200 AUG 24	TECHNOLOGY	Long	1.64%
5	XYLEM INC	INDUSTRIAL	Long	1.40%
6	C_INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL USD	CONSUMER CYCLICAL	Long	1.32%
7	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	CONSUMER CYCLICAL	Long	1.22%
8	TKO GROUP HOLDINGS INC	CONSUMER CYCLICAL S	Long	1.13%
9	META PLATFORMS INC-CLASS A	COMMUNICATIONS	Long	1.13%
10	CAE INC	INDUSTRIAL	Long	0.90%

(11) (12) アムンディ・オルタナティブ・ファンズ・PLC -アムンディ・ティーダーマン・アー  
ビトラージ戦略ファンド - クラス I USD / クラス I JPY

	Security Name	Sector	Long/Short	Net Exposure
1	HIPGNOSIS SONGS FUND LTD	FINANCIAL	Long	8.35%
2	ENDEAVOR GROUP HOLD-CLASS A	COMMUNICATIONS	Long	5.69%
3	COVESTRO AG	BASIC MATERIALS	Long	4.85%
4	UNITED STATES STEEL CORP(NYS)	BASIC MATERIALS	Long	4.01%
5	HUBSPOT INC	TECHNOLOGY	Long	3.20%
6	HASHICORP INC-CL A	TECHNOLOGY	Long	3.12%
7	CATALENT INC	CONSUMER NON- CYCLICAL	Long	3.06%

8	C_KEYWORDS STUDIOS PLC	TECHNOLOGY	Long	3.05%
9	WESTROCK CO(NYS)	INDUSTRIAL	Long	2.98%
10	ANSYS INC(NSM)	TECHNOLOGY	Long	2.91%

(13) 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）	0.625%	2026/01/15	0.07%
2	米国国債（物価連動）	1.000%	2048/02/15	0.07%
3	米国国債（物価連動）	0.125%	2031/01/15	0.07%
4	米国国債（物価連動）	1.500%	2053/02/15	0.07%
5	米国国債（物価連動）	2.125%	2040/02/15	0.07%
6	米国国債（物価連動）	2.000%	2026/01/15	0.07%
7	米国国債（物価連動）	0.125%	2052/02/15	0.07%
8	米国国債（物価連動）	2.375%	2028/10/15	0.06%
9	米国国債（物価連動）	1.625%	2027/10/15	0.06%
10	米国国債（物価連動）	0.625%	2032/07/15	0.06%

以上