

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22期

(決算日 2021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、2021年6月22日に第22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)	税金分配	み期騰落率	[ベンチマーク]	期騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
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
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

(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) 2020年6月22日	円	%		%	%	%
6月末	9,490	－	1,579.09	－	87.6	12.2
7月末	9,387	△1.1	1,558.77	△1.3	87.5	12.2
8月末	8,975	△5.4	1,496.06	△5.3	87.6	12.3
9月末	9,590	1.1	1,618.18	2.5	87.5	11.8
10月末	9,733	2.6	1,625.49	2.9	86.8	12.3
11月末	9,537	0.5	1,579.33	0.0	87.2	12.2
12月末	10,520	10.9	1,754.92	11.1	87.3	12.3
2021年1月末	10,803	13.8	1,804.68	14.3	87.2	12.3
2月末	10,882	14.7	1,808.78	14.5	87.4	12.2
3月末	11,203	18.1	1,864.49	18.1	87.6	11.7
4月末	11,901	25.4	1,954.00	23.7	87.4	12.1
5月末	11,559	21.8	1,898.24	20.2	87.5	12.1
6月末	11,755	23.9	1,922.98	21.8	80.2	19.6
(期末) 2021年6月22日	11,900	25.4	1,959.53	24.1	95.5	3.6

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

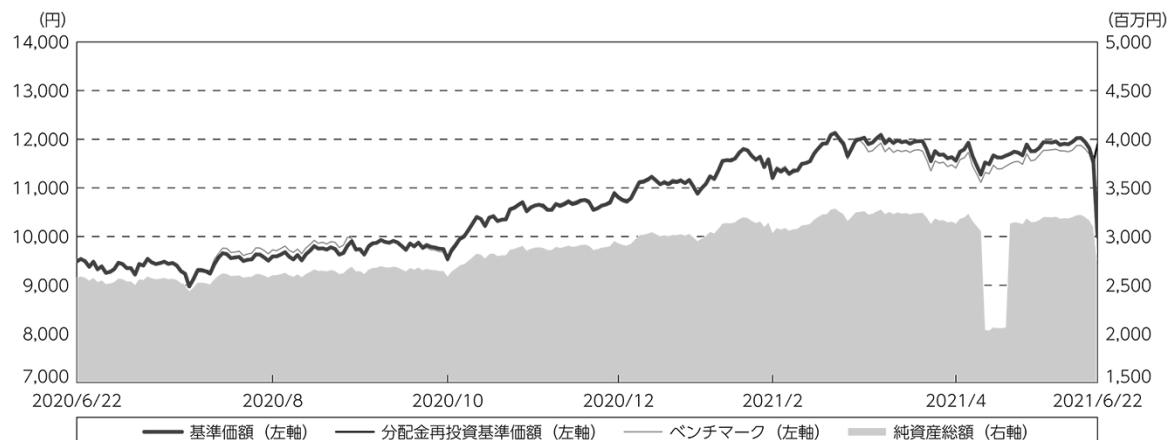
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比で計算しています。

(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(2020年6月23日～2021年6月22日)

○当期中の基準価額等の推移



(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、米中の良好な経済指標を受けた円安ドル高の進行、主要中央銀行による金融緩和姿勢の継続、安倍政権の政策を継承した菅政権の誕生、米大統領選挙でバイデン氏が勝利して上・下院とともに民主党が制したことで大規模な追加経済対策の実現への期待が高まったこと、国内外の決算発表における企業業績の回復、新型コロナウイルスを巡り、有効性の高いワクチンの接種が国内外で開始されたことなどを背景とした経済活動の早期正常化への期待などが挙げられます。

主な下落要因としては、変異ウイルスを含む新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大、国内における低調な決算、米国における長期金利の上昇やインフレ懸念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1,579.09ポイント(2020年6月22日)から、米国における新型コロナウイルスの感染拡大第2波への懸念の高まりから下落して始まり、7月に入ると国内における新規感染者数の増加や低調な決算が相次いだことが嫌気され、7月31日に

