

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式 特化型 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)	
信託期間	2008年12月26日から2028年10月20日	
運用方針	信託財産の中長期的な成長を目標として運用を行います。	
主要投資対象	ダイヤセレクト日本株オープン	「ダイヤセレクト日本株マザーファンド」を主要投資対象とします。
	ダイヤセレクト日本株マザーファンド	わが国の取引所に上場されている三菱グループ企業の株式を主要投資対象とします。
投資制限	ダイヤセレクト日本株オープン	・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
	ダイヤセレクト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割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額の水準、市況動向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等には、収益分配を行わないことがあります。 収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。	

- 当ファンドは特化型運用を行います。特化型ファンドとは、投資対象に一般社団法人投資信託協会の規則に定める支配的な銘柄が存在し、または存在することとなる可能性が高いファンドをいいます。
- 当ファンドの主要投資対象には寄与度（投資対象候補銘柄の時価総額に占める割合）が10%を超えるまたは超える可能性の高い支配的な銘柄が存在するため、特定の銘柄への投資が集中することがあり、当該支配的な銘柄に経営破綻や経営・財務状況の悪化等が生じた場合には、大きな損失が発生することがあります。

ダイヤセレクト 日本株オープン

第24期 運用報告書（全体版） （決算日 2020年10月20日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
さて、「ダイヤセレクト日本株オープン」は、このたび、第24期の決算を行いましたので、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き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1－8－2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口
東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016
受付時間：営業日の9時～17時
<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			参 考 指 数		株 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 期 騰 落 中 率		期 騰 落 中 率		
	円	円	%		%	%	百万円
20期(2018年10月22日)	10,445	500	△ 2.4	1,695.31	△ 3.2	98.0	3,762
21期(2019年4月22日)	9,646	0	△ 7.6	1,618.62	△ 4.5	97.9	3,602
22期(2019年10月21日)	9,549	0	△ 1.0	1,628.60	0.6	98.0	3,497
23期(2020年4月20日)	7,631	0	△20.1	1,432.41	△12.0	97.3	2,432
24期(2020年10月20日)	7,803	0	2.3	1,625.74	13.5	97.7	2,396

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		参 考	指 数		株 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		騰 落 率	騰 落 率	
(期 首)	円	%	%		%	%	
2020年4月20日	7,631	—	—	1,432.41	—	—	97.3
4月末	7,875	3.2	3.2	1,464.03	2.2	2.2	97.4
5月末	8,185	7.3	7.3	1,563.67	9.2	9.2	97.4
6月末	7,890	3.4	3.4	1,558.77	8.8	8.8	97.8
7月末	7,389	△3.2	△3.2	1,496.06	4.4	4.4	98.3
8月末	8,088	6.0	6.0	1,618.18	13.0	13.0	99.0
9月末	7,887	3.4	3.4	1,625.49	13.5	13.5	98.2
(期 末)							
2020年10月20日	7,803	2.3	2.3	1,625.74	13.5	13.5	97.7

