

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19期

(決算日 2018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、2018年6月22日に第19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。－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
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
17期(2016年6月22日)	7,529	0	△19.9	1,284.61	△22.1	90.0	9.7	1,981
18期(2017年6月22日)	9,581	0	27.3	1,610.38	25.4	89.5	10.3	2,506
19期(2018年6月22日)	10,002	460	9.2	1,744.83	8.3	92.3	7.3	2,612

(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	%		%	%	%
2017年6月22日	9,581	－	1,610.38	－	89.5	10.3
6月末	9,605	0.3	1,611.90	0.1	89.5	10.3
7月末	9,719	1.4	1,618.61	0.5	89.5	10.2
8月末	9,651	0.7	1,617.41	0.4	89.4	10.3
9月末	10,105	5.5	1,674.75	4.0	88.9	10.8
10月末	10,630	10.9	1,765.96	9.7	88.9	10.8
11月末	10,811	12.8	1,792.08	11.3	88.9	10.8
12月末	10,895	13.7	1,817.56	12.9	88.9	10.9
2018年1月末	11,028	15.1	1,836.71	14.1	89.0	10.9
2月末	10,534	9.9	1,768.24	9.8	89.0	10.9
3月末	10,319	7.7	1,716.30	6.6	88.2	11.5
4月末	10,616	10.8	1,777.23	10.4	88.1	11.6
5月末	10,525	9.9	1,747.45	8.5	88.3	11.4
(期末)						
2018年6月22日	10,462	9.2	1,744.83	8.3	92.3	7.3

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

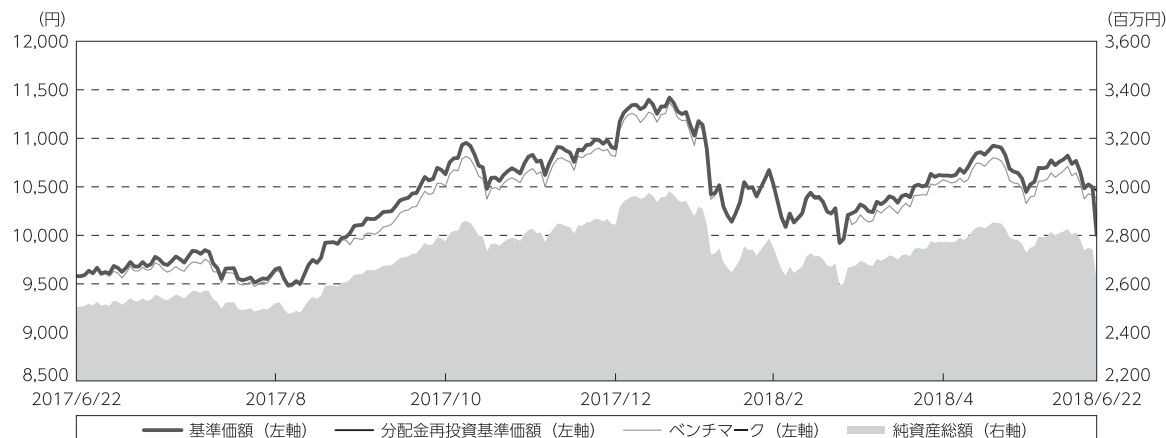
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比で計算しています。

(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(2017年6月23日～2018年6月22日)

○当期中の基準価額等の推移



期 首：9,581円

期 末：10,002円 (既払分配金(税込み)：460円)

騰落率：9.2% (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、欧米長期金利の上昇を背景とした円安の進行、北朝鮮を巡る地政学的リスクの後退、衆議院選挙での与党圧勝による政策期待の高まり、日本企業の良い企業決算、米国税制改革法案の成立、好調な経済指標を受けた世界的な株高、米中貿易摩擦への懸念の後退などが挙げられます。

主な下落要因として、北朝鮮を巡る地政学的リスクの高まり、米国税制改革に対する先行き不透明感の高まり、米国株の急落を受けたVIX指数の急上昇、財務省の決裁文書書き換え問題による安倍内閣の支持率低下、欧州の政局不安を背景とした円高の進行、米中貿易戦争への警戒感の高まり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1,610.38ポイント(2017年6月22日)から、欧米長期金利の上昇を背景とした円安の進行を受けて上昇して始まり、7月以降は、好調な米国経済指標が好感された一方で、北朝鮮を巡る地政学的リスクの高まりにより8月下旬まで一進