TOPIXは期中最安値となる1,496.06ポイントをつけました。8月は、トランプ米大統領による失業給付金の上乗せなどを盛り込んだ大統領令の発令や、米中の良好な経済指標を背景とした円安ドル高の進行から反発し、9月以降も安倍政権の政策を継承する菅新政権の誕生や、米大統領選挙でバイデン氏が勝利を確実とする中で財政政策への期待から上昇基調で推移しました。

11月は米ファイザー社の新型コロナウイルスのワクチンの治験で高い有効性が示されたことを受けて経済活動の早期正常化への期待から大幅に上昇しました。12月も国内外で新型コロナウイルスの感染拡大が続く中で、ワクチン普及への期待や米追加経済対策が可決されたことなどが好感され堅調に推移しました。

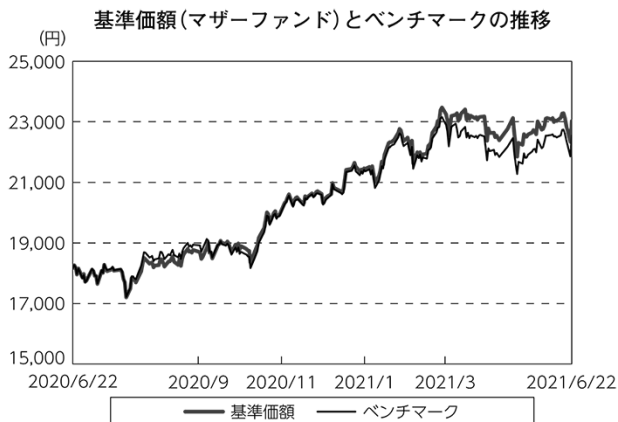
2021年年明け後も、米ジョージア州の上院決選投票で民主党が2議席を獲得し、大統領と上・下院を民主党が制することで大規模な追加経済対策の実現への期待の高まりから上昇しました。2月に入ると国内外の決算発表において企業業績に回復が見られたことから続伸し、3月19日にTOPIXは期中最高値となる2,012.21ポイントをつけました。

3月中旬以降は、米長期金利の上昇への懸念の高まりから下落しましたが、その後は米追加経済対策法案の早期成立や、欧米の主要中央銀行が金融緩和の継続を示唆したことから反発しました。5月に入ると、米消費者物価指数が前年比で大幅な伸びとなりインフレ懸念が高まったことを受けて一時的に下落しましたが、期末にかけては米長期金利の上昇が一服したことや、国内において新型コロナウイルスのワクチンの大規模接種が開始され経済活動再開への期待の高まりから反発し、期末である6月22日には1,959.53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 クオッツ 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。銘柄の選定に当たっては、当社が独自に開発したクオッツモデル(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