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

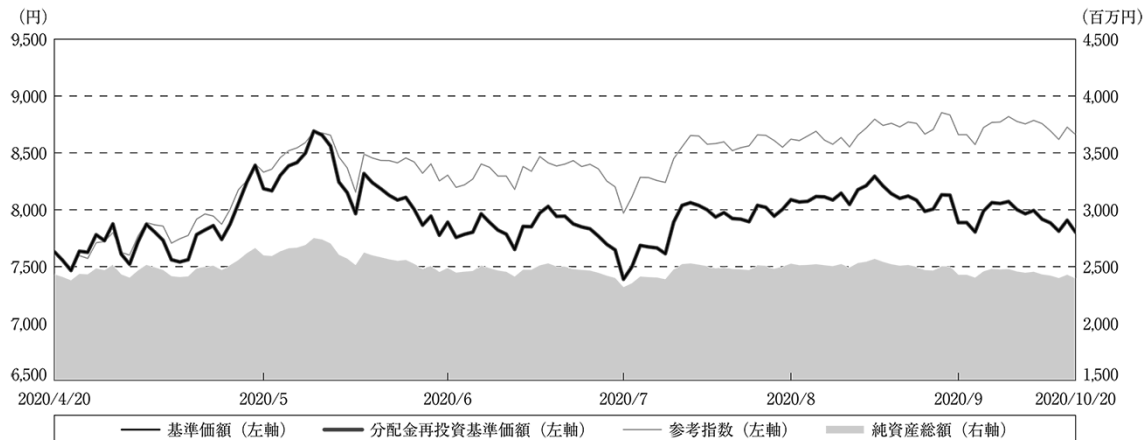
参考指数はTOPIX（東証株価指数）です。

TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

○運用経過

(2020年4月21日～2020年10月20日)

■期中の基準価額等の推移



期 首：7,631円

期 末：7,803円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 2.3% (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参考指数は、期首(2020年4月20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) 参考指数は、TOPIX(東証株価指数)です。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・新型コロナウイルス感染拡大ペースの鈍化
- ・各国中央銀行による金融緩和

マイナス要因

- ・新型コロナウイルス感染再拡大への懸念
- ・日米の政治情勢の先行き不透明感の高まり

■投資環境

当期、国内株式市場は上昇しました。

期初、新型コロナウイルス感染拡大ペースが鈍化し、緊急事態宣言が解除されたことで経済活動正常化への期待が高まり、国内株式市場は上昇しました。期央にかけては、新型コロナウイルス感染再拡大への懸念が残るなか、米国経済指標が比較的堅調であったことに加え、各国の中央銀行が金融緩和を継続する姿勢を示したことを受けて、国内株式市場は横ばいで推移しました。

その後は、国内企業の2020年4-6月期決算が総じて事前予想を上回る内容となったことや、国内の新規感染者数が減少傾向に転じたことで、経済活動の本格的な回復期待が高まり、国内株式市場は上昇しました。8月下旬には安倍首相が辞任を表明し、9月下旬には米国大統領選挙において民主党のバイデン候補優勢との見方が広まるなど、日米ともに政治情勢の先行き不透明感が高まったことにより、国内株式市場は一時的に株価が下落することもありましたが、緩やかに回復する国内経済を反映し、前期末対比上昇した水準で期を終えました。

■ポートフォリオについて

<ダイヤセレクト日本株オープン>

「ダイヤセレクト日本株マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。

当ファンドの基準価額は、マザーファンドの値動きを反映し、2.3%上昇しました。

<ダイヤセレクト日本株マザーファンド>

運用の基本方針に基づき、「三菱グループ企業」の株式の中から、わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とし、「時価総額の大きさに応じて投資する戦略」と「配当利回りの大きさに応じて投資する戦略」の2つの戦略を組み合わせることによって、三菱グループ企業の成長を享受しながら、信託財産の中長期的な成長を目指します。

当期についても、当ファンドの運用の基本方針に基づき、投資対象銘柄の見直しおよび組入比率を調整する定期的なリバランス（投資配分比率の調整）を2020年6月初旬と9月初旬に行いました。

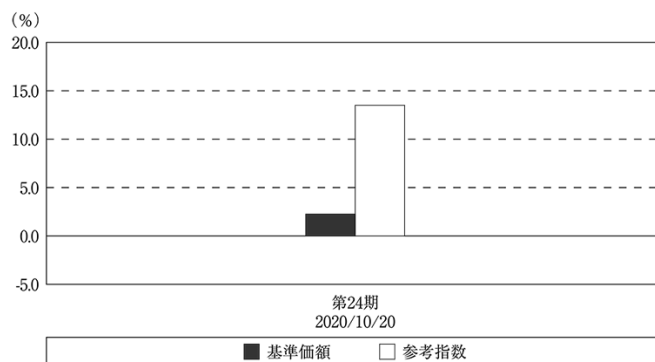
期を通じて、特に三菱瓦斯化学、三菱商事、AGCなどが上昇したことから、基準価額は2.8%上昇しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。

グラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、TOPIX（東証株価指数）です。

■分配金

当期においては、基準価額の水準などを勘案して、収益分配を行わないこととしました。収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第24期
	2020年4月21日～ 2020年10月20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	1,868

(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、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計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

＜ダイヤセレクト日本株オープン＞

「ダイヤセレクト日本株マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。

＜ダイヤセレクト日本株マザーファンド＞

国内株式市場は小幅な上昇を予想します。国内経済が緩やかな回復を続けるなか、政府の観光支援策「Go Toトラベルキャンペーン」による観光地などへの人出の増加も、経済活動の回復を後押しするとみられることから、国内株式市場の上昇要因になると考えます。

米国で追加経済対策の合意が先送りされていることや、欧米で新型コロナウイルス感染が拡大していることが株式市場の懸念材料となっていますが、国内の2020年7-9月期の企業業績は4-6月期と比べて回復しており、市場の底値は固いと考えます。

このような環境下、引き続き「三菱グループ企業」の株式の中から、わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とし、「時価総額の大きさに応じて投資する戦略」と「配当利回りの大きさに応じて投資する戦略」の2つの戦略を組み合わせることによって、三菱グループ企業の成長を享受しながら、信託財産の中長期的な成長を目指します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年 4 月21日～2020年10月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 41	% 0.524	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(20)	(0.248)	* 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
(販 売 会 社)	(20)	(0.248)	* 購入後の情報提供、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および事務手続き等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.028)	* 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.006	(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)	(0)	(0.006)	* 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) そ の 他 費 用	0	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)	(0)	(0.006)	* 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	41	0.536	
期中の平均基準価額は、7,885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む）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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

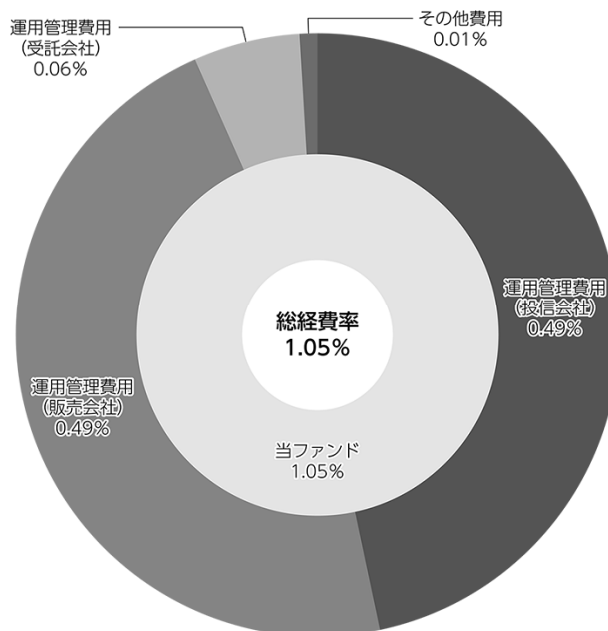
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものをみます。

(注) 各比率は 1 万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.05%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、親投資信託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4月21日～2020年10月20日)

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
ダイヤセレクト日本株マザーファンド	千口 13,856	千円 23,899	千口 74,046	千円 130,816

○株式売買比率

(2020年4月21日～2020年10月20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
	ダイヤセレクト日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	312,966千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,429,554千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.12

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2020年4月21日～2020年10月20日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

<ダイヤセレクト日本株マザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株式	30	12	217

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは東京海上ホールディングス株式会社です。

○組入資産の明細

(2020年10月20日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイヤセレクト日本株マザーファンド	1,449,046	1,388,857	2,396,612

