

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26期 運用報告書（全体版） （決算日 2021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26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 (分配落)	価 額		参 考	指 数		株 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分	込 配 金		期 騰 落	中 率		
	円		円			%	%	百万円
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
25期(2021年4月20日)	9,866		200	29.0	1,926.25	18.5	97.5	2,867
26期(2021年10月20日)	10,415		500	10.6	2,027.67	5.3	97.6	3,043

(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	
(期 首)	円		%			%	%
2021年4月20日	9,866		—	1,926.25		—	97.5
4月末	9,804		△ 0.6	1,898.24		△1.5	96.5
5月末	9,932		0.7	1,922.98		△0.2	96.8
6月末	9,978		1.1	1,943.57		0.9	98.4
7月末	9,800		△ 0.7	1,901.08		△1.3	98.6
8月末	10,239		3.8	1,960.70		1.8	97.3
9月末	10,874		10.2	2,030.16		5.4	98.8
(期 末)							
2021年10月20日	10,915		10.6	2,027.67		5.3	97.6

(注) 期末基準価額は分配金込み、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。

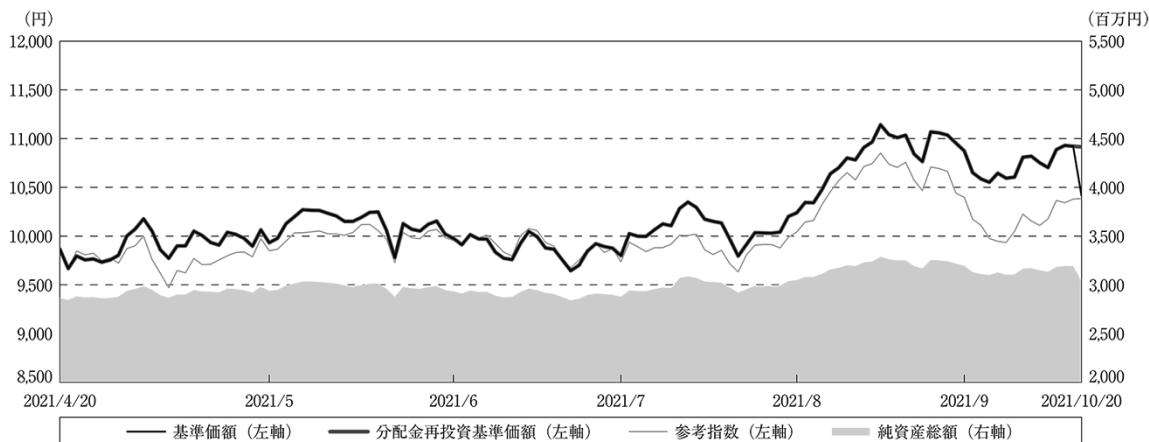
参考指数はTOPIX（東証株価指数）です。

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

(2021年4月21日～2021年10月20日)

■期中の基準価額等の推移



期 首：9,866円

期 末：10,415円 (既払分配金(税込み):500円)

騰落率：10.6% (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(2021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

- ・菅首相が退陣表明をしたことにより、新政権への期待が高まったこと
- ・国内の新型コロナウイルス感染者数の減少により緊急事態宣言が解除され、経済活動正常化への期待が高まったこと

マイナス要因

- ・新型コロナウイルスの感染拡大を受けて景気減速が懸念されたこと
- ・コロナ禍の不透明感を反映して各企業が保守的な決算見通しを発表したこと
- ・米国でテーパリング(量的緩和の縮小)の開始が意識されたこと

