

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	朝日ライフクオントツ日本株オープン	朝日ライフクオント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。
	朝日ライフクオントツ日本株マザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式を主要投資対象とします。
組入制限	朝日ライフクオントツ日本株オープン	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。
	朝日ライフクオント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 クオントツ 日本株オープン

第16期

(決算日 2015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「朝日ライフクオントツ日本株オープン」は、2015年6月22日に第16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：<http://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。一印は、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)	税金分配	み期騰落率	[ベンチマーク]	騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
12期(2011年6月22日)	4,428	0	△ 6.2	828.99	△ 7.3	94.7	3.9	1,276
13期(2012年6月22日)	4,064	0	△ 8.2	750.92	△ 9.4	93.0	5.1	1,168
14期(2013年6月24日)	5,858	0	44.1	1,089.64	45.1	94.1	5.3	1,643
15期(2014年6月23日)	7,034	0	20.1	1,267.48	16.3	92.4	7.0	1,274
16期(2015年6月22日)	9,401	0	33.7	1,648.61	30.1	95.8	4.0	2,058

(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) 2014年6月23日	円 7,034	% -	1,267.48	% -	92.4	7.0
6月末	7,016	△ 0.3	1,262.56	△ 0.4	92.4	7.0
7月末	7,128	1.3	1,289.42	1.7	92.4	7.0
8月末	7,064	0.4	1,277.97	0.8	92.6	7.0
9月末	7,347	4.4	1,326.29	4.6	92.1	7.0
10月末	7,369	4.8	1,333.64	5.2	92.1	7.0
11月末	7,894	12.2	1,410.34	11.3	92.5	6.9
12月末	7,883	12.1	1,407.51	11.0	92.5	6.9
2015年1月末	7,959	13.2	1,415.07	11.6	92.7	6.9
2月末	8,565	21.8	1,523.85	20.2	93.1	5.9
3月末	8,824	25.4	1,543.11	21.7	57.2	41.4
4月末	9,108	29.5	1,592.79	25.7	95.0	4.2
5月末	9,565	36.0	1,673.65	32.0	95.7	4.0
(期末) 2015年6月22日	9,401	33.7	1,648.61	30.1	95.8	4.0

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

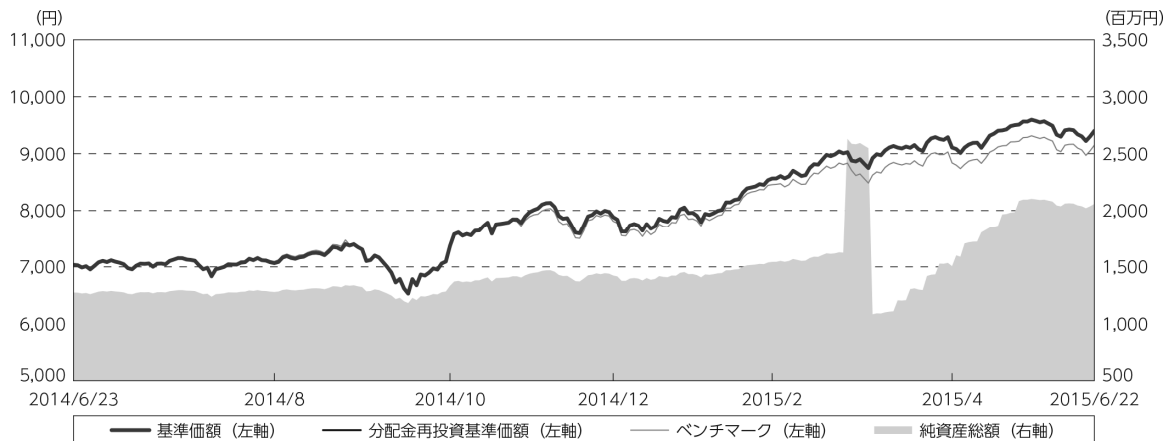
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比で計算しています。

(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

当期中の基準価額等の推移 (2014年6月24日～2015年6月22日)



