ＡＬＡＭＣＯ クオンツ 日本株オープン

追加型投信／国内／株式　日本経済新聞掲載名：クオンツ

NISA対象
成長投資枠

投資信託　国内株式コア部門
３年連続受賞

R&Iファンド大賞2026
3年連続受賞

R&I ファンド大賞 2026　投資信託部門　最優秀ファンド賞　R&I Fund Award 2026

R&I ファンド大賞 2026　投資信託10年部門　優秀ファンド賞　R&I Fund Award 2026

R&I ファンド大賞 2025　投資信託部門　優秀ファンド賞　R&I Fund Award 2025

R&I ファンド大賞 2024　投資信託部門　優秀ファンド賞　R&I Fund Award 2024

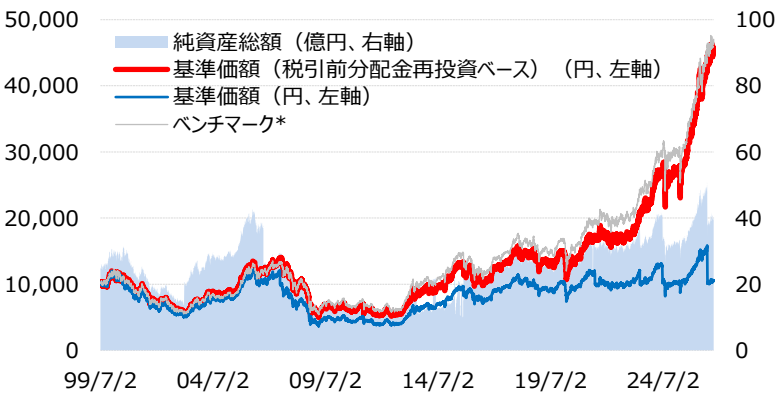
「Ｒ＆Ｉファンド大賞」は、Ｒ＆Ｉが信頼し得ると判断した過去のデータに基づく参考情報（ただし、その正確性及び完全性につきＲ＆Ｉが保証するものではありません）の提供を目的としており、特定商品の購入、売却、保有を推奨、又は将来のパフォーマンスを保証するものではありません。当大賞は、信用格付業ではなく、金融商品取引業等に関する内閣府令第２９９条第１項第２８号に規定されるその他業務（信用格付業以外の業務であり、かつ、関連業務以外の業務）です。当該業務に関しては、信用格付行為に不当な影響を及ぼさないための措置が法令上要請されています。当大賞に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はＲ＆Ｉに帰属しており、無断複製・転載等を禁じます。

「投資信託部門」は過去3年間を、「投資信託10年部門」は過去10年間を選考期間とし、シャープレシオによるランキングに基づき、最大ドローダウン、償還予定日までの期間、残高の規模等を加味したうえで表彰ファンドが選考・決定されます。選考対象は国内籍公募追加型株式投信とし、確定拠出年金専用および SMA・ラップ口座専用は除きます。（評価基準日：2026年3月31日）

ＡＬＡＭＣＯ クオンツ 日本株オープン

追加型投信／国内／株式　日本経済新聞掲載名：クオンツ

■基準価額および純資産総額の推移



＊ ベンチマークはTOPIX（配当込み）としています。（設定日の前営業日を10,000として指数化）
※ 基準価額（税引前分配金再投資ベース）は信託報酬控除後であり、税引前分配金を再投資したものとして計算しています。換金時の費用、手数料等は考慮しておりません。
※ 基準価額は信託報酬控除後です。
※ 実績数値は過去のものであり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

■ファンド概況

基準価額（円・1万口当たり）	10,614
純資産総額（億円）	40
実質株式組入比率（%）	99.3
うち株式先物（%）	4.1
組入銘柄数	140
決算日	6/22
当初設定日	1999/7/2

※ 実質株式組入比率は、マザーファンドを通じた組入比率です。

■期間別騰落率・税引前（%）

	基準価額	ベンチマーク*	差異
1ヵ月前比	▲0.6	▲0.3	▲0.4
3ヵ月前比	＋4.1	＋3.8	＋0.3
6ヵ月前比	＋18.7	＋18.7	▲0.0
1年前比	＋39.9	＋33.9	＋6.0
3年前比	＋106.1	＋89.7	＋16.4
設定来	＋358.1	＋370.2	▲12.1

※ 期間別騰落率は、税引前分配金を再投資したものと仮定して計算しています。換金時の費用、手数料等は考慮しておりません。
※ 差異は四捨五入の関係で、各騰落率の差と一致しない場合があります。