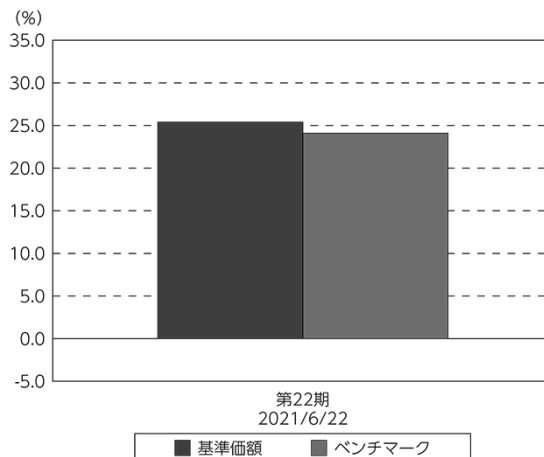
当ファンドは「TOPIX(東証株価指数)」をベンチマークとします。

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24.1%上昇したのに対し、基準価額は25.4%の上昇となり、ベンチマークを1.3%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」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、上昇率が小さかった「医薬品」の保有を高めていたこと、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、持分法適用対象のコンテナ船事業会社オーシャン・ネットワーク・エクスプレスについて、輸送需要の回復や運賃上昇を背景に業績が好調で大幅増益となった日本郵船、顧客からの前倒要求などにより半導体製造装置の売上高が想定を上回り、2021年3月期第2四半期の決算で上方修正および増配を発表した東京エレクトロン、2021年3月期本決算発表において、2022年3月期の業績が急回復する見通しを示すとともに株式還元策の強化を打ち出したことが好感されたいすゞ自動車の保有を高めていたことはプラスに寄与しましたが、主力のがん免疫薬オプジーボの薬価が引き下げられることが決定し2022年3月期の業績について下方修正を行った小野薬品工業、2021年3月期第2四半期の決算について、薬価改定や新型コロナウイルスの流行による患者の受診抑制を背景に主力の医薬品の販売が低調で減収減益となった科研製薬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1,900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22期
	2020年6月23日～ 2021年6月22日
当期分配金	1,900
(対基準価額比率)	15.966%
当期の収益	1,153
当期の収益以外	746
翌期繰越分配対象額	2,585

(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

(2020年6月23日～2021年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 138	% 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 ）	(63)	(0.605)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(63)	(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 ）	(12)	(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	2	0.021	(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 ）	(2)	(0.015)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(1)	(0.006)	
(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	141	1.347	
期中の平均基準価額は、10,487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。

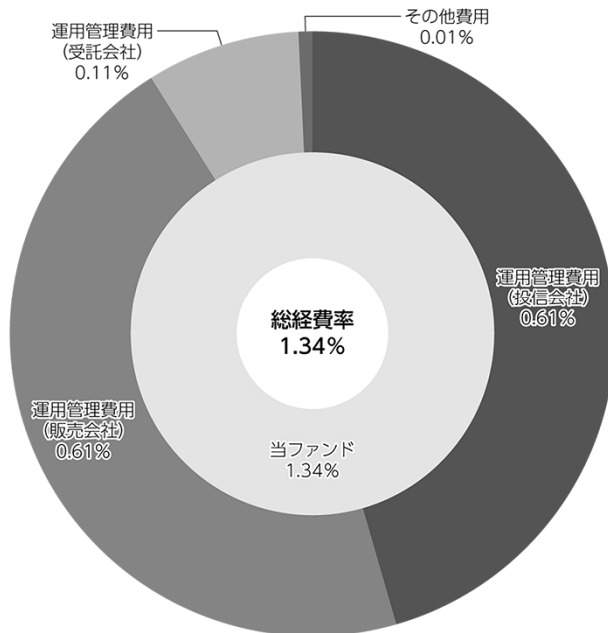
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2020年6月23日～2021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 2,265	百万円 2,490	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 クオントツ 日本株マザーファンド	千口 246,381	千円 560,000	千口 408,696	千円 893,000

○株式売買比率

(2020年6月23日～2021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 クオントツ 日本株マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	13,837,630千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,463,764千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	5.61	

(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

(2020年6月23日～2021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

(2021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 39	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 1,303,160	千口 1,140,846	千円 2,627,368

(注) 親投資信託の当期末の受益権総口数は、1,140,846千口です。

○投資信託財産の構成

(2021年6月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
朝日ライフ クオンツ 日本株マザーファンド	千円 2,627,368	% 81.9
コール・ローン等、その他	582,326	18.1
投資信託財産総額	3,209,694	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年6月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,209,694,491
コール・ローン等	540,753,239
朝日ライフ クオンツ 日本株マザーファンド(詳細額)	2,627,368,752
差入委託証拠金	41,572,500
(B) 負債	531,509,470
未払金	2,398,250
未払収益分配金	508,865,688
未払信託報酬	20,160,345
未払利息	1,244
その他未払費用	83,943
(C) 純資産総額(A-B)	2,678,185,021
元本	2,678,240,468
次期繰越損益金	△ 55,447
(D) 受益権総口数	2,678,240,468口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,000円

