

運用報告書(全体版)

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信／国内／株式	
信託期間	無期限	
運用方針	TOPIX(東証株価指数)との連動性を重視しつつ、長期的にTOPIXを上回る収益の確保を目的として、運用を行います。	
主要投資対象	朝日ライフクオンツ日本株オープン	朝日ライフクオンツ日本株マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	朝日ライフクオンツ日本株マザーファンド	東京証券取引所上場株式を主要投資対象とします。
組入制限	朝日ライフクオンツ日本株オープン	株式への実質投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	朝日ライフクオンツ日本株マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎決算時(6月22日。休業日の場合は翌営業日)に、利子、配当収入および売買益などのうちから、基準価額水準等を勘案して、分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないこともあります。	

朝日ライフ クオンツ 日本株オープン

第23期

(決算日 2022年6月22日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、ご投資いただいております「朝日ライフクオンツ 日本株オープン」は、2022年6月22日に第23期の決算を行いました。ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも、一層のお引立てを賜りますようお願い申し上げます。

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社
東京都杉並区和泉一丁目22番19号

<お問い合わせ先>

ホームページ：<https://www.alamco.co.jp/>

フリーダイヤル：0120-283-104

〔受付時間〕 営業日の午前9時～午後5時

○本報告書の表記について

・原則として、数量、額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数で表記する場合があります。－印は、組入れ、異動などの該当がないことを示します。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			TOPIX(東証株価指数)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期騰落率	[ベンチマーク]	期騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
19期(2018年6月22日)	10,002	460	9.2	1,744.83	8.3	92.3	7.3	2,612
20期(2019年6月24日)	9,085	0	△9.2	1,547.74	△11.3	87.9	11.9	2,472
21期(2020年6月22日)	9,490	0	4.5	1,579.09	2.0	87.6	12.2	2,576
22期(2021年6月22日)	10,000	1,900	25.4	1,959.53	24.1	95.5	3.6	2,678
23期(2022年6月22日)	9,533	0	△4.7	1,852.65	△5.5	94.3	5.6	2,982

(注) 基準価額および分配金は1万口当たりの値です。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みで計算しています。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、株式組入比率、株式先物比率は実質比率で記載しています。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		TOPIX(東証株価指数)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	[ベンチマーク]	騰落率			
(期首)	円	%		%	%	%
2021年6月22日	10,000	－	1,959.53	－	95.5	3.6
6月末	9,972	△0.3	1,943.57	△0.8	95.0	4.4
7月末	9,751	△2.5	1,901.08	△3.0	95.0	4.4
8月末	10,131	1.3	1,960.70	0.1	95.2	4.3
9月末	10,454	4.5	2,030.16	3.6	94.8	4.4
10月末	10,272	2.7	2,001.18	2.1	95.0	4.4
11月末	9,820	△1.8	1,928.35	△1.6	95.1	4.3
12月末	10,116	1.2	1,992.33	1.7	95.0	4.4
2022年1月末	9,712	△2.9	1,895.93	△3.2	95.3	4.4
2月末	9,704	△3.0	1,886.93	△3.7	95.2	4.4
3月末	10,065	0.7	1,946.40	△0.7	93.8	5.6
4月末	9,869	△1.3	1,899.62	△3.1	93.9	5.6
5月末	9,946	△0.5	1,912.67	△2.4	94.3	5.5
(期末)						
2022年6月22日	9,533	△4.7	1,852.65	△5.5	94.3	5.6