■収益分配金・税引前（円）

期（年月日）	分配金
第23期（2022/6/22）	0
第24期（2023/6/22）	2,105
第25期（2024/6/24）	2,760
第26期（2025/6/23）	560
第27期（2026/6/22）	5,600
設定来合計	16,885

※ 分配金は1万口当たりの金額で、直近5期分を掲載しています。
※ 分配金は過去の実績であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

≪運用概況≫

9月の国内株式市場は、上旬は、米国がイランへの空爆を実施したと公表したことを受けて原油価格が上昇し、地政学的リスクが高まったことなどから下落しました。中旬は、FRB（米連邦準備理事会）がFOMC（米連邦公開市場委員会）で約3年ぶりに利上げを決定し、同時に公表された参加者の政策金利の見通しで年内にあと1回の利上げが示唆されたことを受けて、為替が円安に振れる中で自動車などの輸出関連銘柄に買いが集まったことから反発しました。下旬は、米大手ハイテク企業が発表したAIエージェントが好調だと伝わり、AI・半導体関連銘柄に買いが集まったことに加え、国内金利上昇を受けて銀行など金融セクターの収益改善期待が高まったことなどが好感され続伸したものの、TOPIX（配当込み）の月間騰落率は0.3%の下落となりました。
業種別では、石油・石炭製品、情報・通信業の2業種が4%以上上昇し、鉱業、その他製品、水産・農林業、輸送用機器の4業種が6%以上下落しました。
このような環境下、当ファンドの基準価額は前月比0.6%の下落となり、TOPIXを0.4%下回りました。
当月のリターンがTOPIXを下回った要因としてサービス業の保有を高めていたことや、米AI・半導体関連株の上昇に伴い上旬に大幅高となったソフトバンクグループの保有を低めていたことなどがマイナスに寄与しました。

ＡＬＡＭＣＯ クオンツ 日本株オープン

追加型投信／国内／株式　日本経済新聞掲載名：クオンツ

■組入上位10業種の構成比（%）と月間騰落率（%）

順位	業種	ファンド	ベンチマーク	差異	月間騰落率
1	電気機器	20.3	21.0	▲0.7	+0.6
2	銀行業	12.9	12.9	▲0.1	+1.4
3	情報・通信業	7.4	6.7	+0.7	+4.7
4	機械	7.1	5.8	+1.3	▲0.5
5	サービス業	6.7	4.2	+2.5	▲5.7
6	卸売業	6.2	7.5	▲1.2	▲0.1
7	輸送用機器	4.9	4.8	+0.1	▲6.6
8	医薬品	4.1	3.2	+0.9	▲3.0
9	化学	3.9	4.5	▲0.6	▲1.9
10	小売業	3.8	3.6	+0.2	▲4.5

※ 構成比は現物株式ポートフォリオに占める比率、業種は東証33業種分類によります。
※ 月間騰落率は東証の業種別株価指数の騰落率です。
※ 差異は四捨五入の関係で、各構成比の差と一致しない場合があります。

■組入上位30銘柄（%）

順位	コード	銘柄名	業種	構成比
1	8306	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	4.1
2	8316	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.8
3	8058	三菱商事	卸売業	2.6
4	6098	リクルートホールディングス	サービス業	2.4
5	8411	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2.4
6	6752	パナソニック　ホールディングス	電気機器	2.0
7	7203	トヨタ自動車	輸送用機器	1.9
8	8035	東京エレクトロン	電気機器	1.9
9	6501	日立製作所	電気機器	1.8
10	9433	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1.6
11	9984	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.6
12	6758	ソニーグループ	電気機器	1.6
13	6178	日本郵政	サービス業	1.6
14	5803	フジクラ	非鉄金属	1.5
15	5713	住友金属鉱山	非鉄金属	1.4
16	6971	京セラ	電気機器	1.4
17	4503	アステラス製薬	医薬品	1.4
18	8766	東京海上ホールディングス	保険業	1.4
19	9101	日本郵船	海運業	1.3
20	7276	小糸製作所	電気機器	1.3
21	6586	マキタ	機械	1.3
22	7309	シマノ	輸送用機器	1.3
23	9107	川崎汽船	海運業	1.3
24	5444	大和工業	鉄鋼	1.2
25	8227	しまむら	小売業	1.2
26	6988	日東電工	化学	1.2
27	6981	村田製作所	電気機器	1.2
28	2502	アサヒグループホールディングス	食料品	1.2
29	6857	アドバンテスト	電気機器	1.2
30	6481	ＴＨＫ	機械	1.2

