

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2044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。</p> <p>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30期 運用報告書 (全体版)

(決算日 2023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30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)	標準価額		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
26期(2021年10月20日)	10,415	500	10.6	3,230.11	6.4	97.6
27期(2022年4月20日)	10,704	200	4.7	3,091.61	△ 4.3	97.2
28期(2022年10月20日)	10,714	300	2.9	3,100.67	0.3	97.1
29期(2023年4月20日)	11,382	500	10.9	3,384.86	9.2	96.5
30期(2023年10月20日)	13,295	500	21.2	3,784.60	11.8	97.8

(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) 2023年4月20日	円 11,382	% —	3,384.86	% —	% 96.5
4月末	11,451	0.6	3,414.45	0.9	97.5
5月末	11,867	4.3	3,537.93	4.5	96.8
6月末	13,051	14.7	3,805.00	12.4	98.3
7月末	13,484	18.5	3,861.80	14.1	99.5
8月末	13,662	20.0	3,878.51	14.6	99.4
9月末	14,294	25.6	3,898.26	15.2	98.4
(期末) 2023年10月20日	13,795	21.2	3,784.60	11.8	97.8

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

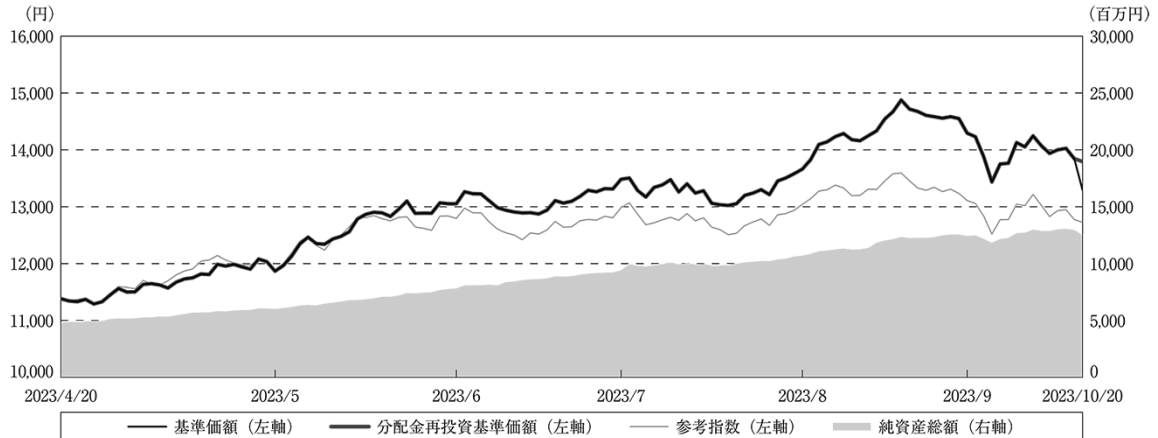
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

参考指数はTOPIX（配当込み）です。
配当込みTOPIX（以下「TOPIX（配当込み）」といいます。）の指数値およびTOPIX（配当込み）にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIX（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX（配当込み）にかか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（配当込み）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

(2023年4月21日～2023年10月20日)

■期中の基準価額等の推移



期首：11,382円

期末：13,295円 (既払分配金(税込み)：500円)

騰落率：21.2% (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参考指数は、期首(2023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(配当込み)です。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・2024年3月期の企業業績見通しが堅調な内容となったこと
- ・日銀が金融緩和政策を維持したこと
- ・保有している三菱商事、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱重工などの株価が上昇したこと

マイナス要因

- ・米国の長期金利が高止まりしていること

■投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初、2024年3月期の企業業績見通しが堅調な内容となったことにより安心感が広がり、国内株式市場は上昇しました。期半ばは、米国の利上げが長期化することへの懸念が強まったことで国内株式市場は軟調に推移しましたが、その後日銀が金融緩和政策を維持したことなどが好感され、上昇に転じました。期末にかけては、米国の長期金利が高止まりしていることや、中東で地政学的リスクが高まったことなどが嫌気され、国内株式市場は下落しました。

■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、21.2%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2023年6月初旬、9月初旬に行いました。

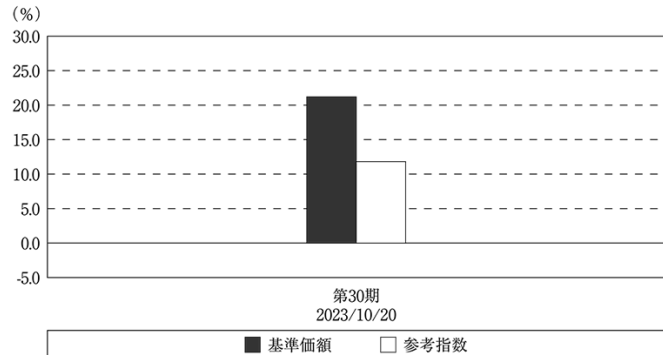
期を通じて、特に三菱商事、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱重工業などの株価が上昇したことから、基準価額は21.8%上昇しました。

■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（配当込み）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30期
	2023年4月21日～ 2023年10月20日
当期分配金	500
(対基準価額比率)	3.625%
当期の収益	183
当期の収益以外	316
翌期繰越分配対象額	3,294

(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>

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

(2023年 4 月21日～2023年10月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	68	0.522	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(32)	(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 ）	(32)	(0.247)	*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 ）	(4)	(0.027)	*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	5	0.042	(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 ）	(5)	(0.042)	*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	0.004	(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)	(0.004)	*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	73	0.568	
期中の平均基準価額は、12,968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。