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

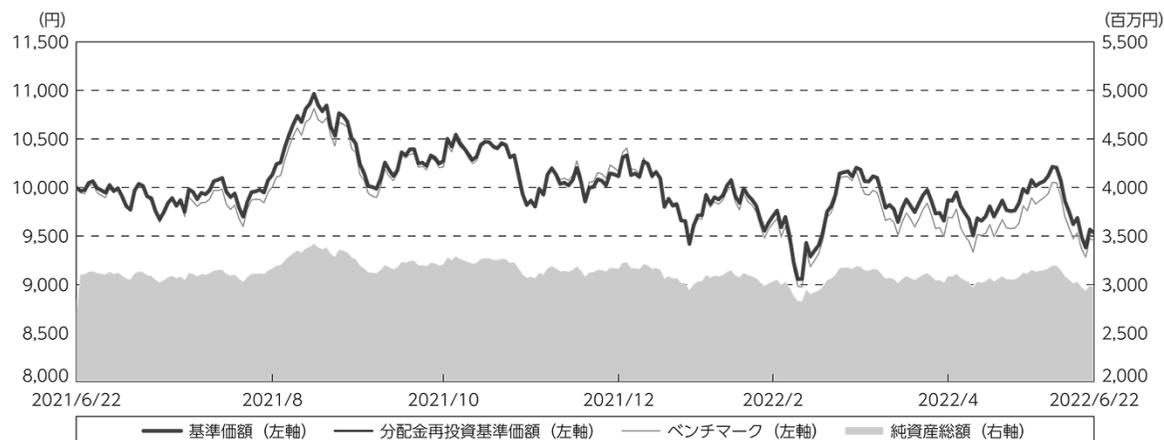
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比で計算しています。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、株式組入比率、株式先物比率は実質比率で記載しています。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

◎運用経過(2021年6月23日～2022年6月22日)

○当期中の基準価額等の推移



期首：10,000円

期末：9,533円(既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 4.7%(分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しています。
- (注) ベンチマークは「TOPIX(東証株価指数)」です。

○基準価額の主な変動要因

主な上昇要因としては、国内外での新型コロナウイルスのワクチン接種の加速、パウエルFRB(米連邦準備理事会)議長の発言を受けたテーパリング(資産買入の縮小)に関する過度な懸念の後退、国内次期政権の経済政策に対する期待、円安ドル高の進行、内外企業の好調な決算、新型コロナウイルス治療薬への期待、日銀による金融緩和維持の方針などが挙げられます。

主な下落要因としては、FOMC(米連邦公開市場委員会)における2021年内テーパリング開始の示唆、中国恒大集団の債務問題や米債務上限問題に対する警戒感、感染力の強い新型コロナウイルス変異株の出現と感染拡大、ウクライナを巡る地政学リスク、インフレ高進や原油価格の上昇、金融引き締め加速への警戒感などが挙げられます。

○投資環境

当期の国内株式市場は、TOPIX(東証株価指数)が1,959.53ポイント(2021年6月22日)から始まり、感染力の強いデルタ株の感染者数の増加や、FOMCにおいて年内のテーパリング開始が示唆されたことなどが嫌気され8月中旬まで軟調に推移しました。

8月下旬以降は、国内外でのワクチン接種加速や、パウエルFRB議長の講演を受けたテーパリングに関する過度な懸念の後退から上昇に転じ、さらに9月に入ると菅首相の自民党総裁選の不出馬による次期政権の経済政策への期待から急伸し、9月14日にTOPIXは期中最高値となる2,118.87ポイントをつけました。

その後は、中国不動産大手・中国恒大集団の債務問題や米債務上限問題への警戒感から下落しましたが、10月中旬以降は、円安ドル高の進行や内外企業の好決算などを背景に反発し、11月中旬まで堅調に推移しました。

11月下旬以降は、強い感染力が疑われる変異株(オミクロン株)の出現により経済活動の正常化が遅れるとの懸念から下落しましたが、12月に入ると、オミクロン株を巡る経口治療薬の製造販売承認の申請などが好感され反発しました。

2022年の年明け以降は、オミクロン株の国内感染者数増加やウクライナを巡る地政学リスクが意識されたことなどをを受けて下落しました。その後2月に入り、国内企業の好決算などを背景に一時的に反発しましたが、好調な米経済指標を受けたインフレ高進や原油価格の上昇などから再度下落に転じ、3月9日にTOPIXは期中最安値となる1758.89ポイントをつけました。

その後は、原油価格の上昇の一服や、米長期金利上昇による円安ドル高の進行などをを受けて急反発しましたが、4月に入ると、FRBIによる金融引き締め加速への警戒感を背景とした米国株の下落などをを受けて軟調に推移しました。

