

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	<ul style="list-style-type: none"> 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	<ul style="list-style-type: none"> 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	<p>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。</p> <p>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。</p>	

- 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%を超えるまたはを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28期 運用報告書 (全体版)

(決算日 2022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28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 (分配落)	基準価額		参考指数 騰落率	株組入比率	純資産額
		税金 分配	み 期騰 落 中率			
	円	円	%	%	%	百万円
24期(2020年10月20日)	7,803	0	2.3	1,625.74	13.5	2,396
25期(2021年4月20日)	9,866	200	29.0	1,926.25	18.5	2,867
26期(2021年10月20日)	10,415	500	10.6	2,027.67	5.3	3,043
27期(2022年4月20日)	10,704	200	4.7	1,915.15	△5.5	3,003
28期(2022年10月20日)	10,714	300	2.9	1,895.41	△1.0	3,505

(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	騰落率	参考指数	騰落率	株組入比率
(期首) 2022年4月20日	円 10,704	% -	1,915.15	% -	% 97.2
4月末	10,682	△0.2	1,899.62	△0.8	97.7
5月末	11,090	3.6	1,912.67	△0.1	97.0
6月末	11,080	3.5	1,870.82	△2.3	97.0
7月末	11,188	4.5	1,940.31	1.3	98.6
8月末	11,494	7.4	1,963.16	2.5	99.0
9月末	10,754	0.5	1,835.94	△4.1	96.8
(期末) 2022年10月20日	11,014	2.9	1,895.41	△1.0	97.1

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

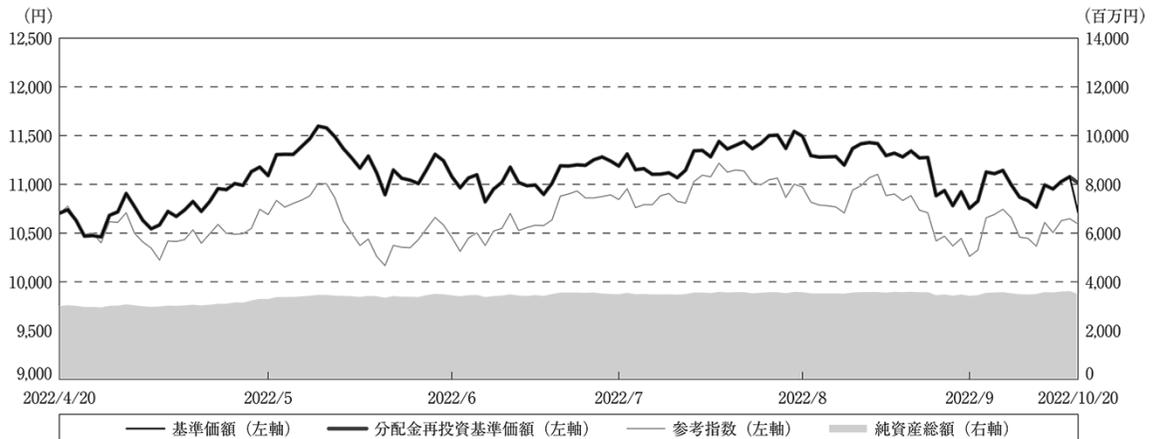
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

参考指数はTOPIX（東証株価指数）です。
TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標章または商標は、J P X総研またはJ P X総研の関連会社（以下、J P X）の知的財産であり、指数値の算出・公表、利用等、TOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXに係る標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

○運用経過

(2022年4月21日～2022年10月20日)

■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参考指数は、期首(2022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

- ・円安の進行により企業業績の拡大が期待されたこと
- ・新型コロナウイルスの感染抑制のための行動制限が緩和されたこと
- ・ファンドが保有する東京海上ホールディングスやキリンホールディングス、三菱重工業などの株価が上昇したこと

マイナス要因

- ・米国の金融引き締めペースが急速に進行したこと
- ・ウクライナ情勢の緊迫化が長期化したこと

■投資環境

当期の国内株式市場はおおむね横ばいとなりました。

期初、資源価格の上昇や米国の政策金利の引き上げなどから円安が進行し、企業業績を下支えするとの見方が広がったほか、新型コロナウイルスの感染抑制のための行動制限が緩和され国内の経済活動再開に対する期待が高まったことから、国内株式市場は上昇する場面もありましたが、米国CPI（消費者物価指数）が事前予想を上回ったことで米国の金融引き締めペースの加速が懸念され、下落しました。期半ばは、物価上昇や米国の金融引き締めペースに対する過度な懸念が後退し、国内株式市場は上昇しました。期末にかけては、米国の金融引き締め強化に対する懸念が強く意識されたほか、英国政府の景気刺激策がインフレや金利上昇をもたらすとの懸念などから、投資家のリスク回避姿勢が強まった結果、国内株式市場は下落基調となり、その後も上値の重い展開が続きました。