※ 構成比は現物株式ポートフォリオに占める比率、業種は東証33業種分類によります。

ＡＬＡＭＣＯ クオンツ 日本株オープン

追加型投信／国内／株式　日本経済新聞掲載名：クオンツ

■ファンドの目的

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）との連動性を重視しつつ、長期的にTOPIX（東証株価指数）（配当込み）を上回る収益の確保を目的として、運用を行います。

※ TOPIX（東証株価指数）（配当込み）は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するベンチマークです。

■ファンドの特色

1 東京証券取引所上場株式を主要投資対象とします。

2 統計的手法により銘柄を選定するクオンツ運用を行います。

- 東京証券取引所上場銘柄（金融・電力・ガス株を除く）を企業規模等の特徴にしたがって6つの銘柄グループに分類します。
- グループごとに投資尺度の有効性を検証し、有効性が高い投資尺度を組み合わせて銘柄評価モデル（クオンツモデル）を構築します。
- クオンツモデルの評価にしたがって、グループごとに魅力あると見込まれる銘柄を選びます。
- 金融・電力・ガス株は財務分析等により銘柄を選定します。
- 特定のグループに集中投資しすぎていないか、業種に極端な偏りがないかの検証を行います。

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。
資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「TOPIX」という）について

TOPIXは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するベンチマークです。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXに係る標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。JPXは、TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章または商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。JPXは、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズをTOPIXの指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

■投資リスク

ファンドは値動きのある有価証券等を投資対象としますので、組入有価証券等の値動きなどの影響により、基準価額が下落することがあります。したがって、投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、これを割り込むことがあります。ファンドは預貯金と異なります。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

基準価額の変動要因

株価変動リスク	企業の経営・財務状況の変化、国内外の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を受けて株価が下落した場合には、ファンドの基準価額が下落する要因となります。ファンドが投資している企業が業績悪化や倒産等に陥った場合、その企業の株価は大きく下落し、ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。
信用リスク	ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が生じた場合またはそれが予想される場合には、それらの価格は下落し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。
流動性リスク	ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。 これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
  分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
  投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

リスクの管理体制

ファンドのリスク管理は、社内規程やガイドライン等に基づき、運用部門のほか、管理部門およびコンプライアンス部門により行われています。また、リスク管理の状況は、委託会社の役員および各部門の代表者により構成されるリスク管理に関する委員会等において報告・検証され、必要に応じて改善される仕組みとなっています。
流動性リスクの管理は、社内規程やガイドライン等に基づき、ファンドの組入資産のモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行っています。取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督しています。

ＡＬＡＭＣＯ クオンツ 日本株オープン

追加型投信／国内／株式　日本経済新聞掲載名：クオンツ

■手続・手数料等

お申込みメモ

購入単位	販売会社が定める単位 ※ 販売会社へお問い合わせください。
購入価額	購入申込受付日の基準価額
購入代金	販売会社が定める期日までにお支払いください。
換金単位	販売会社が定める単位 ※ 販売会社へお問い合わせください。
換金価額	換金申込受付日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた額
換金代金	原則として、換金申込受付日から起算して4営業日目から支払います。
申込締切時間	原則として、午後3時30分までに販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みを制限する場合があります。
購入・換金申込受付の中止及び取消し	金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金申込みの受付けを中止すること、およびすでに受け付けた購入・換金申込みの受付けを取り消すことがあります。
信託期間	無期限（設定日：1999年7月2日）
繰上償還	受益権の口数が当初設定口数の10分の1を下回ることとなった場合、受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときなどには、繰上償還となる場合があります。
決算日	毎年6月22日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配	年1回決算を行い、収益分配方針に基づいて分配を行います。 ※ 収益分配金をそのつど受け取るコースと自動的に再投資するコースがあります。自動的に再投資するコースを選択された場合の収益分配金は、税金が差し引かれた後、決算日の基準価額で再投資されます。