5月中旬以降は、5月のFOMC議事要旨で米国経済の堅調さが示されたことや日銀の黒田総裁が粘り強く金融緩和を続ける方針を示したことなどから上昇しましたが、期末にかけては世界的な金融引き締め加速への警戒感から反落し、期末である6月22日にTOPIXは1,852.65ポイントで終了しました。

○当ファンドのポートフォリオ

主要投資対象である朝日ライフ クオントツ 日本株マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券に投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行っています。また、資金流入への対応と株式の実質組入比率を高める観点から、TOPIX先物取引を活用し、先物を含む実質株式組入比率については高水準を維持しました。

マザーファンドはTOPIXとの連動性を重視しつつ、長期的にTOPIXを上回る収益を確保することを運用の目的としています。銘柄の選定に当たりますは、当社が独自に開発したクオントツモデル(コンピュータを用いて統計的手法により銘柄を選定する仕組み)を活用し、業種分散などに配慮しながら定期的に銘柄入れ替えを行うと共に、フルインベストメントを基本として運用を行いました。また、投資判断の基準として期を通じて、“バリュエーション指標”を中心に“収益の成長性や収益率の変化”や“予想収益の修正動向”、“財務安定性”を加味した銘柄選択を行いました。



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

○当ファンドのベンチマークとの差異

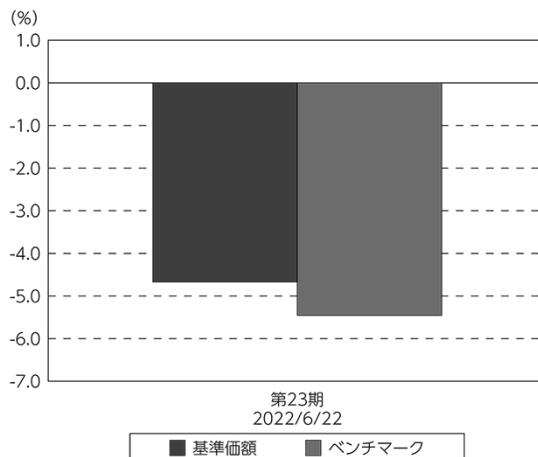
当ファンドは「TOPIX(東証株価指数)」をベンチマークとします。

コメント・グラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

ベンチマークが5.5%下落したのに対し、基準価額は4.7%の下落となり、ベンチマークを0.8%上回る結果となりました。“バリュエーション指標”や“クオリティ指標”、“予想収益の修正動向”等を重視した銘柄選択が奏功したことや、業種では上昇率が大きかった「海運業」や「鉱業」の保有を高くしていたことがプラスの乖離要因となりました。一方で、上昇率が大きかった「卸売業」の保有を低めとしていたこと、ファンドから控除される信託報酬等のコストがマイナスの乖離要因となりました。

個別銘柄では、世界的な原油価格の上昇を受けて業績拡大が期待されたINPEX、半導体製造装置向けの部品販売が伸びたことや原材料価格高騰に伴う値上げにより2022年3月期本決算で過去最高益を更新した日本特殊陶業、2022年3月期の連結営業利益について、想定を上回る主力薬の販売や円安の進行を背景に従来の減益予想から一転し増益見込みとなることを発表した武田薬品工業の保有を高くしていたことなどがプラスに寄与しましたが、2022年3月期第3四半期の決算で大幅増益となる一方、通期業績予想が据え置かれたことが嫌気され株価が下落したリクルートホールディングス、主力の抗アレルギー点眼剤について、薬価の引き下げにより国内事業の減収が見込まれた参天製薬の保有を高くしていたこと、資源高による恩恵を受けて2022年3月期本決算で過去最高益を達成した三菱商事の保有を低めとしていたことなどがマイナスに寄与しました。

基準価額とベンチマークの対比(期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込み(税込み)です。

○分配金

当期の分配金につきましては、収益分配方針に基づき、基準価額水準などを勘案して、見送らせていただきました。

なお、収益分配にあてず信託財産内に留保した利益につきましては、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第23期
	2021年6月23日～ 2022年6月22日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,722

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益および当期の収益以外は、小数点以下を切捨てて表示しているため、合計した額が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

