

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24期

(決算日 2023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、2023年6月22日に第24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	み期騰落率	[ベンチマーク]	期騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
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
24期(2023年6月22日)	10,000	2,105	27.0	2,296.50	24.0	91.7	7.3	3,117

(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	%		%	%	%
2022年6月22日	9,533	－	1,852.65	－	94.3	5.6
6月末	9,604	0.7	1,870.82	1.0	94.1	5.6
7月末	9,936	4.2	1,940.31	4.7	94.2	5.6
8月末	9,995	4.8	1,963.16	6.0	94.2	5.6
9月末	9,441	△ 1.0	1,835.94	△ 0.9	93.0	6.2
10月末	9,934	4.2	1,929.43	4.1	93.3	6.2
11月末	10,246	7.5	1,985.57	7.2	93.7	6.2
12月末	9,872	3.6	1,891.71	2.1	93.7	5.5
2023年1月末	10,293	8.0	1,975.27	6.6	93.9	5.5
2月末	10,498	10.1	1,993.28	7.6	94.2	5.5
3月末	10,636	11.6	2,003.50	8.1	93.3	6.0
4月末	10,914	14.5	2,057.48	11.1	93.6	6.0
5月末	11,286	18.4	2,130.63	15.0	93.7	6.0
(期末)						
2023年6月22日	12,105	27.0	2,296.50	24.0	91.7	7.3

(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(2022年6月23日～2023年6月22日)

○当期中の基準価額等の推移



期首：9,533円

期末：10,000円(既払分配金(税込み)：2,105円)

騰落率：27.0%(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、原油価格の下落、インフレおよび主要中央銀行の金融引き締め懸念の後退、英トラス政権による減税政策の撤回、米当局による預金者保護正当化の認識表明、著名投資家ウォーレン・バフェットの日本株追加購入検討の報道、日銀による金融緩和継続方針、円安ドル高の進行、米国債デフォルト懸念の後退などが挙げられます。

主な下落要因としては、米CPI(消費者物価指数)上昇を受けたFRB(米連邦準備理事会)による金融引き締め継続への懸念、中国のゼロコロナ政策に対するデモ拡大による景気減速懸念の高まり、日銀によるYCC(イールドカーブ・コントロール)の長期金利の許容変動幅拡大、欧米金融機関の破綻懸念を受けた金融システム不安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1,852.65ポイント(2022年6月22日)から、原油価格の下落を受けて米長期金利が低下し米国株が上昇したことを背景に上昇して始まりました。

その後、8月中旬のジャクソンホール会議においてパウエルFRB議長が金融引き締め積極的に姿勢を強調したことによる米国株の急落から下落に転じました。9月中旬には、世界景気の減速懸念を背景とした原油価格の急落から一時的に反発しましたが、8月の米CPIの伸びが市場予想を上回りFRBによる大幅な利上げが継続するとの見方が広がると続落し、9月30日にTOPIXは期中最安値となる1,835.94ポイントをつけました。

10月に入り、英トラス政権の大規模な減税政策の撤回による英長期金利の低下や、オーストラリア準備銀行の利上げ幅が市場予想を下回り主要中央銀行の金融引き締め懸念が後退したことなどから上昇に転じました。

11月下旬以降は、中国のゼロコロナ政策に対する抗議デモの拡大などによる中国景気の減速懸念などから下落し、年末にかけても日銀が12月の金融政策決定会合においてYCCの長期金利の許容変動幅拡大を決定したことによる円高進行への警戒感から続落しました。

2023年の年明け以降は、2022年12月の米雇用統計の賃金上昇率の伸び率鈍化を受けた米金融引き締めの長期化懸念の後退や、日銀が1月の金融政策決定会合で大規模な金融緩和政策の維持を決定したことによる円安ドル高の進行などから上昇しました。