期首：7,034円

期末：9,401円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：33.7% (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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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(2014年6月23日)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、日銀やECB(欧州中央銀行)をはじめとして世界的に追加金融緩和が実施されたこと、米国を中心とした世界経済の回復や円安ドル高の進行などによる企業業績の上方修正期待、日銀やGPIF(年金積立金管理運用独立行政法人)による株式の買い増しなどが挙げられます。

主な下落要因として、イラクやウクライナなど地政学的リスクやギリシャのデフォルト(債務不履行)懸念、原油価格の急落によるリスク回避的な動きの高まりなどが挙げられます。

○投資環境

当期の株式市場は、堅調な米国経済指標を背景とした円安ドル高の進行や好調な企業業績から上昇して始まりました。2014年8月上旬は米雇用統計が市場予想を下回ったことや、ドラギECB総裁の欧州景気下振れリスクへの言及、イラクへの限定的な空爆の承認などから一旦下落に転じましたが、ウクライナ情勢への懸念の後退や米国の早期利上げ観測が強まり円安ドル高が進行すると反発し、9月に入ってもECBが政策金利引き下げを含む追加金融緩和を発表したことなどを好感し、緩やかな上昇基調となりました。

10月に入り、IMF(国際通貨基金)による世界経済見通しの下方修正やエボラ出血熱の感染拡大などを嫌気して欧米株式が下落、円高ドル安が進行すると急落し、TOPIX(東証株価指数)は10月17日に期中最安値となる1,177.22ポイントをつけましたが、米国の経済指標が軒並み上振れると急反発に転じ、10月31日には市場参加者の意表をついた日銀の追加金融緩和およびGPIFによる新しい資産配分の目安が発表され、11月には安倍首相が消費増税の先送りと衆議院解散・総選挙実施を表明、また一段の円安ドル高の進行で企業業績の上方修正期待が高まると大幅に上昇しました。

その後、原油価格の急落から反落する場面もありましたが、2015年年明け後は、①ECBによる市場参加者の期待を上回る量的緩和の決定、②ギリシャへの金融支援の延長合意、③イエレンFRB(米連邦準備理事会)議長による年内の利上げの示唆を受けた円安ドル高の進行などから再度上昇基調となり、6月1日にTOPIXは期中最高値となる1,678.56ポイントをつけました。その後はギリシャのデフォルト懸念の高まりからやや下落し、期末である6月22日にTOPIXは1,648.61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ন্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。銘柄の選定に当たっては、当社が独自に開発したクオন্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。

○当ファンドのベンチマークとの差異

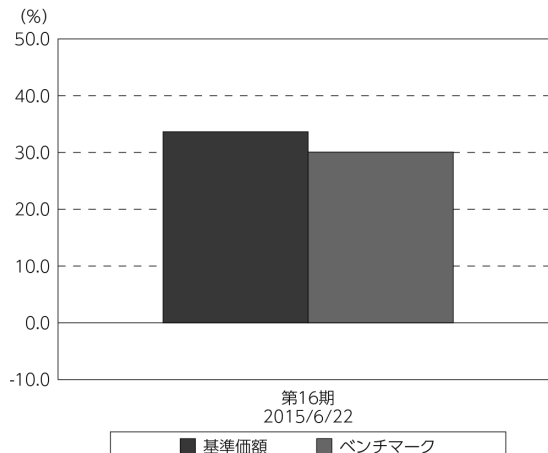
当ファンドは「TOPIX(東証株価指数)」をベンチマークとします。

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30.1%上昇したのに対し、基準価額は33.7%の上昇となり、ベンチマークを3.6%上回る結果となりました。“バリュエーション指標”や“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「電気機器」や「ゴム製品」の保有が多かったことなどがプラスの乖離要因となりました。一方で、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、任天堂との資本・業務提携を発表し、同社のキャラクターとスマートフォン向けゲームとの相乗効果が期待されるディー・エヌ・エー、北米市場を中心にタイヤ販売が好調で円安・原油安の恩恵も受けやすく業績の上方修正期待が高まった東洋ゴム工業の保有が多かったことはプラスに寄与しましたが、夏場の天候不順や消費税率引き上げの影響により業績を下方修正したコカ・コーラーストジャパン、米国やタイでの自動車シート販売で苦戦し2014年度下期の業績動向に不透明感を残したテイ・エステックの保有を高めていたことは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(別期騰落率)