■投資環境

期初、東京都などで緊急事態宣言が発令されたことに加え、コロナ禍の不透明感を反映して各企業が保守的な決算見通しを発表したことを受け、国内株式市場は下落しました。その後、FRB（米連邦準備制度理事会）高官による利上げ開始に関する言及を受けて米国債利回りが大きく変動したことなどから、国内株式市場も値動きの激しい展開となりました。7月以降、世界的な新型コロナウイルス感染者数の増加が嫌気されて、国内株式市場は下落基調で推移しましたが、9月に菅首相の退陣表明を受けて新政権への期待が高まったことや、国内の新型コロナウイルス感染者数の減少による経済活動正常化への期待などから国内株式市場は上昇しました。その後、米国でテーパリングの開始が意識されると国内株式市場は上値が抑えられましたが、前期末対比上昇して当期を終えました。

■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（税引前分配金再投資）は、マザーファンドの値動きを反映し、10.6%上昇しました。

<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、「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した。

当期、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2021年6月初旬と9月初旬に行いました。

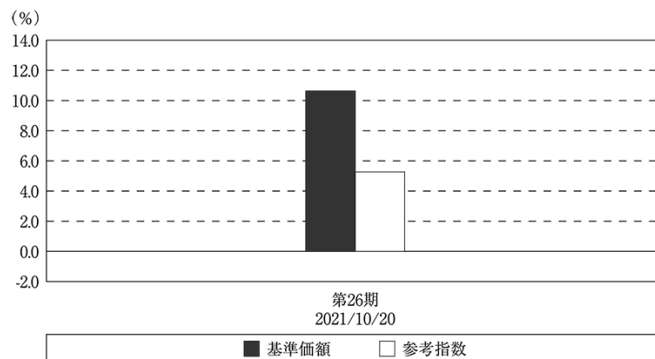
期を通じて、特に日本郵船、三菱商事、三菱UFJフィナンシャル・グループなどが上昇したことから、基準価額は11.2%上昇しました。

■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

当ファンドの収益分配方針に基づき、基準価額の水準や市況動向などを勘案して、次表の通りとしました。なお、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26期
	2021年4月21日～ 2021年10月20日
当期分配金	500
(対基準価額比率)	4.581%
当期の収益	165
当期の収益以外	334
翌期繰越分配対象額	1,506

(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。

国内では今後予定される政府の経済対策への期待や、新型コロナウイルスの新規感染者数の減少に伴う経済活動の正常化の進展により、国内株式市場は上昇基調となる展開を想定しています。

一方、中国における電力不足による経済への影響や大手不動産開発会社の債務問題のほか、米国の金融政策の方向性や債務上限問題をめぐる状況などが懸念材料になると考えています。

企業業績面では、半導体不足や物流コストの上昇などのマイナス要因はあるものの、2021年4-6月期決算では外需関連銘柄を中心に事前の予想を大きく上回るなど、通期の業績予想を引き上げる企業も多く、企業業績は堅調に推移しています。このような状況から、10月後半以降に本格化する、7-9月期決算の発表にも期待が集まっていくと考えます。

引き続き、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、「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」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

(2021年 4 月21日～2021年10月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 53	% 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)	(25)	(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)	(25)	(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)	(3)	(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	1	0.010	(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)	(1)	(0.010)	* 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	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、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	55	0.540	
期中の平均基準価額は、10,104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。

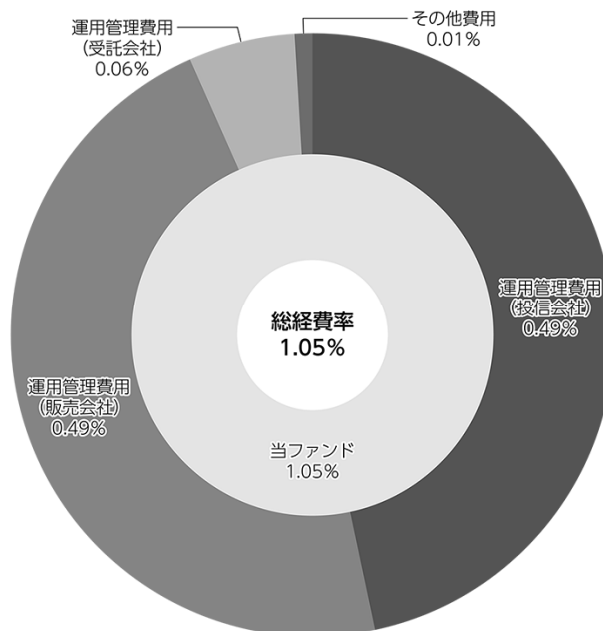
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものをみます。