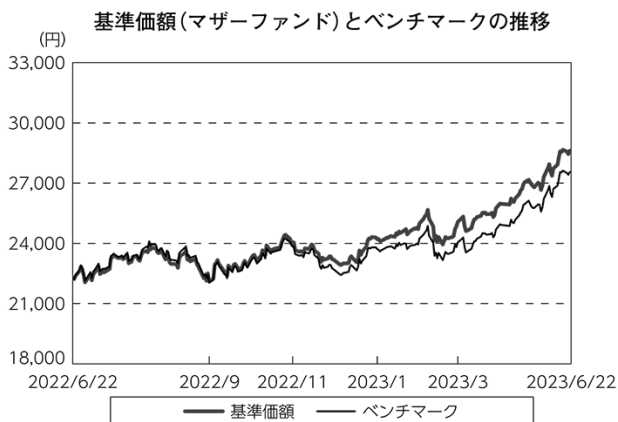
3月に入ると、欧米金融機関の破綻懸念から金融システム不安が強まり下落しましたが、イエレン米財務長官が中小銀行の預金大量流出に対し当局による預金者保護が正当化され得るとの認識を示したことなどから金融システム不安が後退したことや、著名投資家ウォーレン・バフェットによる日本株追加購入の検討報道などから上昇に転じました。

その後は、日銀が大規模な金融緩和政策の維持を決定したこと、米半導体大手エヌビディアの好決算、米連邦債務上限の一時停止合意による米国債デフォルト懸念の後退などから、6月16日にTOPIXが期中最高値となる2,300.36ポイントをつけるなど上昇基調で推移し、期末である6月22日にTOPIXは2,296.50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、資金流出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には、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

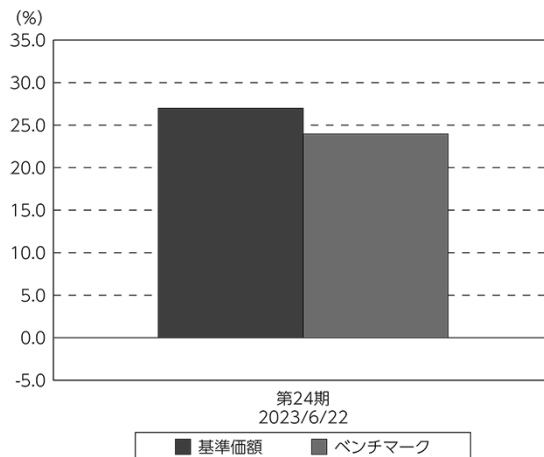
当ファンドは「TOPIX(東証株価指数)」をベンチマークとします。

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24.0%上昇したのに対し、基準価額は27.0%の上昇となり、ベンチマークを3.0%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「鉄鋼」の保有を高め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、中国の経済再開で鉄鋼の需要回復が期待された日本製鉄、鋼材の値上げによる利ざやの改善が好感された神戸製鋼所、主力製品であるウエハー洗浄装置の好調から2023年3月期第3四半期の決算で最高益となったSCREENホールディングスの保有を高めていたことなどがプラスに寄与しましたが、商品価格の高騰を背景に増益となった三菱商事の保有を低めとしていたことや、人出回復による販売量の増加や価格改定による納価改善で増収となった一方、原材料価格の高騰や円安によるコスト増加などから赤字幅が拡大したコカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングスの保有を高め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、1万口当たり2,105円の分配を行いました。

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24期
	2022年6月23日～ 2023年6月22日
当期分配金	2,105
(対基準価額比率)	17.390%
当期の収益	1,969
当期の収益以外	135
翌期繰越分配対象額	2,587

(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

(2022年6月23日～2023年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 135	% 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 ）	( 62 )	( 0.605 )	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	( 62 )	( 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	0.002	(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 )	( 0.001 )	
(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 )	( 0.001 )	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	136	1.328	
期中の平均基準価額は、10,221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。