一退の展開となりましたが、9月上旬は、北朝鮮の核実験実施などを背景に下落し、9月5日にTOPIXは期中最安値となる1,590.71ポイントをつけました。

9月中旬以降は、北朝鮮が建国記念日に新たな挑発行為を行わなかったため地政学的リスクが後退して反発に転じ、10月以降も、衆議院選挙での与党圧勝や良好な企業決算が好感され日経平均株価が16連騰と過去最長を記録するなど11月上旬まで上昇基調で推移しました。11月中旬以降、法人税減税の実施を先送りする可能性があるとの報道を受けて、米国税制改革に対する先行き不透明感が高まり一時的に下落したものの、12月に入ると、税制改革法案が年内に成立する可能性が高まり円安ドル高が進行すると再度上昇し、2018年年明け後も、好調な経済指標を背景とした世界的な株高から続伸し、1月23日にTOPIXは期中最高値となる1,911.07ポイントをつけました。

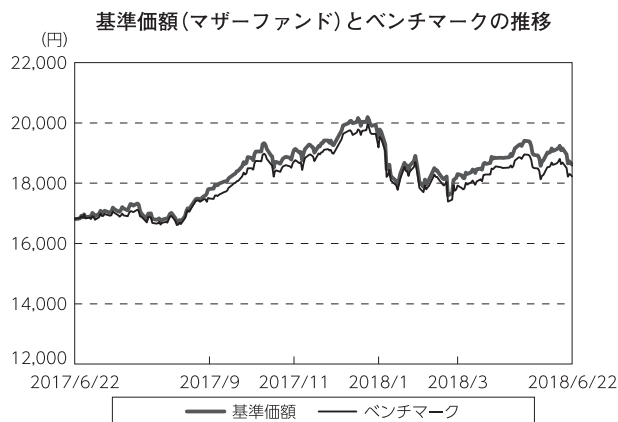
しかし2月に入り、米国雇用統計で賃金上昇率が市場予想を上回り、利上げペースが加速するとの見方から米国長期金利が上昇し米国株が急落すると、投資家の恐怖心理を表すVIX指数が上昇したことから大幅に下落しました。その後も、米国の輸入関税引上げによる貿易摩擦や、森友学園を巡る財務省の決裁文書書き換え問題による安倍内閣の支持率低下などが懸念され軟調に推移しました。

4月以降は、堅調な米国経済指標を背景に米国長期金利の上昇が継続し円安が進行したことや、米中貿易摩擦への懸念が一時的に後退したことから上昇に転じましたが、当期末にかけては、欧州の政局不安を背景とした円高の進行や、米中貿易摩擦の再燃により米中貿易戦争への警戒感が高まると下落し、期末である6月22日にTOPIXは1,744.83ポイントをつけて終了しました。

○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ンツモデル(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