(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

(2021年4月21日～2021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 71,120	千円 162,115	千口 129,132	千円 312,300

○株式売買比率

(2021年4月21日～2021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	684,903千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,911,651千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.23

(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

(2021年4月21日～2021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	15	18	276

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

(2021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	1,282,326	1,224,314	3,043,401

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

(2021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	3,043,401	94.9
コール・ローン等、その他	164,730	5.1
投資信託財産総額	3,208,131	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年10月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,208,131,884
ダイヤセレクト日本株マザーファンド(評価額)	3,043,401,324
未収入金	164,730,560
(B) 負債	164,730,560
未払収益分配金	146,100,161
未払解約金	2,710,185
未払信託報酬	15,754,469
その他未払費用	165,745
(C) 純資産総額(A－B)	3,043,401,324
元本	2,922,003,225
次期繰越損益金	121,398,099
(D) 受益権総口数	2,922,003,225口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,415円

- (注) 当ファンドの期首元本額は2,905,971,851円、期中追加設定元本額は161,472,063円、期中一部解約元本額は145,440,689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 (2021年4月21日～2021年10月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	319,713,290
売買益	328,180,248
売買損	△ 8,466,958
(B) 信託報酬等	△ 15,920,214
(C) 当期損益金(A＋B)	303,793,076
(D) 前期繰越損益金	△188,906,171
(E) 追加信託差損益金	152,611,355
(配当等相当額)	(407,746,068)
(売買損益相当額)	(△255,134,713)
(F) 計(C＋D＋E)	267,498,260
(G) 収益分配金	△146,100,161
次期繰越損益金(F＋G)	121,398,099
追加信託差損益金	108,781,306
(配当等相当額)	(364,095,577)
(売買損益相当額)	(△255,314,271)
分配準備積立金	76,158,805
繰越損益金	△ 63,542,012

- (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)	48,243,369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	407,925,626円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	130,185,548円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	586,354,543円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,006円
g. 分配金	146,100,161円
h. 分配金(1万口当たり)	500円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	500円
----------------	------

- (注) 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、分配金は全額普通分配金となります。
- (注) 分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。
- (注) 分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合は、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。
- (注) 元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者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、その後の個々の受益者の個別元本となります。

ダイヤセレクト日本株マザーファンド

運用報告書 第13期（決算日 2021年10月20日）

（計算期間 2020年10月21日～2021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
		騰 落	中 率		騰 落	中 率		
9 期(2017年10月20日)	22,603		32.1	1,730.64		26.3	98.7	百万円 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
13期(2021年10月20日)	24,858		44.1	2,027.67		24.7	97.6	3,043

○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) 2020年10月20日	17,256		—	1,625.74		—	97.7
10月末	16,732	△	3.0	1,579.33	△	2.9	98.2
11月末	18,214		5.6	1,754.92		7.9	98.0
12月末	19,074		10.5	1,804.68		11.0	98.4
2021年1月末	19,497		13.0	1,808.78		11.3	99.4
2月末	20,910		21.2	1,864.49		14.7	99.0
3月末	22,782		32.0	1,954.00		20.2	97.4
4月末	22,225		28.8	1,898.24		16.8	96.5
5月末	22,534		30.6	1,922.98		18.3	96.7
6月末	22,659		31.3	1,943.57		19.5	98.2
7月末	22,275		29.1	1,901.08		16.9	98.3
8月末	23,291		35.0	1,960.70		20.6	96.9
9月末	24,750		43.4	2,030.16		24.9	98.4
(期 末) 2021年10月20日	24,858		44.1	2,027.67		24.7	97.6