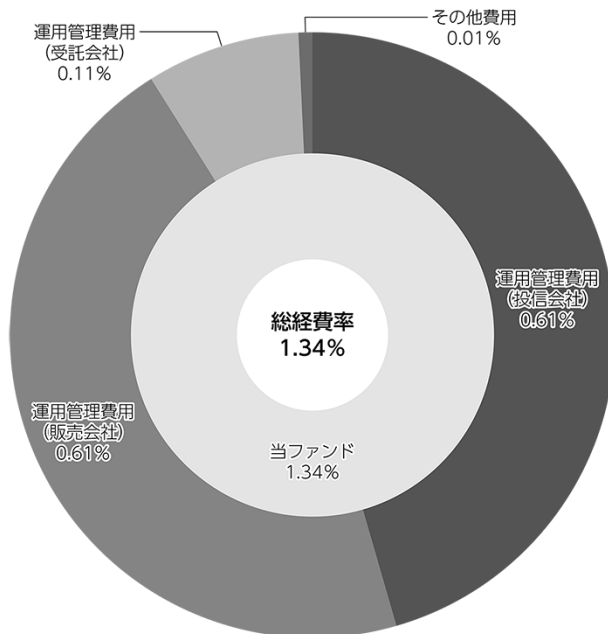
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます。)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。



(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

(2022年6月23日～2023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 180	百万円 200	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 -	千円 -	千口 12,975	千円 32,000

## ○株式売買比率

(2022年6月23日～2023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	20,663,972千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,995,253千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	6.89	

(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

(2022年6月23日～2023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

(2023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 45	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 1,318,936	千口 1,305,960	千円 3,736,745

(注) 親投資信託の当期末の受益権総口数は、1,305,960千口です。

## ○投資信託財産の構成

(2023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 3,736,745	% 98.4
コール・ローン等、その他	62,493	1.6
投資信託財産総額	3,799,238	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年6月22日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	3,797,553,834	
コール・ローン等	59,118,466	
朝日ライフ クオソツ 日本株マザーファンド(評価額)	3,736,745,368	
未収入金	1,545,000	
差入委託証拠金	145,000	
(B) 負債	679,746,433	
未払収益分配金	656,276,181	
未払解約金	1,440,201	
未払信託報酬	21,936,990	
未払利息	176	
その他未払費用	92,885	
(C) 純資産総額(A-B)	3,117,807,401	
元本	3,117,701,576	
次期繰越損益金	105,825	
(D) 受益権総口数	3,117,701,576口	
1万口当たり基準価額(C/D)	10,000円	

(注) 期首元本額は3,128,013,743円、期中追加設定元本額は5,740,814円、期中一部解約元本額は16,052,981円です。

○損益の状況 (2022年6月23日～2023年6月22日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	△ 46,389	
支払利息	△ 46,389	
(B) 有価証券売買損益	833,467,313	
売買益	835,299,258	
売買損	△ 1,831,945	
(C) 先物取引等取引損益	10,580,652	
取引益	10,629,065	
取引損	△ 48,413	
(D) 信託報酬等	△ 42,630,838	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	801,370,738	
(F) 前期繰越損益金	△145,325,338	
(G) 追加信託差損益金	336,606	
(配当等相当額)	( 806,892,507)	
(売買損益相当額)	(△806,555,901)	
(H) 計(E+F+G)	656,382,006	
(I) 収益分配金	△656,276,181	
次期繰越損益金(H+I)	105,825	
追加信託差損益金	24,836	
(配当等相当額)	( 806,590,818)	
(売買損益相当額)	(△806,565,982)	
分配準備積立金	80,989	

(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(83,225,482円)、費用控除後の有価証券等損益額(530,865,919円)、信託約款に規定する収益調整金(806,902,588円)および分配準備積立金(41,953,999円)より分配対象収益は1,462,947,988円(10,000口当たり4,692円)であり、うち656,276,181円(10,000口当たり2,105円)を分配金額としています。

