

2023年9月15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・ターゲティッド・バリュー・ファンド JPY
アキュムレーション シェアーズ
- (3) MFS メリディアン・ファンズ - ブルーデント・キャピタル・ファンド (I1 USD)
- (4) 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)
- (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) リクソー・ニューシッツ・IRL・PLC - リクソー・サンドラー・US エクイティ・ファンド -
クラス I USD
- (10) リクソー・ニューシッツ・IRL・PLC - リクソー・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
- (11) SPDR ポートフォリオ米国物価連動国債 ETF

3. 開示基準日

2023年6月末日基準

4. 保有銘柄明細

(注：上場株式については、業種分類及び国別を開示しています。)

(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	業種分類	国別	比率
1	マイクロソフト	情報技術	米国	6.75%
2	イーライリリー	ヘルスケア	米国	6.50%
3	リンデ	素材	イギリス	4.48%
4	ASML ホールディング	情報技術	オランダ	4.43%
5	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	4.02%
6	ロレアル	生活必需品	フランス	3.93%
7	ジョンソン・エンド・ジョンソン	ヘルスケア	米国	3.78%
8	台湾セミコンダクター (TSMC)	情報技術	台湾	3.74%
9	エシロールルックスオティカ	ヘルスケア	フランス	3.69%
10	インテュイット	情報技術	米国	3.56%

(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・ファンド JPY アキュムレーション シェアーズ

	銘柄名	業種分類	国別	比率
1	レナー	一般消費財・サービス	米国	0.58%
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	0.46%
3	ビルダーズ・ファースト・ソース	資本財・サービス	米国	0.45%
4	スチール・ダイナミクス	素材	米国	0.44%
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	0.42%
6	ダイヤモンドバック エナジー	エネルギー	米国	0.42%
7	コテラ・エナジー	エネルギー	米国	0.41%
8	ファースト・シチズンズ・バンクシェアーズ	金融	米国	0.40%
9	マーケル・グループ	金融	米国	0.39%
10	リージョンズ・ファイナンシャル	金融	米国	0.38%

(3) 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)

	銘柄名	クーポン／業種分類	償還日／国別	比率
1	米国国債	1.375%	2023/09/30	3.71%
2	米国国債	2.250%	2024/03/31	3.70%

3	米国国債	2.625%	2023/12/31	3.66%
4	米国国債	3.000%	2024/06/30	3.64%
5	LEG インモビリエン	不動産	ドイツ	3.29%
6	米国国債（物価連動債）	0.500%	2024/04/15	3.25%
7	アルファベット Class A	コミュニケーション・サービス	米国	2.78%
8	iシェアーズ・フィジカル・ゴールド ETC ETF	ETFs	アイルランド	2.47%
9	米国国債（物価連動債）	0.125%	2027/04/15	2.26%
10	サムスン電子	情報技術	韓国	2.18%

(4) 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	リバティ・メディア	2.750%	2024/12/01	1.96%
2	ABRA グローバル・ファイナンス	11.500%	2028/03/02	1.66%
3	シー	2.375%	2025/12/01	1.61%
4	ベガシステムズ	0.750%	2025/03/01	1.61%
5	ビル・ホールディングス	0.000%	2025/12/01	1.51%
6	ANLLIAN キャピタル	0.000%	2025/02/05	1.45%
7	マッチ・グループ・ファイナンスコ2	0.875%	2026/06/15	1.44%
8	ラピッド7	2.250%	2025/05/01	1.42%
9	ユニティ・ソフトウェア	0.000%	2026/11/15	1.37%
10	FIVERR インターナショナル	0.000%	2025/11/01	1.34%

(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	7.37%
2	米国国債	3.625%	2028/03/31	4.47%
3	イギリス国債	4.000%	2063/10/22	4.12%
4	米国国債	0.000%	2023/07/18	1.79%
5	メキシコ国債	8.000%	2053/07/31	1.69%
6	ブラジル国債	10.000%	2027/01/01	1.46%
7	バーレーン国債	6.250%	2051/01/25	1.41%
8	バーレーン国債	5.450%	2032/09/16	1.37%
9	ブラジル国債	10.000%	2033/01/01	1.32%
10	(イギリス) バークレイズ金融債	8.875%	永久債	1.07%