ＡＬＡＭＣＯ クオンツ 日本株オープン

追加型投信／国内／株式　日本経済新聞掲載名：クオンツ

ファンドの費用・税金

＜ファンドの費用＞

投資者が直接的に負担する費用		
購入時手数料	購入価額に**2.2%（税抜2.0%）**を上限として販売会社が個別に定める率を乗じて得た額 ※詳しくは、販売会社へお問い合わせください。	購入時の商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに購入にかかる事務手続き等の対価として販売会社にお支払いいただきます。
信託財産留保額	換金申込受付日の基準価額に**0.3%**の率を乗じて得た額	－
投資者が信託財産で間接的に負担する費用		
運用管理費用 （信託報酬）	ファンドの日々の純資産総額に**年1.32%（税抜1.2%）**の率を乗じて得た額 ※ 毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。 委託会社：年率0.55%（税抜）　委託した資金の運用の対価 販売会社：年率0.55%（税抜）　運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 受託会社：年率0.10%（税抜）　運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価	信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率
その他の費用・手数料	以下の費用などがファンドから支払われます。これらの費用は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。 ・ファンドの監査費用（ファンドの日々の純資産総額に年0.0055%（税抜0.005%）の率を乗じて得た額。ただし年44万円（税抜40万円）を上限とします。） ・有価証券売買時の売買委託手数料 ・先物・オプション取引等に要する費用	監査費用＝監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 売買委託手数料＝有価証券等の売買の際に支払う手数料

※ ファンドの費用（手数料等）の合計額については、投資者がファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

＜税金＞

当ファンドは、課税上は、株式投資信託として取り扱われます。
公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。
当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
※上記は、税法が改正された場合等には、変更される場合があります。
配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。
原則として、個人投資者については、収益分配時には普通分配金に対して課税され、ご換金（解約）時および償還時には解約価額および償還価額から取得費（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税相当額を含みます。）を控除した差益（譲渡益）に対して課税されます。
詳しくは投資信託説明書（交付目論見書）の「ファンドの費用・税金」をご覧ください。

ＡＬＡＭＣＯ クオンツ 日本株オープン

追加型投信／国内／株式　日本経済新聞掲載名：クオンツ

当社ではホームページにて、商品内容・運用実績等の情報提供サービスを行っております。

URL：　https://www.alamco.co.jp/

≪委託会社その他の関係法人≫

委託会社　ファンドの運用の指図等を行います。

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者　関東財務局長（金商）第301号

加入協会：一般社団法人資産運用業協会

受託会社　ファンドの財産の保管および管理等を行います。

みずほ信託銀行株式会社

販売会社　投資信託説明書（交付目論見書）の提供、受益権の募集の取扱い、解約請求の受付け、収益分配金、償還金、解約代金の支払い等を行います。

●販売会社一覧

販売会社名		登録番号	加入協会			
			日本証券業協会	一般社団法人資産運用業協会	一般社団法人金融先物取引業協会	一般社団法人第二種金融商品取引業協会
アイザワ証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第3283号	○	○		○
あかつき証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第67号	○	○		
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第2251号	○	○	○	○
株式会社SBI証券	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第44号	○	○	○	○
極東証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第65号	○			○
松井証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第164号	○		○	
マネックス証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第165号	○	○	○	○
丸八証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長（金商）第20号	○			
三菱UFJ eスマート証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第61号	○	○	○	○
楽天証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第195号	○	○	○	○
リテラ・クレア証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第199号	○			
株式会社イオン銀行 （委託金融商品取引業者：マネックス証券株式会社）	登録金融機関	関東財務局長（登金）第633号	○			
株式会社ＳＢＩ新生銀行 （委託金融商品取引業者：株式会社SBI証券） （委託金融商品取引業者：マネックス証券株式会社）	登録金融機関	関東財務局長（登金）第10号	○		○	

※ 最終頁の「本資料のご利用にあたってのご留意事項等」をご覧ください。

ALAMCO 朝日ライフ アセットマネジメント

本資料のご利用にあたってのご留意事項等

- 本資料は、朝日ライフ アセットマネジメント株式会社（以下、「当社」といいます。）が、当ファンドの運用の内容やリスク等を説明するために作成したものであり、法令に基づく開示資料ではありません。
- 当ファンドは価格変動リスクや流動性リスク等を伴う証券等に投資します（外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。）ので、市場環境等によって基準価額は変動します。したがって投資元本は保証されているものではありません。運用による損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。
- 本資料は当社が信頼できると判断した情報を元に、十分な注意を払い作成しておりますが、当社はその正確性や完全性をお約束するものではありません。
- 本資料中のグラフ、数値等は過去のものであり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。
- 本資料に記載されている内容は、今後予告なしに変更することがあります。
- ファンドの取得の申し込みにあたっては、販売会社より投資信託説明書（交付目論見書）をお渡ししますので、必ず内容についてご確認の上、お客様ご自身でご判断ください。
- 当ファンドは、金融機関の預金または保険契約ではありませんので、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関でご購入いただいた場合は、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。
- TOPIX（配当込み）の指数値及びTOPIX（配当込み）に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社の知的財産です。

2026-10-990