(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

(2020年10月21日～2021年10月20日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：17,256円
期 末：24,858円
騰落率： 44.1%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・米国で民主党が大統領選挙と上下両院を制したことにより、大規模な財政支援策への期待が高まったこと
- ・新型コロナウイルスワクチン開発の進展
- ・菅首相が退陣表明をしたことにより、新政権への期待が高まったこと
- ・国内の新型コロナウイルス感染者数の減少により緊急事態宣言が解除され、経済活動正常化への期待が高まったこと

マイナス要因

- ・新型コロナウイルスの感染拡大を受けて景気減速が懸念されたこと
- ・コロナ禍の不透明感を反映して各企業が保守的な決算見通しを発表したこと
- ・米国で金融政策の見直しが意識されたこと

■投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

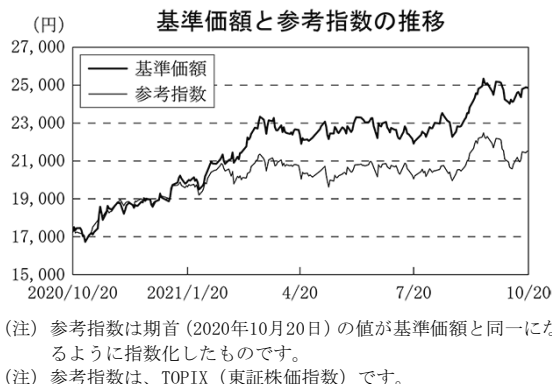
期初、欧米の新型コロナウイルス感染者数の増加が嫌気されて国内株式市場は下落しましたが、その後は新型コロナウイルスワクチン開発の報道が相次いだことから国内株式市場は上昇に転じました。2021年1月に入ると米国で民主党が大統領選挙と上下両院を制する可能性が高まり、大規模な財政支援策への期待から国内株式市場も上昇しました。4月以降は、国内の新型コロナウイルス感染者数の増加により東京都などで緊急事態宣言が発令されたことに加えて、コロナ禍の不透明感を反映して各企業が保守的な決算見通しを発表したことなどにより、国内市況は下落基調で推移しました。その後、FRB（米連邦準備制度理事会）高官による利上げ開始に関する言及を受けて米国債利回りが大きく変動したことなどから、国内株式市場も値動きの激しい展開となりましたが、9月に菅首相が事実上の退陣表明をしたことにより新政権への期待が高まったことや、国内の新型コロナウイルス感染者数の減少により経済活動正常化への期待が高まったことから、国内株式市場は上昇し、前期末対比上昇した水準で当期を終えました。

■ポートフォリオについて

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、「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した。

当期、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12月初旬と2021年3月初旬、6月初旬、9月初旬に行いました。

期を通じて、特に日本郵船、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱商事などが上昇したことから、基準価額は44.1%上昇しました。



○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。

国内では今後予定される政府の経済対策への期待や、新型コロナウイルスの新規感染者数の減少に伴う経済活動の正常化の進展により、国内株式市場は上昇基調となる展開を想定しています。

一方、中国における電力不足による経済への影響や大手不動産開発会社の債務問題のほか、米国の金融政策の方向性や債務上限問題をめぐる状況などが懸念材料になると考えています。

企業業績面では、半導体不足や物流コストの上昇などのマイナス要因はあるものの、2021年4-6月期決算では外需関連銘柄を中心に事前の予想を大きく上回るなど、通期の業績予想を引き上げる企業も多く、企業業績は堅調に推移しています。このような状況から、10月後半以降に本格化する、7-9月期決算の発表にも期待が集まっていくと考えます。

引き続き、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、「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」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10月21日～2021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 4	% 0.020	(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)	(4)	(0.020)	
合 計	4	0.020	
期中の平均基準価額は、21,245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