TOPIXとの連動性を重視しつつ、長期的にTOPIXを上回る収益の確保を目指します。引き続き、フルインベストメントを基本として、実質的な運用はマザーファンドで行います。マザーファンドにおける銘柄の選定に当たりましては、当社が独自に開発したクオンツモデルを活用し、業種分散などに配慮しながら運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月23日～2022年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 132	% 1.320	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(60)	(0.605)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(60)	(0.605)	交付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 ）	(11)	(0.110)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.003	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際に支払う手数料です。
（ 株 式 ）	(0)	(0.001)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.002)	
(c) そ の 他 費 用	1	0.006	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(1)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用です。
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	133	1.329	
期中の平均基準価額は、9,984円です。			

(注) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

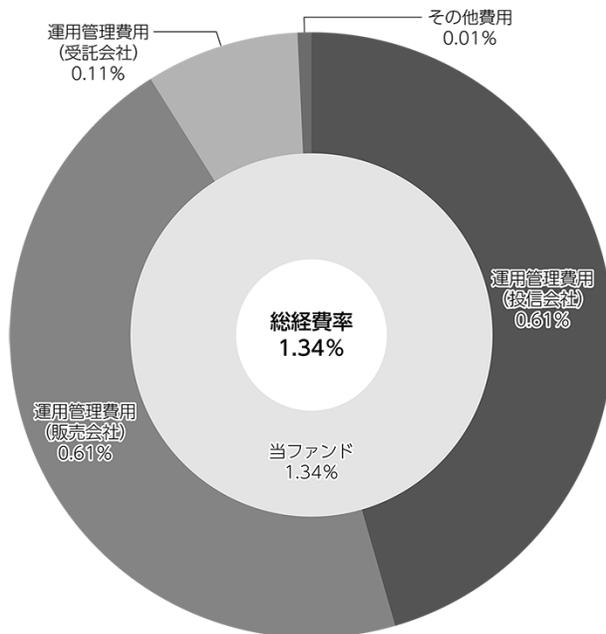
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます。)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.34%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年6月23日～2022年6月22日)

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 700	百万円 683	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
朝日ライフ クオオンツ 日本株マザーファンド	千口 178,090	千円 410,000	千口 -	千円 -

○株式売買比率

(2021年6月23日～2022年6月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	朝日ライフ クオオンツ 日本株マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	18,335,264千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,956,307千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	6.20	

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2021年6月23日～2022年6月22日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2022年6月22日現在)

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内 株式先物取引 TOPIX	百万円 55	百万円 -

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
朝日ライフ クオント 日本株マザーファンド	千口 1,140,846	千口 1,318,936	千円 2,933,447

(注) 親投資信託の当期末の受益権総口数は、1,318,936千口です。

○投資信託財産の構成

(2022年6月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
朝日ライフ クオント 日本株マザーファンド	千円 2,933,447	% 97.6
コール・ローン等、その他	71,983	2.4
投資信託財産総額	3,005,430	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年6月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,005,430,339
コール・ローン等	66,370,218
朝日ライフ クオソツ 日本株マザーファンド(詳価額)	2,933,447,121
差入委託証拠金	5,613,000
(B) 負債	23,359,033
未払金	3,003,000
未払解約金	19
未払信託報酬	20,271,017
未払利息	198
その他未払費用	84,799
(C) 純資産総額(A-B)	2,982,071,306
元本	3,128,013,743
次期繰越損益金	△ 145,942,437
(D) 受益権総口数	3,128,013,743口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,533円

(注) 期首元本額は2,678,240,468円、期中追加設定元本額は467,446,504円、期中一部解約元本額は17,673,229円です。

(注) 投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額は以下のとおりです。

元本の欠損(当期末)145,942,437円

○損益の状況 (2021年6月23日～2022年6月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 71,500
支払利息	△ 71,500
(B) 有価証券売買損益	△104,296,777
売買益	56,087
売買損	△104,352,864
(C) 先物取引等取引損益	△ 362,179
取引益	10,346,674
取引損	△ 10,708,853
(D) 信託報酬等	△ 41,450,769
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△146,181,225
(F) 前期繰越損益金	99,431
(G) 追加信託差損益金	139,357
(配当等相当額)	(808,603,581)
(売買損益相当額)	(△808,464,224)
(H) 計(E+F+G)	△145,942,437
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(H+I)	△145,942,437
追加信託差損益金	139,357
(配当等相当額)	(809,484,128)
(売買損益相当額)	(△809,344,771)
分配準備積立金	42,162,330
繰越損益金	△188,244,124