■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、2.9%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2022年6月初旬と2022年9月初旬に行いました。

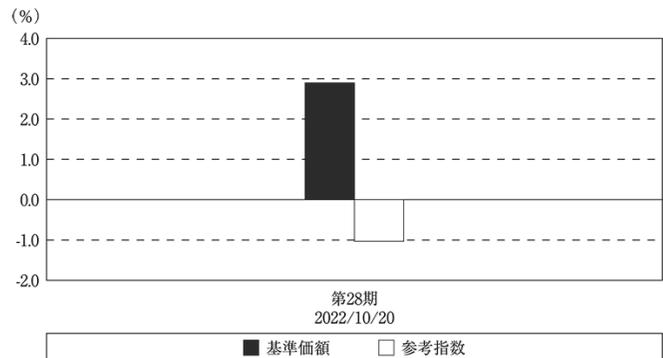
期を通じて、特に東京海上ホールディングス、キリンホールディングス、三菱重工業などが上昇したことから、基準価額は3.4%上昇しました。

■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28期
	2022年4月21日～ 2022年10月20日
当期分配金	300
(対基準価額比率)	2.724%
当期の収益	192
当期の収益以外	107
翌期繰越分配対象額	1,528

(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>

国内株式市場は上昇を予想します。

原油などの資源価格の上昇および円安の進行などを背景としたインフレの高進が個人消費の減速につながるリスクなどが懸念されているものの、政府による国内旅行の需要喚起策やインバウンド消費の増加などによって、国内経済は回復基調で推移すると想定しています。

10月下旬以降発表が本格化する7-9月期の企業決算では、円安や経済活動再開の効果もあり、底堅い結果となることが想定されます。ただし、インフレや金利上昇に伴う海外景気鈍化への懸念などが企業業績に及ぼす影響については、引き続き注視する必要があると考えます。

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」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

(2022年 4 月21日～2022年10月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 58	% 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 ）	(27)	(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 ）	(27)	(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	0.008	(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)	(0.008)	* 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	60	0.538	
期中の平均基準価額は、11,048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。

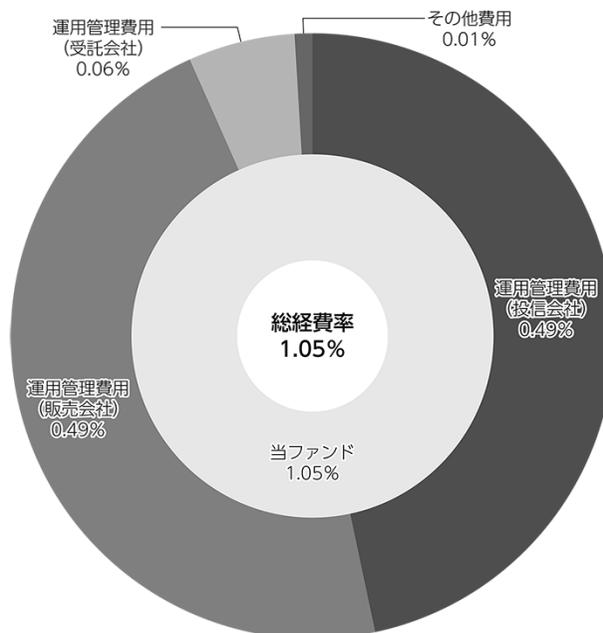
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2022年4月21日～2022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 289,643	千円 786,763	千口 141,800	千円 386,968

○株式売買比率

(2022年4月21日～2022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	579,951千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,298,180千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.17	

(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

(2022年4月21日～2022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
株式	百万円 34	百万円 15	百万円 319

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

(2022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	1,148,066	1,295,909	3,505,953

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

(2022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	3,505,953	96.8
コール・ローン等、その他	116,442	3.2
投資信託財産総額	3,622,395	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年10月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,622,395,643
ダイヤセレクト日本株マザーファンド(評価額)	3,505,953,022
未収入金	116,442,621
(B) 負債	116,442,621
未払収益分配金	98,170,742
未払解約金	279,346
未払信託報酬	17,805,196
その他未払費用	187,337
(C) 純資産総額(A-B)	3,505,953,022
元本	3,272,358,078
次期繰越損益金	233,594,944
(D) 受益権総口数	3,272,358,078口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,714円