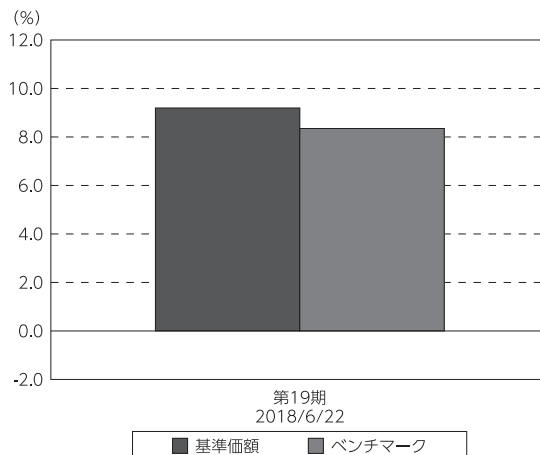
当ファンドは「TOPIX(東証株価指数)」をベンチマークとします。

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8.3%上昇したのに対し、基準価額は9.2%の上昇となり、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”等を重視した銘柄選択が奏功したことがプラスの乖離要因となりました。一方で、業種では下落率が大きかった「その他製品」の保有を高めていたことや、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、主力のウェブサイトである「価格.com」や「食べログ」の利用者拡大や手数料収入の増加により2018年3月期上期の連結決算が増収増益となったカカクコム、同業メーカーの値上げやコスト上昇などを背景に主力のMLCC(積層セラミック・コンデンサ)について価格是正交渉が開始されたことにより収益改善への期待感が高まった村田製作所の保有が多かったことはプラスに寄与しましたが、電子部品などを提供している米アップル社の最新スマートフォン「iPhone X」について販売低迷により減産見通しとなったことで業績への影響が懸念されたアルプス電気、半導体製造装置や工作機械向けの主力製品について2018年12月期に向けて受注の減速による業績の悪化が懸念されたTHK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(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460円とさせていただきます。

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19期
	2017年6月23日～ 2018年6月22日
当期分配金	460
(対基準価額比率)	4.397%
当期の収益	186
当期の収益以外	273
翌期繰越分配対象額	3,053

(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

(2017年6月23日～2018年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	134	1.296	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(62)	(0.594)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(62)	(0.594)	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)	(0.108)	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	12	0.115	(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 ）	(12)	(0.113)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.003)	
(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)	(0.005)	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。
（ 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	147	1.417	
期中の平均基準価額は、10,369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

(2017年6月23日～2018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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	685	705	—	—

(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 クオント 日本株マザーファンド	千口 -	千円 -	千口 15,370	千円 27,000

○株式売買比率

(2017年6月23日～2018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 クオント 日本株マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	13,106,704千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,407,088千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	5.44	

(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

(2017年6月23日～2018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

(2018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 156	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 1,396,293	千口 1,380,922	千円 2,570,172

(注) 親投資信託の当期末の受益権総口数は、1,380,922千口です。

○投資信託財産の構成

(2018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 2,570,172	% 93.3
コール・ローン等、その他	183,543	6.7
投資信託財産総額	2,753,715	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年6月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,753,715,115
コール・ローン等	175,943,497
朝日ライフ クオント 日本株マザーファンド(評価額)	2,570,172,618
差入委託証拠金	7,599,000
(B) 負債	141,317,992
未払金	3,110,740
未払収益分配金	120,144,788
未払信託報酬	17,987,069
未払利息	506
その他未払費用	74,889
(C) 純資産総額(A-B)	2,612,397,123
元本	2,611,843,222
次期繰越損益金	553,901
(D) 受益権総口数	2,611,843,222口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,002円

(注) 期首元本額は2,615,536,884円、期中追加設定元本額は5,026,497円、期中一部解約元本額は8,720,159円です。

○損益の状況 (2017年6月23日～2018年6月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 153,421
支払利息	△ 153,421
(B) 有価証券売買損益	248,155,768
売買益	248,607,571
売買損	△ 451,803
(C) 先物取引等取引損益	16,831,819
取引益	25,901,935
取引損	△ 9,070,116
(D) 信託報酬等	△ 35,301,008
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	229,533,158
(F) 前期繰越損益金	90,180,330
(G) 追加信託差損益金	△199,014,799
(配当等相当額)	(597,944,802)
(売買損益相当額)	(△796,959,601)
(H) 計(E+F+G)	120,698,689
(I) 収益分配金	△120,144,788
次期繰越損益金(H+I)	553,901
追加信託差損益金	△199,014,799
(配当等相当額)	(597,952,975)
(売買損益相当額)	(△796,967,774)
分配準備積立金	199,568,700

(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(48,741,257円)、費用控除後の有価証券等損益額(161,818,834円)、信託約款に規定する収益調整金(597,952,975円)および分配準備積立金(109,153,397円)より分配対象収益は917,666,463円(10,000口当たり3,513円)であり、うち120,144,788円(10,000口当たり460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)	460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			
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
17期(2016年6月22日)	13,049	△18.9	1,284.61	△22.1	96.6	2.8	1,845
18期(2017年6月22日)	16,820	28.9	1,610.38	25.4	95.5	4.1	2,348
19期(2018年6月22日)	18,612	10.7	1,744.83	8.3	93.9	1.4	2,570