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程
 計算期間末における費用控除後の配当等収益(42,062,899円)、費用控除後の有価証券等損益額(一円)、信託約款に規定する収益調整金(809,484,128円)および分配準備積立金(99,431円)より分配対象収益は851,646,458円(10,000口当たり2,722円)ですが、当期は分配を行いませんでした。

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

運用方針	TOPIX(東証株価指数)との連動性を重視しつつ、長期的にTOPIXを上回る収益の確保を目的として運用を行います。
主要運用対象	東京証券取引所上場株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		TOPIX(東証株価指数)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	円	騰落率	[ベンチマーク]	騰落率			
19期(2018年6月22日)	18,612	10.7%	1,744.83	8.3%	93.9%	1.4%	2,570
20期(2019年6月24日)	17,150	△7.9	1,547.74	△11.3	97.0	2.8	2,239
21期(2020年6月22日)	18,172	6.0	1,579.09	2.0	95.3	4.6	2,368
22期(2021年6月22日)	23,030	26.7	1,959.53	24.1	97.3	2.2	2,627
23期(2022年6月22日)	22,241	△3.4	1,852.65	△5.5	95.8	3.8	2,933

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		TOPIX(東証株価指数)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率	[ベンチマーク]	騰 落 率		
(期 首) 2021年6月22日	円 23,030	% —	1,959.53	% —	% 97.3	% 2.2
6月末	22,971	△0.3	1,943.57	△0.8	97.5	1.9
7月末	22,484	△2.4	1,901.08	△3.0	97.5	1.9
8月末	23,395	1.6	1,960.70	0.1	97.6	1.9
9月末	24,161	4.9	2,030.16	3.6	97.1	2.5
10月末	23,764	3.2	2,001.18	2.1	97.1	2.5
11月末	22,744	△1.2	1,928.35	△1.6	97.3	2.5
12月末	23,448	1.8	1,992.33	1.7	97.1	2.6
2022年1月末	22,541	△2.1	1,895.93	△3.2	97.2	2.6
2月末	22,546	△2.1	1,886.93	△3.7	97.0	2.5
3月末	23,410	1.7	1,946.40	△0.7	95.6	3.8
4月末	22,980	△0.2	1,899.62	△3.1	95.6	3.8
5月末	23,188	0.7	1,912.67	△2.4	95.9	3.7
(期 末) 2022年6月22日	22,241	△3.4	1,852.65	△5.5	95.8	3.8

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

(注) 騰落率は期首比で計算しています。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

○当期の運用経過、今後の運用方針
 前述の2～6ページをご覧ください。

○1万口当たりの費用明細

(2021年6月23日～2022年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	円 0 (0) (0)	% 0.002 (0.001) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際に支払う手数料です。
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	0	0.002	
期中の平均基準価額は、23,136円です。			

(注) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます。)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

○売買及び取引の状況

(2021年6月23日～2022年6月22日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		4,666 (37)	9,385,674 (-)	4,477	8,949,590

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
内		796	738	-	-

(注) 金額は受渡代金です。

○株式売買比率

(2021年6月23日～2022年6月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	18,335,264千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,956,307千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	6.20