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2020年10月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイヤセレクト日本株マザーファンド	2,396,612	99.4
コール・ローン等、その他	13,796	0.6
投資信託財産総額	2,410,408	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年10月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,410,408,197
ダイヤセレクト日本株マザーファンド(評価額)	2,396,612,483
未収入金	13,795,714
(B) 負債	13,795,714
未払解約金	614,143
未払信託報酬	13,044,354
その他未払費用	137,217
(C) 純資産総額(A－B)	2,396,612,483
元本	3,071,280,071
次期繰越損益金	△ 674,667,588
(D) 受益権総口数	3,071,280,071口
1万口当たり基準価額(C／D)	7,803円

- (注) 当ファンドの期首元本額は3,187,447,699円、期中追加設定元本額は30,540,567円、期中一部解約元本額は146,708,195円です。
- (注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。
- (注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2020年4月21日～2020年10月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	65,492,520
売買益	72,159,925
売買損	△ 6,667,405
(B) 信託報酬等	△ 13,181,571
(C) 当期損益金(A＋B)	52,310,949
(D) 前期繰越損益金	△ 908,929,200
(E) 追加信託差損益金	181,950,663
(配当等相当額)	(415,922,865)
(売買損益相当額)	(△ 233,972,202)
(F) 計(C＋D＋E)	△ 674,667,588
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	△ 674,667,588
追加信託差損益金	181,950,663
(配当等相当額)	(415,949,766)
(売買損益相当額)	(△ 233,999,103)
分配準備積立金	157,769,998
繰越損益金	△1,014,388,249

- (注) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。
- (注) (B)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。
- (注) (E)追加信託差損益金は、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です。
- (注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	26,430,267円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	415,949,766円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	131,339,731円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	573,719,764円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,868円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

ダイヤセレクト日本株マザーファンド

運用報告書 第12期（決算日 2020年10月20日）

（計算期間 2019年10月22日～2020年10月20日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 円	価 額		参 考 円	指 数		株 組 入 比 率 %	純 資 産 額 百万円
		騰 落	中 率 %		騰 落	中 率 %		
8期(2016年10月20日)	17,108	△	8.4	1,370.80	△	8.6	97.8	5,336
9期(2017年10月20日)	22,603		32.1	1,730.64		26.3	98.7	4,551
10期(2018年10月22日)	22,602	△	0.0	1,695.31	△	2.0	98.0	3,762
11期(2019年10月21日)	20,874	△	7.6	1,628.60	△	3.9	98.0	3,497
12期(2020年10月20日)	17,256	△	17.3	1,625.74	△	0.2	97.7	2,396

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 円	価 額		参 考 円	指 数		株 組 入 比 率 %
		騰 落	率 %		騰 落	率 %	
(期 首) 2019年10月21日	20,874		—	1,628.60		—	98.0
10月末	21,283		2.0	1,667.01		2.4	97.9
11月末	21,342		2.2	1,699.36		4.3	98.0
12月末	21,527		3.1	1,721.36		5.7	97.6
2020年1月末	21,101		1.1	1,684.44		3.4	98.1
2月末	18,940	△	9.3	1,510.87	△	7.2	98.6
3月末	16,969	△	18.7	1,403.04	△	13.8	95.9
4月末	17,328	△	17.0	1,464.03	△	10.1	97.3
5月末	18,023	△	13.7	1,563.67	△	4.0	97.3
6月末	17,391	△	16.7	1,558.77	△	4.3	97.6
7月末	16,305	△	21.9	1,496.06	△	8.1	98.0
8月末	17,857	△	14.5	1,618.18	△	0.6	98.6
9月末	17,432	△	16.5	1,625.49	△	0.2	97.7
(期 末) 2020年10月20日	17,256	△	17.3	1,625.74	△	0.2	97.7

(注) 騰落率は期首比です。

参考指数はTOPIX（東証株価指数）です。

TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

○運用経過

(2019年10月22日～2020年10月20日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：20,874円