## ○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金 (税込み)	2,105円
------------------	--------

- ◇収益分配金のお支払いは、決算日から起算して5営業日までに開始します。
- ◇収益分配金を再投資する方のお手取り収益分配金は、決算日の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰入れて再投資しました。
- ◇課税上の取扱い
  - ・追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)とがあります。
  - ・収益分配金落ち後の基準価額が、当該受益者の個別元本と同額または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。収益分配金落ち後の基準価額が、当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。
  - ・受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。
  - ・個人の受益者の普通分配金については、20.315%(所得税および復興特別所得税15.315%、地方税5%)の税率による源泉徴収が行われ、原則として確定申告の必要はありません。なお、確定申告を行い、総合課税(配当控除の適用はありません。)または申告分離課税を選択することもできます。
  - ・法人の受益者の場合は、税率が異なります。

※上記は、決算日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。  
※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

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			
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
24期(2023年6月22日)	28,613	28.6	2,296.50	24.0	76.5	4.9	3,736

(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 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	円	騰 落 率	[ベンチマーク]	騰 落 率		
(期 首) 2022年6月22日	22,241	% —	1,852.65	% —	% 95.8	% 3.8
6月末	22,410	0.8	1,870.82	1.0	95.6	3.8
7月末	23,207	4.3	1,940.31	4.7	95.7	3.8
8月末	23,371	5.1	1,963.16	6.0	95.6	3.8
9月末	22,100	△ 0.6	1,835.94	△ 0.9	94.2	5.0
10月末	23,282	4.7	1,929.43	4.1	94.5	5.0
11月末	24,038	8.1	1,985.57	7.2	94.7	5.0
12月末	23,188	4.3	1,891.71	2.1	95.1	4.4
2023年1月末	24,207	8.8	1,975.27	6.6	95.2	4.4
2月末	24,717	11.1	1,993.28	7.6	95.4	4.3
3月末	25,070	12.7	2,003.50	8.1	94.4	4.9
4月末	25,750	15.8	2,057.48	11.1	94.5	4.9
5月末	26,660	19.9	2,130.63	15.0	94.7	4.9
(期 末) 2023年6月22日	28,613	28.6	2,296.50	24.0	76.5	4.9

(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

(2022年6月23日～2023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)	0.001 (0.001)	(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	0.003	
期中の平均基準価額は、24,000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

(2022年6月23日～2023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		5,150	10,001,350	5,226	10,662,622
		( 50)	( -)		

(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		1,312	1,276	-	-

(注) 金額は受渡代金です。

## ○株式売買比率

(2022年6月23日～2023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	20,663,972千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,995,253千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	6.89