(注) 期首元本額は2,714,402,379円、期中追加設定元本額は912,012,048円、期中一部解約元本額は948,173,959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)55,447円

○損益の状況 (2020年6月23日～2021年6月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 152,372
支払利息	△ 152,372
(B) 有価証券売買損益	428,234,818
売買益	591,999,093
売買損	△163,764,275
(C) 先物取引等取引損益	56,487,442
取引益	63,547,862
取引損	△ 7,060,420
(D) 信託報酬等	△ 37,928,564
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	446,641,324
(F) 前期繰越損益金	40,356,647
(G) 追加信託差損益金	21,812,270
(配当等相当額)	(713,474,131)
(売買損益相当額)	(△691,661,861)
(H) 計(E+F+G)	508,810,241
(I) 収益分配金	△508,865,688
次期繰越損益金(H+I)	△ 55,447
追加信託差損益金	△ 149,301
(配当等相当額)	(692,319,656)
(売買損益相当額)	(△692,468,957)
分配準備積立金	93,854

(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(58,691,527円)、費用控除後の有価証券等損益額(250,276,293円)、信託約款に規定する収益調整金(714,281,227円)および分配準備積立金(178,030,151円)より分配対象収益は1,201,279,198円(10,000口当たり4,485円)であり、うち508,865,688円(10,000口当たり1,900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)	1,900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			
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
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

(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) 2020年6月22日	18,172	% —	1,579.09	% —	% 95.3	% 4.6
6月末	17,977	△ 1.1	1,558.77	△ 1.3	95.2	4.7
7月末	17,203	△ 5.3	1,496.06	△ 5.3	95.2	4.7
8月末	18,388	1.2	1,618.18	2.5	95.1	4.7
9月末	18,685	2.8	1,625.49	2.9	94.2	5.3
10月末	18,348	1.0	1,579.33	0.0	94.5	5.3
11月末	20,251	11.4	1,754.92	11.1	94.4	5.3
12月末	20,816	14.5	1,804.68	14.3	94.2	5.3
2021年1月末	21,005	15.6	1,808.78	14.5	94.2	5.3
2月末	21,633	19.0	1,864.49	18.1	94.3	4.7
3月末	23,035	26.8	1,954.00	23.7	94.6	5.2
4月末	22,394	23.2	1,898.24	20.2	94.6	5.2
5月末	22,744	25.2	1,922.98	21.8	97.3	2.2
(期 末) 2021年6月22日	23,030	26.7	1,959.53	24.1	97.3	2.2

(注) 基準価額は1万円当たりの値です。

(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

(2020年6月23日～2021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 4 (3) (1)	% 0.019 (0.017) (0.003)	(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	4	0.019	
期中の平均基準価額は、20,206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

(2020年6月23日～2021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		3,623 (△ 105)	6,817,479 ()	3,610	7,020,151

(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		1,056	1,133	—	—

(注) 金額は受渡代金です。

○株式売買比率

(2020年6月23日～2021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	13,837,630千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,463,764千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	5.61

(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

(2020年6月23日～2021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

(2021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 (0.6%)			
INPEX	—	10.4	8,663
K&Oエナジーグループ	—	5.1	6,879
建設業 (0.5%)			
大林組	29.9	—	—
清水建設	3.8	—	—
奥村組	3.3	—	—
熊谷組	3.8	—	—
大和ハウス工業	—	3.6	11,984
九電工	9.2	—	—
食料品 (5.8%)			
森永製菓	—	2.3	8,061
カルビー	—	12.2	31,683
森永乳業	—	4.4	25,828
明治ホールディングス	—	4.2	28,728
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	—	2.8	4,984
キュービー	7.5	—	—
アリアケジャパン	2.8	—	—
東洋水産	—	1.8	7,884
日本たばこ産業	18.3	18.8	41,407
北の達人コーポレーション	8.3	—	—
パルプ・紙 (0.2%)			
北越コーポレーション	23.4	6.8	4,005
レンゴー	31.3	—	—
化学 (8.2%)			
旭化成	—	15.2	18,756
昭和電工	—	9.5	32,015
住友化学	—	58.6	34,632
信越化学工業	3.9	3.2	58,512
堺化学工業	—	2.8	5,219
日本パーカライジング	—	4	4,492
高压ガス工業	—	9.7	6,246
日本触媒	—	0.9	4,914
カネカ	9.9	—	—
三井化学	—	9.6	36,192
花王	0.9	—	—
D I C	4.4	—	—
マンダム	4.6	—	—
日東電工	—	1	8,480