(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
	円	騰 落 率	[ベンチマーク]	騰 落 率		
(期 首) 2017年6月22日	16,820	% —	1,610.38	% —	% 95.5	% 4.1
6月末	16,867	0.3	1,611.90	0.1	95.4	4.1
7月末	17,095	1.6	1,618.61	0.5	95.2	4.1
8月末	16,987	1.0	1,617.41	0.4	95.7	4.1
9月末	17,812	5.9	1,674.75	4.0	95.0	4.7
10月末	18,759	11.5	1,765.96	9.7	94.8	4.7
11月末	19,097	13.5	1,792.08	11.3	94.7	4.7
12月末	19,261	14.5	1,817.56	12.9	94.6	4.8
2018年1月末	19,519	16.0	1,836.71	14.1	94.7	4.8
2月末	18,662	11.0	1,768.24	9.8	95.0	4.8
3月末	18,302	8.8	1,716.30	6.6	94.0	5.4
4月末	18,837	12.0	1,777.23	10.4	94.0	5.5
5月末	18,716	11.3	1,747.45	8.5	93.9	5.4
(期 末) 2018年6月22日	18,612	10.7	1,744.83	8.3	93.9	1.4

(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

(2017年6月23日～2018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 22 (22) (0)	% 0.121 (0.120) (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	22	0.121	
期中の平均基準価額は、18,326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

(2017年6月23日～2018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		3,550 (△ 110)	6,548,232 ()	3,467	6,558,471

(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		515	588	—	—

(注) 金額は受渡代金です。

○株式売買比率

(2017年6月23日～2018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	13,106,704千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,407,088千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	5.44

(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

(2017年6月23日～2018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

(2018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
建設業 (3.5%)			
安藤・間	13.3	—	—
東建コーポレーション	0.4	—	—
大林組	23.7	29.3	33,343
清水建設	—	30.6	33,782
西松建設	14	—	—
奥村組	10	—	—
日本道路	—	1.3	7,462
ライト工業	—	8.6	9,890
食料品 (1.9%)			
明治ホールディングス	2.4	—	—
日本ハム	—	6.5	28,372
キリンホールディングス	15.4	—	—
キッコーマン	6	0.6	3,408
ニチレイ	8.5	—	—
日本たばこ産業	2.7	4.4	14,141
パルプ・紙 (1.1%)			
日本製紙	—	15.6	27,222
化学 (7.3%)			
昭和電工	—	6.9	33,534
住友化学	—	53	32,436
東ソー	22	—	—
信越化学工業	0.5	0.5	4,991
三菱瓦斯化学	13	—	—
三井化学	53	—	—
三菱ケミカルホールディングス	—	22.5	20,182
ダイキョーニシカワ	6.3	—	—
花王	0.5	0.6	5,040
富士フイルムホールディングス	—	8.7	36,653
タカラバイオ	—	6.1	14,676
デクセリアルズ	6.3	—	—
日東電工	—	3.3	27,337
医薬品 (7.3%)			
協和発酵キリン	—	12	27,528
武田薬品工業	1.4	0.6	2,680
アステラス製薬	29.4	28	49,224
塩野義製薬	5.7	6.5	36,835
エーザイ	—	1.6	12,792
小野薬品工業	—	13.3	35,790