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2021年6月23日～2022年6月22日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2022年6月22日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
鉱業 (1.6%)			
三井松島ホールディングス	—	1	2,749
I N P E X	10.4	27.5	40,865
K&Oエナジーグループ	5.1	—	—
建設業 (0.8%)			
三井住友建設	—	14.7	6,629
大和ハウス工業	3.6	—	—
きんでん	—	10.2	15,381
食料品 (1.2%)			
森永製菓	2.3	—	—
カルビー	12.2	—	—
森永乳業	4.4	—	—
明治ホールディングス	4.2	—	—
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	2.8	—	—
アリアケジャパン	—	1.5	8,100
東洋水産	1.8	—	—
日本たばこ産業	18.8	10.5	25,410
繊維製品 (0.2%)			
ワコールホールディングス	—	3.1	6,547
パルプ・紙 (—%)			
北越コーポレーション	6.8	—	—
化学 (4.3%)			
クラレ	—	9.6	10,675
旭化成	15.2	—	—
昭和電工	9.5	2.7	6,652
住友化学	58.6	—	—
東ソー	—	4.8	8,323
信越化学工業	3.2	3.4	51,510
堺化学工業	2.8	—	—
日本バーカライジング	4	—	—
高压ガス工業	9.7	—	—
日本触媒	0.9	—	—
三井化学	9.6	—	—
森六ホールディングス	—	4.8	8,596
日東電工	1	3.9	35,178
医薬品 (4.8%)			
武田薬品工業	10.8	16.9	62,445
アステラス製薬	12.8	1.7	3,597
中外製薬	9.7	10.7	36,358

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
小野薬品工業	11.9	6.9	22,314
参天製薬	22.4	—	—
J C R ファーマ	4.2	—	—
第一三共	1.8	3.4	10,880
石油・石炭製品 (0.5%)			
コスモエネルギーホールディングス	—	4	14,600
ゴム製品 (1.0%)			
ブリヂストン	—	5.4	28,285
ガラス・土石製品 (2.6%)			
A G C	—	5.4	26,163
日本電気硝子	4.1	3.1	8,354
日本特殊陶業	7	11.8	29,382
ニチハ	—	4.1	10,450
鉄鋼 (3.4%)			
日本製鉄	18.8	6.7	12,726
神戸製鋼所	18.7	18.7	11,407
ジェイ エフ イー ホールディングス	23.1	18.5	26,140
大和工業	—	8.6	38,700
新日本電工	—	18.3	6,313
非鉄金属 (—%)			
住友金属鉱山	1.2	—	—
金属製品 (0.2%)			
東洋製罐グループホールディングス	—	5	6,905
機械 (2.3%)			
アマダ	28.2	14.9	15,034
DMG森精機	—	8.6	15,514
ディスコ	0.9	0.3	8,973
SMC	0.8	0.1	5,901
新東工業	8.7	—	—
ダイキン工業	0.5	0.4	8,136
椿本チエイン	2.6	—	—
平和	5.6	—	—
SANKYO	3.6	1.6	6,504
T P R	—	3.6	4,356
I H I	12.8	—	—
電気機器 (12.9%)			
イビデン	—	2.5	9,412
日立製作所	1.9	3.1	20,078
三菱電機	13.5	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本電産	1.2	0.5	3,931
富士通	—	0.8	13,236
ルネサスエレクトロニクス	7.8	18.2	23,259
アルバック	—	2.3	10,580
ソニーグループ	4.6	8.2	93,234
ヒロセ電機	0.5	0.5	8,620
アドバンテスト	3.6	2	14,280
エスベック	—	4.8	8,155
キーエンス	0.6	0.7	33,173
イリゾ電子工業	1.4	2.4	7,596
日本セラミック	—	4.2	8,421
ファナック	1.7	0.7	14,693
太陽誘電	—	1.4	6,678
村田製作所	1.4	1	7,677
S C R E E Nホールディングス	—	2.4	22,656
キヤノン	6.3	0.9	2,908
東京エレクトロン	1.2	1.2	53,880
輸送用機器 (8.2%)			
いすゞ自動車	23.6	—	—
トヨタ自動車	7.9	45.9	98,960
三菱自動車工業	—	13.6	6,555
日産車体	12.6	18.9	10,999
トピー工業	—	7.1	9,585
NOK	—	8.1	9,144
プレス工業	15.8	—	—
アイシン	7.4	—	—
マツダ	—	8.7	10,048
本田技研工業	2.7	13.9	47,232
エクセディ	2.4	7.7	13,436
エフ・シー・シー	5.9	—	—
シマノ	1.7	1.1	24,057
精密機器 (1.9%)			
H O Y A	4.1	4.1	49,220
シチズン時計	—	9.7	5,354
その他製品 (0.8%)			
パイロットコーポレーション	2.9	—	—
任天堂	0.5	0.4	23,072
電気・ガス業 (1.2%)			
関西電力	7.6	6.1	7,954
四国電力	6.9	8	6,080
九州電力	—	10	8,400
電源開発	3.3	—	—
東京瓦斯	1.8	2.1	5,588