(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16期
	2014年6月24日～ 2015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	2,412

(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

(2014年6月24日～2015年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	103	1.292	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(47)	(0.596)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(47)	(0.589)	交付運用報告書等各種書類の送付、口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 ）	(9)	(0.108)	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	26	0.329	(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
（ 株 式 ）	(24)	(0.302)	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。
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(2)	(0.027)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.005	(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 ）	(0)	(0.005)	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。
合 計	129	1.626	
期中の平均基準価額は、7,976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。

○ 売買及び取引の状況

(2014年6月24日～2015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 2,099	百万円 2,105	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 クオンツ 日本株マザーファンド	千口 573,036	千円 921,000	千口 348,218	千円 520,000

○株式売買比率

(2014年6月24日～2015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 クオンツ 日本株マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	7,145,691千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,359,361千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	5.25	

(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

(2014年6月24日～2015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

(2015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 T O P I X	百万円 49	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 クオンツ 日本株マザーファンド	千口 1,026,476	千口 1,251,294	千円 2,012,456

(注) 親投資信託の当期末の受益権総口数は、1,251,294千口です。

○投資信託財産の構成

(2015年6月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
朝日ライフ クオント 日本株マザーファンド	2,012,456	97.2
コール・ローン等、その他	57,674	2.8
投資信託財産総額	2,070,130	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年6月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,070,130,689
コール・ローン等	55,142,237
朝日ライフ クオント 日本株マザーファンド(評価額)	2,012,456,437
未収利息	15
差入委託証拠金	2,532,000
(B) 負債	11,581,677
未払金	567,000
未払解約金	576,372
未払信託報酬	10,395,052
その他未払費用	43,253
(C) 純資産総額(A-B)	2,058,549,012
元本	2,189,797,753
次期繰越損益金	△ 131,248,741
(D) 受益権総口数	2,189,797,753口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,401円

(注) 期首元本額は1,811,132,793円、期中追加設定元本額は2,107,462,269円、期中一部解約元本額は1,728,797,309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)131,248,741円

○損益の状況 (2014年6月24日～2015年6月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	13,097
受取利息	13,097
(B) 有価証券売買損益	207,207,022
売買益	388,709,239
売買損	△181,502,217
(C) 先物取引等取引損益	24,345,970
取引益	35,624,644
取引損	△ 11,278,674
(D) 信託報酬等	△ 19,070,213
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	212,495,876
(F) 前期繰越損益金	△ 53,201,251
(G) 追加信託差損益金	△290,543,366
(配当等相当額)	(363,943,192)
(売買損益相当額)	(△654,486,558)
(H) 計(E+F+G)	△131,248,741
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(H+I)	△131,248,741
追加信託差損益金	△290,543,366
(配当等相当額)	(368,934,769)
(売買損益相当額)	(△659,478,135)
分配準備積立金	159,294,625

(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(25,389,535円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(64,301,209円)、信託約款に規定する収益調整金(368,934,769円)および分配準備積立金(69,603,881円)より分配可能額は528,229,394円(10,000口当たり2,412円)ですが、当期は分配を行いませんでした。

《約款変更のお知らせ》

投資信託及び投資法人に関する法律の改正に伴い、同法第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供すること、および受益者から運用報告書の交付の請求があった場合にはこれを交付する旨を2014年12月1日付で信託約款に新たに設けました。また、その他法改正に伴う信託約款の関連条項に所要の変更を行いました。

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	東京証券取引所第一部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			
12期(2011年6月22日)	7,230	△ 4.9	828.99	△ 7.3	98.0	—	1,233
13期(2012年6月22日)	6,724	△ 7.0	750.92	△ 9.4	98.0	—	1,109
14期(2013年6月24日)	9,792	45.6	1,089.64	45.1	99.2	—	1,557
15期(2014年6月23日)	11,908	21.6	1,267.48	16.3	96.3	3.1	1,222
16期(2015年6月22日)	16,083	35.1	1,648.61	30.1	98.0	1.6	2,012