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
医薬品 (7.5%)			
協和キリン	11	—	—
武田薬品工業	5.3	10.8	40,521
アステラス製薬	5.1	12.8	25,484
塩野義製薬	5.2	—	—
中外製薬	0.3	9.7	42,389
科研製薬	4.2	—	—
小野薬品工業	11.2	11.9	29,898
参天製薬	—	22.4	34,742
JCRファーマ	—	4.2	14,910
沢井製薬	2	—	—
第一三共	1.3	1.8	4,555
ペプチドリーム	5.5	—	—
ゴム製品 (—%)			
バンドー化学	13.3	—	—
ガラス・土石製品 (0.9%)			
日本電気硝子	—	4.1	10,754
日本特殊陶業	—	7	11,564
鉄鋼 (3.0%)			
日本製鉄	—	18.8	34,554
神戸製鋼所	—	18.7	12,977
ジェイ エフ イー ホールディングス	—	23.1	29,475
共英製鋼	2.7	—	—
非鉄金属 (0.2%)			
三菱マテリアル	12.3	—	—
住友金属鉱山	—	1.2	5,353
古河電気工業	9.9	—	—
金属製品 (—%)			
東洋製織グループホールディングス	6.5	—	—
機械 (7.6%)			
アマダ	—	28.2	31,668
ディスコ	0.4	0.9	31,275
日進工具	1.3	—	—
SMC	0.2	0.8	51,584
ユニオンツール	2.4	—	—
クボタ	13.9	—	—
新東工業	—	8.7	6,846
ダイキン工業	0.5	0.5	10,615
椿本チエイン	—	2.6	8,242