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大阪瓦斯	1.8	2.1	5,155
陸運業 (1.4%)			
相鉄ホールディングス	4.7	—	—
京浜急行電鉄	19.1	—	—
東日本旅客鉄道	2.9	—	—
西武ホールディングス	—	18.5	26,159
鴻池運輸	—	7.5	8,722
ニッコンホールディングス	3.6	—	—
セイノーホールディングス	—	4.2	4,531
海運業 (1.7%)			
日本郵船	7.7	4.4	40,216
商船三井	3.3	—	—
乾汽船	—	4	6,876
情報・通信業 (16.9%)			
NECネットエスアイ	—	5.7	10,294
デジタルアーツ	—	1.4	7,532
ネクソン	3.7	4.3	11,966
エニグモ	6.9	—	—
じげん	12.7	—	—
ティーンガイア	4.1	—	—
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3.6	10.8	24,894
GMOペイメントゲートウェイ	0.5	—	—
インターネットイニシアティブ	—	1.2	5,496
P R T I M E S	1.5	—	—
アカツキ	2.2	—	—
ユーザーローカル	1	—	—
フジ・メディア・ホールディングス	—	27.8	31,358
オービック	—	1	18,350
ジャストシステム	3.6	3.8	13,642
トレンドマイクロ	4.9	—	—
日本オラクル	3.1	—	—
オービックビジネスコンサルティング	—	1.5	6,090
T B Sホールディングス	—	17.2	29,291
日本テレビホールディングス	20.5	24.7	30,084
日本電信電話	5.5	14.1	55,469
K D D I	10.1	14.8	66,096
ソフトバンク	—	37	55,481
GMOインターネット	1.3	—	—
松竹	—	0.9	11,025
エス・ティ・ティ・データ	—	8.2	15,293
スクウェア・エニックス・ホールディングス	—	0.8	4,784
カブコン	—	8.7	27,709
S C S K	—	10.7	23,550

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ミロク情報サービス	—	7.4	7,962
ソフトバンクグループ	5.6	3.8	19,095
卸売業 (8.1%)			
バイタルケーエスケー・ホールディングス	9.4	—	—
TO K A I ホールディングス	8.5	—	—
小野建	—	6.3	8,738
ナガイレーベン	—	6.2	11,370
第一興商	—	2.5	9,362
日本ライフライン	5.4	—	—
伊藤忠商事	1.7	2.6	9,583
丸紅	—	18.1	22,543
蝶理	2.8	3	5,787
三井物産	1.2	17.7	53,277
住友商事	19.3	23.6	42,857
三菱商事	0.8	14.3	58,072
新光商事	—	7.7	6,760
日鉄物産	1.8	—	—
小売業 (7.5%)			
エービーシー・マート	—	1.1	6,237
アルペン	—	4.6	9,195
ジーンズホールディングス	—	2	7,800
Z O Z O	2.6	—	—
三越伊勢丹ホールディングス	—	29	31,088
コスモス薬品	—	1	12,130
セブン&アイ・ホールディングス	0.6	1.2	6,258
ノジマ	1.8	—	—
良品計画	3.6	25.3	33,471
アドヴァングループ	8.7	7.3	5,642
ユナイテッドアローズ	—	3.1	5,824
ハイデイ日高	2.9	—	—
スギホールディングス	—	3.2	16,608
日本瓦斯	—	2.3	4,289
ゼビオホールディングス	4.1	10.3	9,455
ヤマダホールディングス	12.9	—	—
ニトリホールディングス	1.9	2.8	33,460
ベルク	1.4	—	—
サンドラッグ	—	10.1	28,552
銀行業 (5.7%)			
めぶきフィナンシャルグループ	21.5	24.9	6,498
新生銀行	4.5	—	—
三菱UF J フィナンシャル・グループ	67	67.2	50,346
りそなホールディングス	24.3	17.9	9,154
三井住友トラスト・ホールディングス	0.5	1.7	7,208