(注) 基準価額は1万円当たりの値です。

(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) 2014年6月23日	円 11,908	% —		% —	% 96.3	% 3.1
6月末	11,880	△ 0.2	1,262.56	△ 0.4	96.3	3.1
7月末	12,079	1.4	1,289.42	1.7	96.2	3.1
8月末	11,986	0.7	1,277.97	0.8	96.3	3.1
9月末	12,477	4.8	1,326.29	4.6	95.5	3.1
10月末	12,525	5.2	1,333.64	5.2	96.2	3.1
11月末	13,441	12.9	1,410.34	11.3	96.3	3.1
12月末	13,439	12.9	1,407.51	11.0	96.2	3.1
2015年1月末	13,586	14.1	1,415.07	11.6	96.2	3.1
2月末	14,637	22.9	1,523.85	20.2	96.4	3.1
3月末	15,120	27.0	1,543.11	21.7	95.5	3.0
4月末	15,548	30.6	1,592.79	25.7	97.4	2.2
5月末	16,352	37.3	1,673.65	32.0	98.0	1.6
(期 末) 2015年6月22日	16,083	35.1	1,648.61	30.1	98.0	1.6

(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2～5ページをご覧ください。

○1万口当たりの費用明細

(2014年6月24日～2015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	円 47	% 0.342	(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。
(株 式)	(45)	(0.329)	
(先物・オプション)	(2)	(0.013)	
合 計	47	0.342	
期中の平均基準価額は、13,589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

(2014年6月24日～2015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		3,523 (3)	3,794,120 (-)	3,022	3,351,571

(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		1,082	1,095	-	-

(注) 金額は受渡代金です。

○株式売買比率

(2014年6月24日～2015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	7,145,691千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,359,361千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	5.25

(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

(2014年6月24日～2015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

(2015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
水産・農林業 (0.3%)			
日本水産	11.7	17.8	6,372
鉱業 (-%)			
日鉄鉱業	11	—	—
石油資源開発	2.7	—	—
建設業 (0.9%)			
清水建設	24	—	—
長谷工コーポレーション	—	12.5	17,650
積水ハウス	12	—	—
ユアテック	8	—	—
中電工	3.1	—	—
食料品 (3.6%)			
カルビー	—	4	20,400
プリマハム	—	20	7,680
麒麟ホールディングス	—	14.1	24,491
日清オイリオグループ	14	17	8,908
日本たばこ産業	1.9	2.3	10,304
繊維製品 (0.2%)			
日本バイリーン	—	5	4,040
ワコールホールディングス	4	—	—
化学 (3.0%)			
旭化成	—	21	21,441
昭和電工	—	143	23,595
東ソー	31	—	—
セントラル硝子	13	—	—
信越化学工業	0.5	0.4	2,935
日本合成化学工業	5	—	—
花王	—	0.4	2,375
日本ペイントホールディングス	—	0.9	3,213
日本農薬	—	4.8	5,476
医薬品 (7.2%)			
武田薬品工業	1.4	1.3	7,823
アステラス製薬	2.5	21.4	38,541
塩野義製薬	—	4.2	19,005
小野薬品工業	—	2.1	28,140

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
久光製薬	2.7	4.7	23,312
参天製薬	—	14.6	25,827
大塚ホールディングス	6	—	—
石油・石炭製品 (2.9%)			
昭和シェル石油	8.9	—	—
コスモ石油	—	19	3,895
ニチレキ	4	3	3,204
富士石油	14.6	17.9	8,753
出光興産	—	10.4	25,074
J Xホールディングス	—	29.5	15,546
ゴム製品 (1.6%)			
ブリヂストン	5.7	4.6	21,988
住友ゴム工業	—	5	9,965
ガラス・土石製品 (1.9%)			
旭硝子	—	33	24,420
日本電気硝子	—	5	3,090
住友大阪セメント	—	13	5,967
フジミインコーポレーテッド	—	2.5	4,760
鉄鋼 (1.8%)			
新日鐵住金	9	110	35,277
合同製鐵	32	—	—
ジェイ エフ イー ホールディングス	8.5	—	—
非鉄金属 (-%)			
アサヒホールディングス	2.7	—	—
金属製品 (1.2%)			
三協立山	—	3.3	6,920
岡部	—	7.8	7,823
ジーテクト	—	6.8	8,391
機械 (2.2%)			
ツガミ	8	—	—
オーエスジー	2.9	—	—
ディスコ	1.7	—	—
小松製作所	4	4.2	10,684
平和	7	—	—
セガサミーホールディングス	—	14.2	23,586