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	5.1	—	—
参天製薬	19.8	—	—
沢井製薬	2	2.2	11,044
石油・石炭製品 (1.7%)			
JXTGホールディングス	70	56.2	41,604
ゴム製品 (0.1%)			
ブリヂストン	0.6	0.3	1,320
ガラス・土石製品 (0.2%)			
日本カーボン	—	0.9	5,706
鉄鋼 (2.0%)			
新日鐵住金	—	9.8	21,256
神戸製鋼所	26.9	26.8	27,604
非鉄金属 (1.7%)			
日本軽金属ホールディングス	37.2	—	—
三菱マテリアル	6.3	10.1	30,209
UACJ	26	—	—
アサヒホールディングス	5	5.3	11,400
金属製品 (1.0%)			
SUMCO	11.5	—	—
RS Technologies	—	1.4	7,896
東洋製罐グループホールディングス	—	8.7	16,068
岡部	6.1	—	—
東プレ	3.1	—	—
機械 (3.2%)			
オーエスジー	—	12.5	28,362
ディスコ	1.6	—	—
日東工器	3.5	—	—
SMC	—	0.3	12,750
小松製作所	—	1.2	3,734
日立建機	10.6	—	—
アイチ コーポレーション	11.5	—	—
SANKYO	7.3	—	—
TPR	2.6	—	—
日本精工	21.5	—	—
不二越	—	1	4,905
THK	—	8	26,680
電気機器 (8.1%)			
日立製作所	63	5	3,915
三菱電機	1.8	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マブチモーター	3.1	—	—
日本電産	—	0.2	3,387
沖電気工業	—	6.6	8,019
パナソニック	—	1.9	2,860
ソニー	3.1	3.7	20,335
アドバンテスト	—	6	13,782
キーエンス	0.2	0.3	19,968
千代田インテグレ	4.2	—	—
ファナック	2.2	0.3	6,669
村田製作所	0.2	3.1	56,559
SCREENホールディングス	1.5	—	—
キヤノン	1.4	5.1	18,834
東京エレクトロン	—	2.1	39,805
輸送用機器 (7.0%)			
トヨタ紡織	13.3	—	—
デンソー	8.1	—	—
東海理化電機製作所	4.8	—	—
日産自動車	—	38.8	41,845
トヨタ自動車	9.5	9.8	70,550
日産車体	—	10.1	10,130
フタバ産業	10.5	—	—
KYB	—	1.9	9,652
マツダ	20.4	11.9	16,285
本田技研工業	9.5	4.8	16,041
SUBARU	4.1	—	—
ヨロズ	—	2.5	4,212
精密機器 (2.1%)			
ブイ・テクノロジー	—	0.3	6,366
HOYA	—	7.1	45,148
その他製品 (5.8%)			
パイロットコーポレーション	—	5.1	32,640
凸版印刷	—	35	29,750
ヤマハ	3.1	—	—
ビジョン	—	6.4	34,752
任天堂	1.2	1.2	43,776
電気・ガス業 (1.5%)			
中部電力	5.7	5.7	9,399
中国電力	3.6	3.6	5,079
四国電力	3.2	3.2	4,780
電源開発	2.2	2.2	6,078
東京瓦斯	10	2	5,689
大阪瓦斯	10	2	4,453

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
陸運業 (0.6%)			
東日本旅客鉄道	0.5	1.1	11,896
東海旅客鉄道	0.1	0.1	2,424
センコーグループホールディングス	13.2	—	—
海運業 (0.4%)			
NSユナイテッド海運	—	4.3	9,339
情報・通信業 (8.6%)			
グリー	12.1	—	—
コーエーテクモホールディングス	8.6	—	—
ネクソン	—	11.9	19,646
エイチーム	—	3.8	9,496
インターネットイニシアティブ	2.7	—	—
アカツキ	—	1.1	4,757
野村総合研究所	6.9	—	—
オービック	2.4	—	—
ウェザーニューズ	2.3	—	—
マーベラス	7.9	—	—
エイベックス	6.3	—	—
東京放送ホールディングス	5.8	—	—
日本テレビホールディングス	—	3.8	7,094
日本電信電話	5.1	7.1	36,614
KDD I	17.7	19.6	59,525
NTTドコモ	16.6	13.6	38,488
カドカワ	—	8.7	10,605
東宝	8.7	—	—
ソフトバンクグループ	2.6	2.6	21,832
卸売業 (6.1%)			
双日	47.4	—	—
マクニカ・富士エレホールディングス	—	2.8	4,894
小野建	—	3.9	7,417
丸紅	47.8	44.7	37,096
三井物産	—	23	41,423
住友商事	20.7	16.2	29,589
三菱商事	19	1.8	5,565
稲畑産業	—	6.4	9,977
日鉄住金物産	1.8	1.8	9,972
小売業 (7.6%)			
エービーシー・マート	4.3	—	—
バルグループホールディングス	—	1.7	4,590
エディオン	—	9.4	10,208
サーラコーポレーション	—	8.7	6,177
MonotaRO	—	1.8	9,090
マツモトキヨシホールディングス	4.2	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スタートトゥデイ	—	5.4	23,463
セブン&アイ・ホールディングス	1.1	2.8	13,496
サンマルクホールディングス	2.7	—	—
パロックジャパンリミテッド	8.2	4.6	4,623
良品計画	—	0.5	19,825
アドヴァン	—	5	4,785
西松屋チェーン	7.4	—	—
V Tホールディングス	—	9.5	5,481
ユナイテッドアローズ	—	1.3	5,421
しまむら	—	2.5	28,575
イオン	—	5.9	13,977
ゼビオホールディングス	—	2.7	4,838
ヤマダ電機	50.7	55.5	29,859
ニトリホールディングス	2	—	—
アークス	3.5	—	—
銀行業 (7.2%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	18.6	18.6	10,620
三菱UFJフィナンシャル・グループ	75.7	75.7	47,335
りそなホールディングス	14.7	14.7	8,568
三井住友トラスト・ホールディングス	2.3	2.3	10,099
三井住友フィナンシャルグループ	8.4	8.4	35,935
千葉銀行	13	13	10,101
群馬銀行	13	13	7,735
ふくおかフィナンシャルグループ	19	19	10,431
広島銀行	15	7.5	5,595
みずほフィナンシャルグループ	139.5	139.5	25,960
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
大和証券グループ本社	10	10	6,198
野村ホールディングス	24.9	24.9	13,406
保険業 (2.3%)			
SOMPOホールディングス	2.3	2.3	10,497
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	3.1	3.1	10,611
第一生命ホールディングス	5.9	5.9	11,481
東京海上ホールディングス	3.4	3.4	18,128
T&Dホールディングス	3.4	3.4	5,701