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友フィナンシャルグループ	7.6	9	36,459
群馬銀行	13.2	15.3	5,798
ふくおかフィナンシャルグループ	2.7	—	—
八十二銀行	—	16.9	8,010
みずほフィナンシャルグループ	13.6	19.8	30,848
山口フィナンシャルグループ	6.9	8	5,984
証券、商品先物取引業 (0.6%)			
S B I ホールディングス	—	1.3	3,364
大和証券グループ本社	10.4	—	—
野村ホールディングス	22.4	26	12,909
保険業 (3.1%)			
かんぽ生命保険	—	5.2	11,601
S O M P O ホールディングス	2.3	2.7	15,786
MS & A D インシュアランスグループ ホールディングス	3.2	3.4	13,974
第一生命ホールディングス	7.3	5.5	13,992
東京海上ホールディングス	2.3	2.2	16,849
T & D ホールディングス	5.9	8.5	13,931
その他金融業 (1.2%)			
クレディセゾン	3.3	3.8	5,935
芙蓉総合リース	—	0.8	6,064
オリックス	9.1	6.6	15,318
三菱HCキャピタル	6.7	12.1	7,574
不動産業 (1.3%)			
サムティ	2.6	—	—
オープンハウスグループ	—	3.3	17,556
飯田グループホールディングス	3.6	8.8	17,899
ケイアイスター不動産	1.2	—	—
ゴールドクレスト	1.8	—	—
サンフロンティア不動産	5.5	—	—
サービス業 (4.6%)			
日本M&Aセンターホールディングス	1.7	—	—
リンクアンドモチベーション	—	20.2	9,130
総合警備保障	2.8	—	—
ディップ	—	2	6,950
エムスリー	5	3.5	12,512
アウトソーシング	3.2	—	—
プレステージ・インターナショナル	—	13.9	8,298
電通グループ	—	5	21,450
H. U. グループホールディングス	1.9	—	—
オリエンタルランド	—	0.4	7,270
ラウンドワン	—	7.2	11,124
ユー・エス・エス	15.8	—	—
サイバーエージェント	2.3	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
モーニングスター	9.9	—	—
アイ・アールジャパンホールディングス	0.5	—	—
リクルートホールディングス	3.6	5.1	20,063
ソラスト	—	10.9	6,986
東京都競馬	—	1.6	6,008
カナモト	—	6.3	11,982

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
セコム	1.9	0.8	6,476	
合 計	株 数 ・ 金 額	1,073	1,299	2,811,031
	銘柄数<比率>	151	158	<95.8%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 111	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2022年6月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 2,811,031	% 95.6
コール・ローン等、その他	128,446	4.4
投資信託財産総額	2,939,477	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年6月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,964,347,812
コール・ローン等	94,375,504
株式(評価額)	2,811,031,200
未収配当金	28,245,108
差入委託証拠金	30,696,000
(B) 負債	30,876,834
未払金	6,006,000
未払利息	281
差入委託証拠金代用有価証券	24,870,000
その他未払費用	553
(C) 純資産総額(A-B)	2,933,470,978
元本	1,318,936,703
次期繰越損益金	1,614,534,275
(D) 受益権総口数	1,318,936,703口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,241円

(注) 期首元本額は1,140,846,180円、期中追加設定元本額は178,090,523円、期中一部解約元本額は-円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、朝日ライフ クオンツ 日本株オープン1,318,936,703円です。

○損益の状況 (2021年6月23日～2022年6月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	83,589,111
受取配当金	83,630,514
その他収益金	29,133
支払利息	△ 70,536
(B) 有価証券売買損益	△ 181,805,647
売買益	437,605,997
売買損	△ 619,411,644
(C) 先物取引等取引損益	△ 5,722,450
取引益	10,922,100
取引損	△ 16,644,550
(D) 保管費用等	△ 1,596
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 103,940,582
(F) 前期繰越損益金	1,486,565,380
(G) 追加信託差損益金	231,909,477
(H) 計(E+F+G)	1,614,534,275
次期繰越損益金(H)	1,614,534,275

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。