(2020年10月21日～2021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
		371	502,618	614	784,532

(注) 金額は受渡代金です。

○株式売買比率

(2020年10月21日～2021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	1,287,150千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,748,490千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.46

(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10月21日～2021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	41	45	276

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

(2021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 (1.4%)			
ピーエス三菱	73.6	62.5	41,812
食料品 (6.5%)			
キリンホールディングス	100.8	95.1	193,243
パルプ・紙 (－%)			
三菱製紙	48.6	—	—
化学 (9.1%)			
三菱瓦斯化学	44.5	38.5	90,667
三菱ケミカルホールディングス	219.4	155.9	151,877
大日本塗料	30.5	32	27,552
石油・石炭製品 (6.0%)			
E N E O Sホールディングス	426.8	381	177,546
ガラス・土石製品 (5.4%)			
A G C	35.3	27.5	159,500
鉄鋼 (1.0%)			
三菱製鋼	1.5	26.2	29,501
非鉄金属 (1.8%)			
三菱マテリアル	22.4	23.3	53,100
機械 (5.2%)			
三菱化工機	—	12.8	31,104
三菱重工業	45.1	40.7	124,582
電気機器 (8.2%)			
三菱電機	141.4	151.9	244,027
輸送用機器 (1.6%)			
三菱自動車工業	147	123.5	46,930
精密機器 (2.5%)			
ニコン	73.6	56.7	73,029

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
海運業 (5.1%)			
日本郵船	25.4	19.6	152,880
倉庫・運輸関連業 (1.8%)			
三菱倉庫	15.9	16.7	53,857
情報・通信業 (1.3%)			
三菱総合研究所	8.7	8.7	38,149
卸売業 (10.3%)			
三菱食品	13.3	13.4	39,516
三菱商事	84.7	73.5	265,261
小売業 (2.6%)			
ローソン	15.9	14.5	77,575
銀行業 (9.2%)			
三菱U F Jフィナンシャル・グループ	496.7	413.7	274,696
保険業 (9.3%)			
東京海上ホールディングス	45.5	45.3	276,828
その他金融業 (4.0%)			
三菱H Cキャピタル	176.9	204.3	119,719
不動産業 (7.7%)			
三菱地所	115.5	128.7	227,992
合 計	株 数 ・ 金 額	2,409	2,166
	銘柄数<比率>	24	24 <97.6%>

(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

(2021年10月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	2,970,951	92.6
コール・ローン等、その他	237,129	7.4
投資信託財産総額	3,208,080	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年10月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,208,080,786
コール・ローン等	14,396,998
株式(評価額)	2,970,951,580
未収入金	179,713,658
未収配当金	43,018,550
(B) 負債	164,730,581
未払解約金	164,730,560
未払利息	21
(C) 純資産総額(A－B)	3,043,350,205
元本	1,224,314,637
次期繰越損益金	1,819,035,568
(D) 受益権総口数	1,224,314,637口
1万口当たり基準価額(C／D)	24,858円

(注) 当親ファンドの期首元本額は1,388,857,489円、期中追加設定元本額は111,479,569円、期中一部解約元本額は276,022,421円です。

<元本の内訳>

ダイヤセレクト日本株オープン 1,224,314,637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 (2020年10月21日～2021年10月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	103,412,478
受取配当金	103,421,800
受取利息	40
その他収益金	1,382
支払利息	△ 10,744
(B) 有価証券売買損益	912,413,220
売買益	917,842,926
売買損	△ 5,429,706
(C) 当期損益金(A＋B)	1,015,825,698
(D) 前期繰越損益金	1,007,790,220
(E) 追加信託差損益金	132,279,263
(F) 解約差損益金	△ 336,859,613
(G) 計(C＋D＋E＋F)	1,819,035,568
次期繰越損益金(G)	1,819,035,568

(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。