(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

(2022年6月23日～2023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

(2023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
<b>鉱業 (1.5%)</b>			
三井松島ホールディングス	1	—	—
I N P E X	27.5	25.8	41,976
<b>建設業 (0.5%)</b>			
三井住友建設	14.7	—	—
五洋建設	—	16.3	12,629
きんでん	10.2	—	—
<b>食料品 (4.0%)</b>			
DM三井製糖ホールディングス	—	4.2	11,377
日本ハム	—	8.3	32,660
キリンホールディングス	—	5.3	11,556
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	—	16.3	25,387
アリアケジャパン	1.5	—	—
東洋水産	—	5	32,820
日本たばこ産業	10.5	—	—
<b>繊維製品 (—%)</b>			
ワコールホールディングス	3.1	—	—
<b>パルプ・紙 (0.4%)</b>			
レンゴー	—	13.7	12,066
<b>化学 (2.9%)</b>			
クラレ	9.6	—	—
レゾナック・ホールディングス	2.7	—	—
東ソー	4.8	—	—
信越化学工業	3.4	12.9	59,881
森六ホールディングス	4.8	—	—
中国塗料	—	7	8,267
富士フイルムホールディングス	—	1.8	15,541
日東電工	3.9	—	—
<b>医薬品 (6.3%)</b>			
武田薬品工業	16.9	4.2	19,273
アステラス製薬	1.7	19.8	43,668
塩野義製薬	—	5.4	33,507
中外製薬	10.7	—	—
小野薬品工業	6.9	11.2	31,085
第一三共	3.4	4.2	19,513
大正製薬ホールディングス	—	6.1	33,068
<b>石油・石炭製品 (—%)</b>			
コスモエネルギーホールディングス	4	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>ゴム製品 (—%)</b>			
ブリヂストン	5.4	—	—
<b>ガラス・土石製品 (—%)</b>			
A G C	5.4	—	—
日本電気硝子	3.1	—	—
日本特殊陶業	11.8	—	—
ニチハ	4.1	—	—
<b>鉄鋼 (2.1%)</b>			
日本製鉄	6.7	—	—
神戸製鋼所	18.7	31.9	42,427
J F Eホールディングス	18.5	2.4	4,851
共英製鋼	—	6.1	12,139
大和工業	8.6	—	—
新日本電工	18.3	—	—
<b>金属製品 (1.2%)</b>			
東洋製罐グループホールディングス	5	—	—
リンナイ	—	11.2	34,316
<b>機械 (3.9%)</b>			
アマダ	14.9	—	—
DMG森精機	8.6	—	—
ディスコ	0.3	—	—
SMC	0.1	0.1	8,037
クボタ	—	6.5	13,968
新東工業	—	6.2	6,516
ダイキン工業	0.4	0.5	14,657
SANKYO	1.6	—	—
セガサミーホールディングス	—	10.5	31,762
T P R	3.6	7.4	11,847
日本精工	—	26.7	23,920
<b>電気機器 (19.0%)</b>			
イビデン	2.5	—	—
ブラザー工業	—	16.3	36,088
日立製作所	3.1	2.1	18,753
富士電機	—	4.9	31,129
マブチモーター	—	2.3	9,204
ニデック	0.5	5.9	46,214
富士通	0.8	—	—
サンケン電気	—	2.3	27,577
ルネサスエレクトロニクス	18.2	18	45,828

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルバック	2.3	—	—
バナソニック ホールディングス	—	29	49,474
ソニーグループ	8.2	5.1	67,830
ヒロセ電機	0.5	1.6	30,832
アドバンテスト	2	—	—
エスベック	4.8	3.6	8,416
キーエンス	0.7	0.6	41,298
イリゾ電子工業	2.4	—	—
日本セラミック	4.2	—	—
ファナック	0.7	1	5,162
新光電気工業	—	5.5	30,129
京セラ	—	4.9	38,489
太陽誘電	1.4	—	—
村田製作所	1	0.8	6,548
S C R E E Nホールディングス	2.4	2	31,250
キヤノン	0.9	—	—
東京エレクトロン	1.2	1	19,620
<b>輸送用機器 (11.0%)</b>			
豊田自動織機	—	4.5	46,890
三菱ロジスネクスト	—	9.3	11,894
日産自動車	—	75.7	40,734
いすゞ自動車	—	10.8	18,889
トヨタ自動車	45.9	39.2	87,827
三菱自動車工業	13.6	—	—
日産車体	18.9	—	—
トビー工業	7.1	—	—
NOK	8.1	—	—
アイシン	—	7.4	32,204
マツダ	8.7	—	—
本田技研工業	13.9	3.1	13,683
S U B A R U	—	14.2	37,992
エクセディ	7.7	5.7	13,366
エフ・シー・シー	—	6.7	12,321
シマノ	1.1	—	—
<b>精密機器 (1.9%)</b>			
オリンパス	—	7.7	18,068
H O Y A	4.1	1.4	23,828
シチズン時計	9.7	14.3	12,598
<b>その他製品 (0.6%)</b>			
任天堂	0.4	2.8	17,690
<b>電気・ガス業 (1.1%)</b>			
関西電力	6.1	4.9	8,849
四国電力	8	6.5	6,448