期 末：17,256円

騰落率：△17.3%

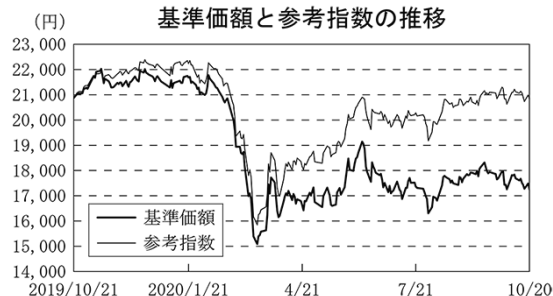
◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・米中貿易協議の進展に対する期待感の高まり
- ・各国の中央銀行による大規模な金融緩和策などを受けた景気回復期待の高まり

マイナス要因

- ・新型コロナウイルス感染拡大を背景とした投資家のリスク回避の動き
- ・新型コロナウイルス感染再拡大への懸念



(注) 参考指数は期首(2019年10月21日)の値が基準価額と同一になるように指数化したものです。

(注) 参考指数は、TOPIX(東証株価指数)です。

■投資環境

当期、国内株式市場は、前期末対比おおむね横ばいとなりました。

期初、米中貿易協議の進展に対する期待感の高まりや、英国のEU(欧州連合)離脱期限延長に関する合意などを背景として、政治情勢に対する懸念が世界的に後退したことから、国内株式市場は上昇して始まりました。しかし、2020年初以降になると、中国での新型コロナウイルスの感染拡大や国内での感染者の発生などを受けた先行き不透明感の高まりから、投資家のリスク回避の動きが強まり、3月にかけて国内株式市場は大きく下落しました。

その後、各国の中央銀行による異例の大規模な金融緩和策が打ち出されたことや、新型コロナウイルス感染拡大ペースが鈍化し、緊急事態宣言が解除されたことを受けて経済活動正常化への期待が高まり、国内株式市場は上昇しました。期末にかけては新型コロナウイルス感染再拡大への懸念が残るなか、各国中央銀行の金融緩和が国内株式市場を下支えし、前期末対比おおむね横ばいの水準で期を終えました。

■ポートフォリオについて

運用の基本方針に基づき、「三菱グループ企業」の株式の中から、わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とし、「時価総額の大きさに応じて投資する戦略」と「配当利回りの大きさに応じて投資する戦略」の2つの戦略を組み合わせることで、三菱グループ企業の成長を享受しながら、信託財産の中長期的な成長を目指します。

当期についても、投資対象銘柄の見直しおよび組入比率を調整する定期的なリバランス(投資配分比率の調整)を2019年12月初旬と2020年3月初旬、6月初旬、9月初旬に行いました。

期を通じて、特に三菱重工業、三菱自動車工業、ニコンなどが下落したことから、基準価額は17.3%下落しました。

○今後の運用方針

国内株式市場は小幅な上昇を予想します。国内経済が緩やかな回復を続けるなか、政府の観光支援策「Go Toトラベルキャンペーン」による観光地などへの人出の増加も、経済活動の回復を後押しするとみられることから、国内株式市場の上昇要因になると考えます。

米国で追加経済対策の合意が先送りされていることや、欧米で新型コロナウイルス感染が拡大していることが株式市場の懸念材料となっていますが、国内の2020年7-9月期の企業業績は4-6月期と比べて回復しており、市場の底値は固いと考えます。

このような環境下、引き続き「三菱グループ企業」の株式の中から、わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とし、「時価総額の大きさに応じて投資する戦略」と「配当利回りの大きさに応じて投資する戦略」の2つの戦略を組み合わせることによって、三菱グループ企業の成長を享受しながら、信託財産の中長期的な成長を目指します。

○1万口当たりの費用明細

(2019年10月22日～2020年10月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 3	% 0.015	(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、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(3)	(0.015)	
合 計	3	0.015	
期中の平均基準価額は、18,791円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を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（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2019年10月22日～2020年10月20日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株	千円	千株	千円
		275	279,169	646	699,056