(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	種別等	比率*
1	日本長期国債先物 202309 限月	債券先物(売建)	40.82%
2	米国国債先物 202309 限月	債券先物(買建)	32.81%
3	ドイツ指数先物 DAX30 202309 限月	株式先物(買建)	24.58%
4	日本日経平均 225 202309 限月	株式先物(買建)	18.86%
5	イギリス指数先物 FT100 202309 限月	株式先物(買建)	17.38%
6	日本国庫債券 利付 (10 年) 第 362 回	国債	15.93%
7	日本国庫債券 利付 (10 年) 第 363 回	国債	15.90%
8	日本国庫債券 利付 (10 年) 第 364 回	国債	15.87%
9	日本国庫債券 利付 (10 年) 第 365 回	国債	15.84%
10	米国指数先物 S&P500 eMini 202309 限月	株式先物(買建)	10.67%

*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・ブレンド 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	0.000%	2023/12/28	11.54%
2	米国国債	0.000%	2023/11/30	11.38%
3	米国国債	0.000%	2024/01/25	11.29%
4	米国国債	0.000%	2023/11/02	10.98%
5	米国国債	0.000%	2024/03/21	9.47%
6	米国国債	0.000%	2024/02/22	9.30%
7	米国国債	0.000%	2024/05/16	8.54%
8	米国指数先物 S&P500 eMini 202309 限月	-	-	1.36%
9	米国指数先物 CBOE VIX 202307 限月	-	-	0.00%
10	米国指数先物 CBOE VIX 202308 限月	-	-	0.00%

(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	種別等	比率*
1	イタリア 10 年国債	金利/債券 (ロング)	21.51%
2	中国人民元/米ドル	通貨 (ショート)	-20.03%
3	インドルピー/米ドル	通貨 (ロング)	17.91%
4	スイスフラン/米ドル	通貨 (ショート)	-16.46%
5	英ポンド/米ドル	通貨 (ロング)	15.74%

6	オーストラリア 10 年国債	金利／債券（ショート）	-14.90%
7	メキシコペソ／米ドル	通貨（ロング）	13.90%
8	ブルームバーク [®] 商品（除く農産物）指数	コモディティ（ショート）	-13.21%
9	英国 10 年国債	金利／債券（ショート）	-11.52%
10	ユーロ／ポーランドズロチ	通貨（ショート）	-10.64%

*金融エクスポージャー絶対値順

(9) リクソー・ニューシッツ・IRL・PLC - リクソー・サンドラー・US エクイティ・ファンド - クラス I USD

	銘柄名	業種分類	国別	比率
1	リバティ・メディアーリバティ・フォーミュラ・ワン	コミュニケーション・サービス	米国	2.75%
2	ハベル	資本財・サービス	米国	2.51%
3	ライブ・ネーション・エンターテインメント	一般消費財・サービス	米国	1.87%
4	バルカン・マテリアルズ	資本財・サービス	米国	1.82%
5	テトラ・テック	資本財・サービス	米国	1.62%
6	ホロジック	生活必需品	米国	1.56%
7	シノプシス	情報技術	米国	1.56%
8	ポストン・サイエンティフィック	生活必需品	米国	1.34%
9	ワッコ	一般消費財・サービス	米国	1.13%
10	ワールド・レスリング・エンターテインメント	コミュニケーション・サービス	米国	1.10%

(10) リクソー・ニューシッツ・IRL・PLC - リクソー・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

	銘柄名	業種分類	国別	比率
1	ナショナルインスツルメンツ	資本財・サービス	米国	8.76%
2	ホライゾン・セラピューティクス	生活必需品	米国	6.21%
3	アクティビジョン・ブリザード	情報技術	米国	4.89%
4	ユニバー・ソリューションズ	一般消費財・サービス	米国	4.29%
5	シージェン	生活必需品	米国	4.04%
6	ネットワーク・インターナショナル・ホールディングス	生活必需品	イギリス	3.73%
7	アイベリック バイオ	生活必需品	米国	3.67%
8	デクラ・ファーマシューティカルズ	生活必需品	イギリス	3.16%
9	ユニ・セレクト	一般消費財・サービス	米国	2.63%
10	東芝	資本財・サービス	日本	2.22%

(11) 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	0.12%
2	米国国債（物価連動）	3.875%	2029/04/15	0.11%
3	米国国債（物価連動）	2.375%	2025/01/15	0.11%
4	米国国債（物価連動）	2.500%	2029/01/15	0.11%
5	米国国債（物価連動）	3.375%	2032/04/15	0.11%
6	米国国債（物価連動）	0.375%	2025/07/15	0.11%
7	米国国債（物価連動）	0.875%	2029/01/15	0.11%
8	米国国債（物価連動）	0.625%	2043/02/15	0.11%
9	米国国債（物価連動）	0.250%	2050/02/15	0.11%
10	米国国債（物価連動）	2.375%	2027/01/15	0.11%