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
九州電力	10	8.1	7,287
東京瓦斯	2.1	1.7	5,421
大阪瓦斯	2.1	1.7	3,818
<b>陸運業 (0.6%)</b>			
S B Sホールディングス	—	2.5	8,225
西武ホールディングス	18.5	—	—
鴻池運輸	7.5	—	—
トナミホールディングス	—	1.9	8,493
セイノーホールディングス	4.2	—	—
<b>海運業 (—%)</b>			
日本郵船	4.4	—	—
乾汽船	4	—	—
<b>空運業 (1.3%)</b>			
ANAホールディングス	—	11.2	37,441
<b>情報・通信業 (12.1%)</b>			
N E C ネットエスアイ	5.7	—	—
システナ	—	36.6	11,346
デジタルアーツ	1.4	—	—
グリー	—	16.3	10,611
ネクソン	4.3	9.2	26,082
S H I F T	—	1.1	30,134
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	10.8	—	—
インターネットイニシアティブ	1.2	8.3	23,406
マネーフォワード	—	1.6	9,601
プロトコーポレーション	—	9	10,242
フジ・メディア・ホールディングス	27.8	—	—
オービック	1	—	—
ジャストシステム	3.8	—	—
Zホールディングス	—	74.2	26,578
オービックビジネスコンサルタント	1.5	—	—
ネットワンシステムズ	—	8.7	28,701
T B Sホールディングス	17.2	15	38,077
日本テレビホールディングス	24.7	—	—
テレビ朝日ホールディングス	—	7.2	11,368
日本電信電話	14.1	16.3	67,433
K D D I	14.8	3	13,371
ソフトバンク	37	4.5	6,851
松竹	0.9	—	—
エヌ・ティ・ティ・データ	8.2	12.1	24,907
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.8	—	—
カブコン	8.7	—	—
S C S K	10.7	—	—
ミロク情報サービス	7.4	—	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ソフトバンクグループ	3.8	1.2	—	8,144
<b>卸売業 (3.2%)</b>				
小野建	6.3	5.4	—	8,704
ナガイレーベン	6.2	—	—	—
第一興商	2.5	—	—	—
メディバルホールディングス	—	4	—	9,600
伊藤忠商事	2.6	2.3	—	13,517
丸紅	18.1	—	—	—
蝶理	3	—	—	—
三井物産	17.7	2.9	—	16,843
カメイ	—	6.7	—	9,694
山善	—	9.9	—	11,484
住友商事	23.6	—	—	—
三菱商事	14.3	2.9	—	21,233
新光商事	7.7	—	—	—
<b>小売業 (7.1%)</b>				
ローソン	—	4.5	—	28,462
エービーシー・マート	1.1	—	—	—
アルペン	4.6	—	—	—
ジンスホールディングス	2	—	—	—
三越伊勢丹ホールディングス	29	—	—	—
すかいらーくホールディングス	—	15.5	—	29,016
コスモス薬品	1	—	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	1.2	7.5	—	44,910
FOOD & LIFE COMPANIES	—	5.7	—	17,191
良品計画	25.3	16.2	—	22,372
アドヴァングループ	7.3	—	—	—
ユナイテッドアローズ	3.1	—	—	—
スギホールディングス	3.2	—	—	—
日本瓦斯	2.3	—	—	—
しまむら	—	2.3	—	32,671
ゼビオホールディングス	10.3	8.4	—	9,324
ニトリホールディングス	2.8	—	—	—
ファーストリテイリング	—	0.5	—	18,450
サンドラッグ	10.1	—	—	—
<b>銀行業 (6.2%)</b>				
めぶきフィナンシャルグループ	24.9	20.1	—	6,946
三菱UFJフィナンシャル・グループ	67.2	51	—	52,708
りそなホールディングス	17.9	9.7	—	6,683
三井住友トラスト・ホールディングス	1.7	1.4	—	7,127
三井住友フィナンシャルグループ	9	7.9	—	47,692
群馬銀行	15.3	12.4	—	6,488
八十二銀行	16.9	13.7	—	8,602
みずほフィナンシャルグループ	19.8	16	—	34,560
山口フィナンシャルグループ	8	6.5	—	6,146