(注) 金額は受渡代金です。

○株式売買比率

(2019年10月22日～2020年10月20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	978,226千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,784,128千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.35

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2019年10月22日～2020年10月20日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株式	49	64	217

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは東京海上ホールディングス株式会社です。

○組入資産の明細

(2020年10月20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 (1.9%)			
ピーエス三菱	60.6	73.6	43,350
食料品 (8.3%)			
キリンホールディングス	115.5	100.8	194,241
パルプ・紙 (0.7%)			
三菱製紙	28.4	48.6	15,746
化学 (10.7%)			
三菱瓦斯化学	61.9	44.5	89,133
三菱ケミカルホールディングス	229.4	219.4	133,109
大日本塗料	36.6	30.5	27,450
石油・石炭製品 (6.7%)			
E N E O S ホールディングス	465.9	426.8	156,934
ガラス・土石製品 (5.0%)			
A G C	39.9	35.3	115,960
鉄鋼 (0.0%)			
三菱製鋼	35	1.5	802
非鉄金属 (1.8%)			
三菱マテリアル	28.1	22.4	42,112
機械 (4.2%)			
三菱重工業	47.4	45.1	98,859
電気機器 (8.2%)			
三菱電機	201.8	141.4	192,516
輸送用機器 (1.3%)			
三菱自動車工業	268	147	31,164

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
精密機器 (2.0%)			
ニコン	78.9	73.6	45,779
海運業 (2.1%)			
日本郵船	36.9	25.4	49,911
倉庫・運輸関連業 (1.9%)			
三菱倉庫	19.6	15.9	45,426
情報・通信業 (1.6%)			
三菱総合研究所	11.1	8.7	37,105
卸売業 (10.5%)			
三菱食品	15.6	13.3	37,399
三菱商事	102.3	84.7	209,293
小売業 (3.5%)			
ローソン	17.9	15.9	80,931
銀行業 (8.9%)			
三菱U F J フィナンシャル・グループ	526.6	496.7	207,421
保険業 (9.3%)			
東京海上ホールディングス	48.1	45.5	217,763
その他金融業 (3.5%)			
三菱U F J リース	186.7	176.9	82,258
不動産業 (7.9%)			
三菱地所	118.3	115.5	185,781
合 計	株 数 ・ 金 額	2,780	2,409
	銘柄数<比率>	24	24 <97.7%>

(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) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

○投資信託財産の構成

(2020年10月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	2,340,452	97.1
コール・ローン等、その他	69,991	2.9
投資信託財産総額	2,410,443	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年10月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,410,443,457
コール・ローン等	35,817,097
株式(評価額)	2,340,452,010
未収配当金	34,174,350
(B) 負債	13,795,748
未払解約金	13,795,714
未払利息	34
(C) 純資産総額(A－B)	2,396,647,709
元本	1,388,857,489
次期繰越損益金	1,007,790,220
(D) 受益権総口数	1,388,857,489口
1万口当たり基準価額(C／D)	17,256円

(注) 当親ファンドの期首元本額は1,675,758,187円、期中追加設定元本額は34,545,768円、期中一部解約元本額は321,446,466円です。

<元本の内訳>

ダイヤセレクト日本株オープン 1,388,857,489円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2019年10月22日～2020年10月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	89,997,707
受取配当金	90,013,350
受取利息	287
その他収益金	1,712
支払利息	△ 17,642
(B) 有価証券売買損益	△ 668,004,278
売買益	44,156,644
売買損	△ 712,160,922
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 578,006,571
(D) 前期繰越損益金	1,822,184,307
(E) 追加信託差損益金	28,214,254
(F) 解約差損益金	△ 264,601,770
(G) 計(C＋D＋E＋F)	1,007,790,220
次期繰越損益金(G)	1,007,790,220

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (E)追加信託差損益金は、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です。

(注) (F)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。