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
平和	—	5.6	10,920
SANKYO	—	3.6	10,170
グローリー	1.8	—	—
リケン	1.6	—	—
I H I	—	12.8	34,316
電気機器 (12.8%)			
コニカミノルタ	70.6	—	—
日立製作所	1	1.9	11,890
三菱電機	—	13.5	23,220
日本電産	0.5	1.2	15,318
ヤママン	5.3	—	—
メルコホールディングス	3.2	—	—
ルネサスエレクトロニクス	—	7.8	9,165
セイコーエプソン	8.8	—	—
ソニーグループ	4.4	4.6	50,002
ヒロセ電機	—	0.5	8,035
アドバンテスト	5.6	3.6	36,000
キーエンス	1.5	0.6	34,140
イリソ電子工業	—	1.4	7,364
レーザーテック	0.2	—	—
ファナック	0.3	1.7	45,177
村田製作所	5.8	1.4	11,772
小糸製作所	1.3	—	—
キャノン	3.7	6.3	16,345
東京エレクトロン	1.2	1.2	57,984
輸送用機器 (9.0%)			
デンソー	4.8	—	—
いすゞ自動車	—	23.6	35,659
トヨタ自動車	9.3	7.9	78,684
日産車体	—	12.6	9,336
プレス工業	13.3	15.8	5,419
太平洋工業	7.1	—	—
アイシン	0.8	7.4	35,002
本田技研工業	3	2.7	9,501
ヤマハ発動機	11.5	—	—
エクセディ	—	2.4	3,940
エフ・シー・シー	—	5.9	9,434
シマノ	1.4	1.7	44,200
精密機器 (2.4%)			
理研計器	1.6	—	—
HOYA	4.4	4.1	60,352
ニプロ	9.2	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
その他製品 (1.7%)			
パイロットコーポレーション	—	2.9	10,991
凸版印刷	4.1	—	—
任天堂	1	0.5	32,595
電気・ガス業 (1.0%)			
中部電力	5.7	—	—
関西電力	—	7.6	8,162
東北電力	5.4	—	—
四国電力	—	6.9	5,354
九州電力	4.9	—	—
電源開発	2.2	3.3	5,336
東京瓦斯	2	1.8	3,867
大阪瓦斯	2	1.8	3,790
陸運業 (2.8%)			
相鉄ホールディングス	—	4.7	10,523
東急	14.6	—	—
京浜急行電鉄	—	19.1	27,236
東日本旅客鉄道	—	2.9	24,000
東海旅客鉄道	2.2	—	—
鴻池運輸	7.8	—	—
センコーグループホールディングス	10.2	—	—
ニッコンホールディングス	4.6	3.6	8,758
海運業 (2.4%)			
日本郵船	—	7.7	43,659
商船三井	—	3.3	17,490
情報・通信業 (10.6%)			
デジタルアーツ	1.1	—	—
ネクソン	13.9	3.7	9,320
エニグモ	—	6.9	9,363
じげん	—	12.7	5,372
ティーガイア	2.3	4.1	8,040
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	3.6	7,988
GMOペイメントゲートウェイ	—	0.5	7,125
e B A S E	2.4	—	—
P R T I M E S	—	1.5	5,197
ダブルスタンダード	0.9	—	—
アカツキ	2.2	2.2	7,909
ユーザーローカル	—	1	4,530
オービック	1.3	—	—
ジャストシステム	1.8	3.6	23,148
トレンドマイクロ	—	4.9	28,224
日本オラクル	—	3.1	30,690
オービックビジネスコンサルタント	0.6	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本テレビホールディングス	—	20.5	26,219
日本電信電話	18.6	5.5	16,043
KDD I	15.7	10.1	35,481
NTTドコモ	15.7	—	—
GMOインターネット	—	1.3	3,952
カブコン	4.6	—	—
NSD	3	—	—
ソフトバンクグループ	5.2	5.6	43,131
卸売業 (2.9%)			
バイタルケーエスケー・ホールディングス	—	9.4	7,087
TOKAIホールディングス	—	8.5	7,565
三洋貿易	4.1	—	—
日本ライフライン	—	5.4	7,435
伊藤忠商事	1	1.7	5,567
蝶理	—	2.8	4,849
三井物産	—	1.2	3,033
住友商事	—	19.3	29,017
三菱商事	1.9	0.8	2,414
東邦ホールディングス	4.7	—	—
日鉄物産	2.5	1.8	7,803
スズケン	2	—	—
小売業 (3.6%)			
ハニーズホールディングス	5.5	—	—
ZOZO	—	2.6	9,620
セブン&アイ・ホールディングス	11.2	0.6	3,090
ノジマ	2	1.8	5,254
良品計画	5.1	3.6	7,495
アドヴァン	—	8.7	8,151
ハイデイ日高	—	2.9	5,217
ファミリーマート	6.7	—	—
ライフコーポレーション	2.3	—	—
AOKIホールディングス	12.3	—	—
ゼビオホールディングス	—	4.1	4,013
ヤマダホールディングス	—	12.9	6,604
ニトリホールディングス	1.7	1.9	35,796
ベルク	—	1.4	7,686
銀行業 (5.1%)			
めぶきフィナンシャルグループ	20.6	21.5	5,074
新生銀行	3	4.5	6,885
三菱UFJフィナンシャル・グループ	69	67	40,555
りそなホールディングス	17	24.3	10,811
三井住友トラスト・ホールディングス	1.3	0.5	1,805
三井住友フィナンシャルグループ	8.4	7.6	29,708