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
T P R	—	2.3	8,452
三菱重工業	27	—	—
電気機器 (11.5%)			
ブラザー工業	9.7	—	—
日立製作所	6	5	4,148
三菱電機	1	1	1,619
富士電機	20	—	—
マブチモーター	—	3.1	24,645
日東工業	2.3	1.5	4,231
富士通	26	—	—
セイコーエプソン	4.5	—	—
ジャパンディスプレイ	—	47.7	24,517
日本無線	10	—	—
パナソニック	1.3	2.7	4,630
ソニー	—	2.4	8,956
T D K	3.3	—	—
アルプス電気	4	—	—
フォスター電機	—	2.3	6,430
ヒロセ電機	1	—	—
アドバンテスト	—	15.5	19,716
キーエンス	—	0.3	20,550
ファナック	0.5	0.4	10,490
エンプラス	0.7	—	—
村田製作所	—	1.2	25,200
ニチコン	5.4	—	—
小糸製作所	4.4	—	—
スター精密	3.5	—	—
キャノン電子	2.3	—	—
キャノン	7.7	10.2	42,712
リコー	13	—	—
東京エレクトロン	—	3.7	29,156
輸送用機器 (11.1%)			
鬼怒川ゴム工業	9	—	—
デンソー	3.6	3.1	19,337
日産自動車	1.6	2.1	2,597
いすゞ自動車	7	—	—
トヨタ自動車	10.3	9.9	82,140
三菱自動車工業	2.6	—	—
カヤバ工業	—	17	7,616
河西工業	—	6.4	8,096

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
本田技研工業	4	5	20,362
富士重工業	7.3	5.8	26,294
ショーワ	—	6.4	7,872
シマノ	—	1.3	21,944
テイ・エス テック	5.1	6.8	22,372
精密機器 (2.9%)			
テルモ	—	8.6	24,897
HOYA	5.8	6.7	32,897
その他製品 (1.3%)			
大日本印刷	—	15	19,275
ツツミ	0.6	—	—
任天堂	—	0.3	6,000
電気・ガス業 (2.0%)			
中部電力	3.9	5	9,272
関西電力	—	5.9	7,982
北陸電力	—	3.1	5,797
四国電力	1.9	—	—
北海道電力	2.3	—	—
電源開発	1.2	1.5	6,630
東京瓦斯	8	9	6,156
大阪瓦斯	6	8	3,992
陸運業 (2.4%)			
東日本旅客鉄道	0.3	0.4	4,442
西日本旅客鉄道	3.7	—	—
東海旅客鉄道	1.6	0.9	19,341
南海電気鉄道	27	—	—
京阪電気鉄道	22	—	—
セイノーホールディングス	—	16.6	23,555
海運業 (2.3%)			
日本郵船	—	67	22,981
商船三井	40	—	—
川崎汽船	15	79	22,278
空運業 (0.8%)			
日本航空	1.1	3.9	15,678
情報・通信業 (11.1%)			
グリー	12.5	—	—
コーエーテクモホールディングス	3.6	—	—
ネクソン	—	8.7	15,381
ティーガイア	—	5	9,255
オービック	—	0.7	3,787