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
その他金融業 (1.1%)			
クレディセゾン	1.8	1.8	3,076
オリックス	9.9	9.9	17,706
三菱UFJリース	6.7	6.7	4,649
不動産業 (3.2%)			
いちご	—	63.3	33,549
飯田グループホールディングス	—	14.3	30,344
三菱地所	1	—	—
レオパレス21	14.6	—	—
サンフロンティア不動産	—	4.4	5,737
エフ・ジェー・ネクスト	—	7.7	8,454
サービス業 (6.6%)			
L I F U L L	—	13.7	9,727
日本M&Aセンター	4.3	9.4	32,618
パーソルホールディングス	12.9	—	—
スタジオアリス	—	2.2	5,887
カカコム	—	9.6	24,048
ディップ	—	3.2	9,372
オリエンタルランド	1.5	—	—
ラウンドワン	—	6.1	10,986
ビー・エム・エル	4.1	—	—
楽天	—	43.5	30,641
リクルートホールディングス	4.4	1.9	6,055
カナモト	2.5	2.8	10,094
セコム	2.8	—	—
メイテック	—	2	10,080
ニチイ学館	—	7.8	10,311
合 計	株 数・金 額	1,491	1,463
	銘柄数<比率>	126	137 <93.9%>

(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 34	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2018年6月22日現在)

項目	当期	
	評価額	比率
株式	千円 2,412,443	% 93.8
コール・ローン等、その他	160,234	6.2
投資信託財産総額	2,572,677	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年6月22日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円 2,586,383,853
コール・ローン等	142,981,638
株式(評価額)	2,412,443,990
未収配当金	14,893,025
差入委託証拠金	16,065,200
(B) 負債	16,256,051
未払金	2,549,640
未払利息	411
差入委託証拠金代用有価証券	13,706,000
(C) 純資産総額(A-B)	2,570,127,802
元本	1,380,922,318
次期繰越損益金	1,189,205,484
(D) 受益権総口数	1,380,922,318口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,612円

(注) 期首元本額は1,396,293,305円、期中追加設定元本額は一円、期中一部解約元本額は15,370,987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1,380,922,318円です。

○損益の状況 (2017年6月23日～2018年6月22日)

項目	当期
(A) 配当等収益	円 56,384,879
受取配当金	56,486,215
その他収益金	5,900
支払利息	△ 107,236
(B) 有価証券売買損益	180,581,251
売買益	475,507,823
売買損	△ 294,926,572
(C) 先物取引等取引損益	11,564,820
取引益	18,223,000
取引損	△ 6,658,180
(D) 保管費用等	△ 5,680
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	248,525,270
(F) 前期繰越損益金	952,309,227
(G) 解約差損益金	△ 11,629,013
(H) 計(E+F+G)	1,189,205,484
次期繰越損益金(H)	1,189,205,484

(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。