- (注) 当ファンドの期首元本額は2,805,660,940円、期中追加設定元本額は709,552,997円、期中一部解約元本額は242,855,859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 (2022年4月21日～2022年10月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	93,203,076
売買益	107,484,719
売買損	△14,281,643
(B) 信託報酬等	△17,992,533
(C) 当期損益金(A+B)	75,210,543
(D) 前期繰越損益金	85,452,442
(E) 追加信託差損益金	171,102,701
(配当等相当額)	(434,789,101)
(売買損益相当額)	(△263,686,400)
(F) 計(C+D+E)	331,765,686
(G) 収益分配金	△98,170,742
次期繰越損益金(F+G)	233,594,944
追加信託差損益金	171,102,701
(配当等相当額)	(437,741,667)
(売買損益相当額)	(△266,638,966)
分配準備積立金	62,492,243

- (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)	63,052,265円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	12,158,278円
c. 信託約款に規定する収益調整金	437,741,667円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	85,452,442円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	598,404,652円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,828円
g. 分配金	98,170,742円
h. 分配金(1万口当たり)	300円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	300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14期 (決算日 2022年10月20日)

(計算期間 2021年10月21日～2022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 価 額		参 考 指 数		株 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率		
	円	%		%	%	百万円
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
14期(2022年10月20日)	27,054	8.8	1,895.41	△ 6.5	97.1	3,505

参考指数はTOPIX（東証株価指数）です。

TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標章または商標は、J P X総研またはJ P X総研の関連会社（以下、J P X）の知的財産であり、指数値の算出・公表、利用等、TOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXに係る標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

○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) 2021年10月20日	円 24,858	% —		% 97.6
10月末	24,320	△ 2.2	2,001.18	△1.3
11月末	22,671	△ 8.8	1,928.35	△4.9
12月末	23,638	△ 4.9	1,992.33	△1.7
2022年1月末	24,395	△ 1.9	1,895.93	△6.5
2月末	24,784	△ 0.3	1,886.93	△6.9
3月末	26,324	5.9	1,946.40	△4.0
4月末	26,112	5.0	1,899.62	△6.3
5月末	27,134	9.2	1,912.67	△5.7
6月末	27,133	9.2	1,870.82	△7.7
7月末	27,418	10.3	1,940.31	△4.3
8月末	28,193	13.4	1,963.16	△3.2
9月末	26,408	6.2	1,835.94	△9.5
(期 末) 2022年10月20日	27,054	8.8	1,895.41	△6.5

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2021年10月21日～2022年10月20日)

■期中の基準価額等の推移

期首：24,858円

期末：27,054円

騰落率： 8.8%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・円安の進行により企業業績の拡大が期待されたこと
- ・新型コロナウイルスの感染抑制のための行動制限が緩和されたこと
- ・ファンドが保有する東京海上ホールディングスや三菱重工業、日本郵船などの株価が上昇したこと

マイナス要因

- ・米国の金融引き締めペースが急速に進行したこと
- ・ウクライナ情勢に対する懸念が広がったこと

■投資環境

当期の国内株式市場は下落しました。

期初、米国の債務上限問題や米国長期金利の上昇などが重荷となり、国内株式市場は下落しました。その後は2021年7-9月期の決算発表が本格化し好業績銘柄には買いが集まりましたが、景気の先行きに対して警戒する動きも強く、国内株式市場は上値の重い展開が続きました。

2022年に入ると、米国で政策金利の引き上げが早期に進むとの観測から米国長期金利が上昇したこと、またウクライナ情勢の緊迫化が嫌気されて、国内株式市場は大幅に下落しました。期半ばは、資源価格の上昇や米国の政策金利の引き上げなどから円安が進行し、企業業績を下支えするとの見方が広がったほか、新型コロナウイルスの感染抑制のための行動制限が緩和され国内の経済活動再開に対する期待が高まったことから、国内株式市場は上昇する場面もありましたが、米国CPI(消費者物価指数)が事前予想を上回ったことで米国の金融引き締めペースの加速が懸念され、下落基調となりました。その後、物価上昇や金融引き締めペースに対する過度な懸念が後退し、国内株式市場は上昇しましたが、期末にかけては米国の金融引き締め強化に対する懸念が強く意識され、国内株式市場は再び下落基調となり、上値の重い展開が続きました。

■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2021年12月初旬と2022年3月初旬、6月初旬、9月初旬に行いました。