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
<b>証券、商品先物取引業 (0.5%)</b>				
SBIホールディングス	1.3	2.3	—	6,414
野村ホールディングス	26	14.3	—	7,930
<b>保険業 (3.0%)</b>				
かんぽ生命保険	5.2	2.7	—	5,790
SOMPOホールディングス	2.7	2.2	—	14,471
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	3.4	2.8	—	14,607
第一生命ホールディングス	5.5	4.4	—	11,921
東京海上ホールディングス	2.2	7.4	—	24,901
T&Dホールディングス	8.5	6.9	—	14,576
<b>その他金融業 (1.3%)</b>				
クレディセゾン	3.8	3.1	—	6,539
芙蓉総合リース	0.8	0.7	—	8,141
オリックス	6.6	5.3	—	13,774
三菱HCキャピタル	12.1	9.8	—	8,399
<b>不動産業 (3.0%)</b>				
オープンハウスグループ	3.3	—	—	—
飯田グループホールディングス	8.8	—	—	—
三菱地所	—	24.3	—	42,913
住友不動産	—	11.8	—	43,825
<b>サービス業 (5.3%)</b>				
リンクアンドモチベーション	20.2	—	—	—
総合警備保障	—	8.6	—	34,778
カカココム	—	14.2	—	30,288
ディップ	2	—	—	—
エムスリー	3.5	—	—	—
アウトソーシング	—	8.5	—	11,946
パリュエコマース	—	7.8	—	11,021
プレステージ・インターナショナル	13.9	17.6	—	11,774
電通グループ	5	—	—	—
オリエンタルランド	0.4	1.6	—	8,488
ラウンドワン	7.2	18.7	—	10,995
リクルートホールディングス	5.1	2.9	—	13,371
ソラスト	10.9	—	—	—
東京都競馬	1.6	—	—	—
カナモト	6.3	—	—	—
トランス・コスモス	—	3.4	—	12,155
セコム	0.8	—	—	—
丹青社	—	9.7	—	7,633
合 計	株数・金額	1,299	1,273	2,860,492
	銘柄数<比率>	158	132	<76.5%>

(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	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 183	百万円 —

## ○投資信託財産の構成

(2023年6月22日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
株式	千円 2,860,492	% 76.4
コール・ローン等、その他	885,565	23.6
投資信託財産総額	3,746,057	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年6月22日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,764,187,685 円
コール・ローン等	825,169,379
株式(評価額)	2,860,492,930
未収入金	6,180,000
未収配当金	26,491,376
差入委託証拠金	45,854,000
(B) 負債	27,386,598
未払金	2,509,950
未払利息	2,464
差入委託証拠金代用有価証券	24,870,000
その他未払費用	4,184
(C) 純資産総額(A-B)	3,736,801,087
元本	1,305,960,706
次期繰越損益金	2,430,840,381
(D) 受益権総口数	1,305,960,706口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,613円

(注) 期首元本額は1,318,936,703円、期中追加設定元本額は—円、期中一部解約元本額は12,975,997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1,305,960,706円です。

## ○損益の状況 (2022年6月23日～2023年6月22日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	87,935,401 円
受取配当金	88,066,440
その他収益金	1,885
支払利息	△ 132,924
(B) 有価証券売買損益	710,733,285
売買益	917,235,680
売買損	△ 206,502,395
(C) 先物取引等取引損益	36,679,400
取引益	39,189,350
取引損	△ 2,509,950
(D) 保管費用等	△ 17,977
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	835,330,109
(F) 前期繰越損益金	1,614,534,275
(G) 解約差損益金	△ 19,024,003
(H) 計(E+F+G)	2,430,840,381
次期繰越損益金(H)	2,430,840,381

(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)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。