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
ジャストシステム	4.4	—	—	—
伊藤忠テクノソリューションズ	3.1	—	—	—
スカパーJ S A Tホールディングス	—	26.1	17,173	—
日本電信電話	1.4	6	52,242	—
KDD I	4.4	16.5	47,924	—
NTTドコモ	1	11.8	27,334	—
エヌ・ティ・ティ・データ	—	4.7	24,863	—
ソフトバンク	2.2	2.8	20,493	—
卸売業 (3.4%)				
双日	84.4	—	—	—
伊藤忠商事	5.1	—	—	—
兼松	—	43	9,116	—
三井物産	1.6	—	—	—
カメイ	—	8.3	9,603	—
山善	6.7	3.3	3,758	—
三菱商事	1.7	2.1	5,829	—
キャノンマーケティングジャパン	—	7.9	16,985	—
阪和興業	—	17	9,520	—
菱電商事	4	—	—	—
稲畑産業	4.5	2.8	3,866	—
東陽テクニカ	4	—	—	—
日鉄住金物産	—	19	8,436	—
小売業 (7.2%)				
ローソン	2.1	—	—	—
エディオン	6.5	8.3	7,486	—
コスモス薬品	—	1.5	25,440	—
セブン&アイ・ホールディングス	1.2	1.1	5,727	—
ファミリーマート	3.1	4.4	24,376	—
イオン	—	18.7	30,920	—
ユニーグループ・ホールディングス	7.8	—	—	—
ニトリホールディングス	1.9	1.1	10,560	—
パロー	—	3.3	9,777	—
ファーストリテイリング	—	0.5	26,955	—
銀行業 (9.3%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	55.1	72.4	64,363	—
三井住友トラスト・ホールディングス	12	15	8,368	—
三井住友フィナンシャルグループ	5.8	7.4	39,812	—
千葉銀行	6	8	7,608	—
横浜銀行	10	13	9,937	—

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
ふくおかフィナンシャルグループ	11	13	8,554	—
スルガ銀行	1	2.4	6,530	—
広島銀行	10	8	5,968	—
みずほフィナンシャルグループ	109.2	125.6	32,480	—
証券、商品先物取引業 (1.3%)				
大和証券グループ本社	5	9	8,401	—
野村ホールディングス	16.9	21.6	17,526	—
保険業 (2.9%)				
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	2.3	1.7	7,610	—
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	1.5	3.1	11,621	—
第一生命保険	5.7	6	14,334	—
東京海上ホールディングス	3	3.3	16,681	—
T & Dホールディングス	2.5	3.2	5,947	—
その他金融業 (0.9%)				
クレディセゾン	1.3	1.7	4,471	—
オリックス	5.7	7.2	13,384	—
不動産業 (0.7%)				
野村不動産ホールディングス	7	—	—	—
三井不動産	1	1	3,550	—
三菱地所	2	1	2,684	—
スターツコーポレーション	—	1.9	3,655	—
タカラレーベン	—	6.4	4,832	—
サービス業 (2.1%)				
クックパッド	—	1.5	9,270	—
スタジアムアリス	—	3.5	7,476	—
総合警備保障	5.6	—	—	—
ディー・エヌ・エー	8.4	—	—	—
オリエンタルランド	—	2.1	16,881	—
ラウンドワン	—	13.4	8,040	—
トランス・コスモス	1.9	—	—	—
ベネッセホールディングス	2.2	—	—	—
合 計	株 数 ・ 金 額	1,067	1,571	1,972,946
	銘柄数 < 比率 >	124	129	< 98.0% >

(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	未
			買	建	額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 33		百万円 -

○投資信託財産の構成

(2015年6月22日現在)

項目	当	期	未	
	評	価	額	比
株式	千円 1,972,946		% 98.0	
コール・ローン等、その他	39,945		2.0	
投資信託財産総額	2,012,891		100.0	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年6月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,012,891,208
コール・ローン等	30,717,692
株式(評価額)	1,972,946,800
未収配当金	7,538,708
未収利息	8
差入委託証拠金	1,688,000
(B) 負債	378,000
未払金	378,000
(C) 純資産総額(A-B)	2,012,513,208
元本	1,251,294,185
次期繰越損益金	761,219,023
(D) 受益権総口数	1,251,294,185口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,083円

(注) 期首元本額は1,026,476,436円、期中追加設定元本額は573,036,620円、期中一部解約元本額は348,218,871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1,251,294,185円です。

○損益の状況 (2014年6月24日～2015年6月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	27,668,000
受取配当金	27,585,472
受取利息	7,386
その他収益金	75,142
(B) 有価証券売買損益	353,289,191
売買益	436,407,154
売買損	△ 83,117,963
(C) 先物取引等取引損益	8,277,202
取引益	15,839,042
取引損	△ 7,561,840
(D) 当期損益金(A+B+C)	389,234,393
(E) 前期繰越損益金	195,802,379
(F) 追加信託差損益金	347,963,380
(G) 解約差損益金	△171,781,129
(H) 計(D+E+F+G)	761,219,023
次期繰越損益金(H)	761,219,023

(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) (F)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) (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。