期を通じて、特に東京海上ホールディングス、三菱重工業、日本郵船などが上昇したことから、基準価額は8.8%上昇しました。



(注) 参考指数は期首(2021年10月20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。

○今後の運用方針

国内株式市場は上昇を予想します。

原油などの資源価格の上昇および円安の進行などを背景としたインフレの高進が個人消費の減速につながるリスクなどが懸念されているものの、政府による国内旅行の需要喚起策やインバウンド消費の増加などによって、国内経済は回復基調で推移すると想定しています。

10月下旬以降発表が本格化する7-9月期の企業決算では、円安や経済活動再開の効果もあり、底堅い結果となることが想定されます。ただし、インフレや金利上昇に伴う海外景気鈍化への懸念などが企業業績に及ぼす影響については、引き続き注視する必要があると考えます。

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」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

(2021年10月21日～2022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 (株 式)	円 4 (4)	% 0.015 (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
合 計	4	0.015	
期中の平均基準価額は、25,710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

(2021年10月21日～2022年10月20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		545	722,085	234	387,206
		(119)	(-)		

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()内は株式分割、移転、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。

○株式売買比率

(2021年10月21日～2022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	1,109,291千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,101,574千円
(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

(2021年10月21日～2022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
株式	百万円 42	百万円 71	百万円 319

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

(2022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 (1.7%)			
ピーエス三菱	62.5	95.4	58,384
食料品 (6.7%)			
麒麟ホールディングス	95.1	103.5	227,803
化学 (7.6%)			
三菱瓦斯化学	38.5	46.4	87,510
三菱ケミカルグループ	155.9	214.8	143,550
大日本塗料	32	40.1	29,032
石油・石炭製品 (5.7%)			
E.N.E.O.Sホールディングス	381	405	195,007
ガラス・土石製品 (4.4%)			
A.G.C	27.5	32.6	148,004
鉄鋼 (1.6%)			
三菱製鋼	26.2	58.5	54,346
非鉄金属 (1.7%)			
三菱マテリアル	23.3	29.4	57,976
機械 (6.7%)			
三菱化工機	12.8	22.1	46,719
三菱重工業	40.7	37.2	181,982
電気機器 (8.5%)			
三菱電機	151.9	209.2	290,578
輸送用機器 (2.0%)			
三菱自動車工業	123.5	137.6	69,350
精密機器 (2.3%)			
ニコン	56.7	58.2	78,861

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 (5.0%)				
日本郵船	19.6	63.2	169,692	
倉庫・運輸関連業 (1.8%)				
三菱倉庫	16.7	17.3	59,512	
情報・通信業 (1.7%)				
三菱総合研究所	8.7	11.5	56,062	
卸売業 (9.7%)				
三菱食品	13.4	16.7	51,770	
三菱商事	73.5	68.1	277,575	
小売業 (2.6%)				
ローソン	14.5	19	89,585	
銀行業 (8.6%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	413.7	424.8	294,386	
保険業 (9.4%)				
東京海上ホールディングス	45.3	120.5	319,445	
その他金融業 (4.2%)				
三菱HCキャピタル	204.3	222.4	141,668	
不動産業 (8.1%)				
三菱地所	128.7	143.4	276,475	
合 計	株 数・金 額	2,166	2,596	3,405,281
	銘柄数<比率>	24	24	<97.1%>

(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

(2022年10月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	3,405,281	94.0
コール・ローン等、その他	217,133	6.0
投資信託財産総額	3,622,414	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年10月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,622,414,412
コール・ローン等	152,552,672
株式(評価額)	3,405,281,740
未収配当金	64,580,000
(B) 負債	116,442,897
未払解約金	116,442,621
未払利息	276
(C) 純資産総額(A-B)	3,505,971,515
元本	1,295,909,301
次期繰越損益金	2,210,062,214
(D) 受益権総口数	1,295,909,301口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,054円

(注) 当親ファンドの期首元本額は1,224,314,637円、期中追加設定元本額は353,273,604円、期中一部解約元本額は281,678,940円です。

<元本の内訳>

ダイヤセレクト日本株オープン 1,295,909,301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 (2021年10月21日～2022年10月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	150,030,365
受取配当金	150,048,400
受取利息	196
その他収益金	639
支払利息	△ 18,870
(B) 有価証券売買損益	99,451,703
売買益	283,875,482
売買損	△ 184,423,779
(C) 当期損益金(A+B)	249,482,068
(D) 前期繰越損益金	1,819,035,568
(E) 追加信託差損益金	591,863,752
(F) 解約差損益金	△ 450,319,174
(G) 計(C+D+E+F)	2,210,062,214
次期繰越損益金(G)	2,210,062,214

(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。