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
群馬銀行	—	13.2	4,699
ふくおかフィナンシャルグループ	3	2.7	5,235
ほくほくフィナンシャルグループ	4.8	—	—
広島銀行	10.3	—	—
みずほフィナンシャルグループ	154.5	13.6	21,855
山口フィナンシャルグループ	—	6.9	4,512
証券・商品先物取引業 (0.8%)			
SBIホールディングス	1.6	—	—
大和証券グループ本社	14.3	10.4	6,538
野村ホールディングス	8.8	22.4	12,947
保険業 (2.2%)			
SOMPOホールディングス	2.3	2.3	9,669
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	3.1	3.2	10,361
第一生命ホールディングス	8	7.3	14,983
東京海上ホールディングス	3	2.3	11,644
T&Dホールディングス	6.5	5.9	8,549
その他金融業 (1.0%)			
クレディセゾン	1.8	3.3	4,570
芙蓉総合リース	0.6	—	—
オリックス	10.1	9.1	17,631
三菱HCキャピタル	—	6.7	4,033
不動産業 (1.2%)			
サムティ	—	2.6	5,280
プレサンスコーポレーション	5	—	—
飯田グループホールディングス	—	3.6	10,648
ケイアイスター不動産	—	1.2	5,982
三井不動産	8.6	—	—
東京建物	19.8	—	—
住友不動産	11.7	—	—
ゴールドクレスト	—	1.8	3,223
イオンモール	12.9	—	—
サンフロンティア不動産	3.9	5.5	5,775
サービス業 (6.0%)			
ジェイエイシーリクルートメント	6.4	—	—
日本M&Aセンター	2.9	1.7	4,652
総合警備保障	—	2.8	14,336
カカコム	1.8	—	—
エムスリー	2.1	5	37,555
アウトソーシング	—	3.2	6,643
ケネディクス	16.1	—	—
電通グループ	6	—	—
H. U. グループホールディングス	—	1.9	5,489
オリエンタルランド	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユー・エス・エス	16.3	15.8	29,846
サイバーエージェント	—	2.3	5,386
モーニングスター	—	9.9	4,445
アイ・アールジャパンホールディングス	1.9	0.5	7,125
ジャパンマテリアル	5.6	—	—
リクルートホールディングス	3.4	3.6	20,397
ペイカレント・コンサルティング	0.5	—	—
カナモト	2.9	—	—

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	16,359
船井総研ホールディングス	3.9	—	—
合 計	株 数・金 額	1,165	1,073
	銘柄数<比率>	148	151

(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 58	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2021年6月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 2,556,752	% 97.3
コール・ローン等、その他	70,986	2.7
投資信託財産総額	2,627,738	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年6月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,642,840,679
コール・ローン等	51,861,915
株式(評価額)	2,556,752,100
未収配当金	17,207,664
差入委託証拠金	17,019,000
(B) 負債	15,429,119
未払金	327,000
未払利息	119
差入委託証拠金代用有価証券	15,102,000
(C) 純資産総額(A-B)	2,627,411,560
元本	1,140,846,180
次期繰越損益金	1,486,565,380
(D) 受益権総口数	1,140,846,180口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,030円

(注) 期首元本額は1,303,160,966円、期中追加設定元本額は246,381,276円、期中一部解約元本額は408,696,062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1,140,846,180円です。

○損益の状況 (2020年6月23日～2021年6月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	64,581,781
受取配当金	64,681,540
その他収益金	9,406
支払利息	△ 109,165
(B) 有価証券売買損益	502,065,511
売買益	733,319,994
売買損	△ 231,254,483
(C) 先物取引等取引損益	25,654,700
取引益	30,505,000
取引損	△ 4,850,300
(D) 保管費用等	△ 408
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	592,301,584
(F) 前期繰越損益金	1,064,949,010
(G) 追加信託差損益金	313,618,724
(H) 解約差損益金	△ 484,303,938
(I) 計(E+F+G+H)	1,486,565,380
次期繰越損益金(I)	1,486,565,380

(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。

(注) (H)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。