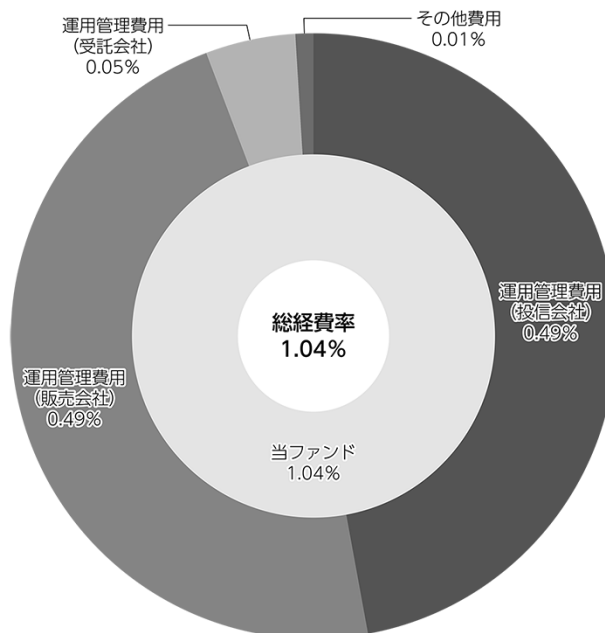
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.04%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

(2023年4月21日～2023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	2,250,733 千口	7,847,098 千円	433,917 千口	1,516,047 千円

○株式売買比率

(2023年4月21日～2023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	7,991,900千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,459,892千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.94

(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

(2023年4月21日～2023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 686	百万円 34	百万円 1,129

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

(2023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	1,591,489	3,408,306	12,515,641

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

(2023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	12,515,641	95.9
コール・ローン等、その他	529,709	4.1
投資信託財産総額	13,045,350	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年10月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	13,045,350,787
ダイヤセレクト日本株マザーファンド(評価額)	12,515,641,648
未収入金	529,709,139
(B) 負債	529,709,139
未払収益分配金	470,700,612
未払解約金	12,821,911
未払信託報酬	45,864,340
その他未払費用	322,276
(C) 純資産総額(A-B)	12,515,641,648
元本	9,414,012,257
次期繰越損益金	3,101,629,391
(D) 受益権総口数	9,414,012,257口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,295円

- (注) 当ファンドの期首元本額は4,216,137,997円、期中追加設定元本額は5,977,415,993円、期中一部解約元本額は779,541,733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 (2023年4月21日～2023年10月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	1,298,224,623
売買益	1,390,691,749
売買損	△ 92,467,126
(B) 信託報酬等	△ 46,186,616
(C) 当期損益金(A+B)	1,252,038,007
(D) 前期繰越損益金	356,904,589
(E) 追加信託差損益金	1,963,387,407
(配当等相当額)	(1,590,980,013)
(売買損益相当額)	(372,407,394)
(F) 計(C+D+E)	3,572,330,003
(G) 収益分配金	△ 470,700,612
次期繰越損益金(F+G)	3,101,629,391
追加信託差損益金	1,680,967,040
(配当等相当額)	(1,612,131,799)
(売買損益相当額)	(68,835,241)
分配準備積立金	1,420,662,351

- (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)	170,168,803円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	1,081,869,204円
c. 信託約款に規定する収益調整金	1,963,387,407円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	356,904,589円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	3,572,330,003円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,794円
g. 分配金	470,700,612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。

○お知らせ

NISA「成長投資枠」の対象商品になるための要件として、「2024年1月時点で信託期間が20年を超えていること」および「ヘッジ目的の場合等を除き、デリバティブ取引による運用を行っていないこと」が定められており、当該要件を満たすため、当ファンドおよび当ファンドが投資対象とするマザーファンドにおいて所要の約款変更を2023年7月21日付で行いました。

ダイヤセレクト日本株マザーファンド

運用報告書 第15期 (決算日 2023年10月20日)

(計算期間 2022年10月21日～2023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
11期(2019年10月21日)	円 20,874	△ 7.6 %	2,480.43	△ 1.5 %	98.0 %	百万円 3,497
12期(2020年10月20日)	17,256	△17.3	2,536.53	2.3	97.7	2,396
13期(2021年10月20日)	24,858	44.1	3,230.11	27.3	97.6	3,043
14期(2022年10月20日)	27,054	8.8	3,100.67	△ 4.0	97.1	3,505
15期(2023年10月20日)	36,721	35.7	3,784.60	22.1	97.8	12,515

参考指数はTOPIX（配当込み）です。

配当込みTOPIX（以下「TOPIX（配当込み）」といいます。）の指数値およびTOPIX（配当込み）にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIX（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX（配当込み）にかか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（配当込み）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	騰 落 率	参 考 指 数	騰 落 率	株 組 入 比 率
(期 首) 2022年10月20日	27,054	—	3,100.67	—	97.1
10月末	27,062	0.0	3,156.44	1.8	96.2
11月末	28,388	4.9	3,249.61	4.8	96.3
12月末	27,629	2.1	3,101.25	0.0	97.6
2023年1月末	28,309	4.6	3,238.48	4.4	96.6
2月末	29,664	9.6	3,269.12	5.4	96.5
3月末	29,186	7.9	3,324.74	7.2	96.6
4月末	30,342	12.2	3,414.45	10.1	97.5
5月末	31,475	16.3	3,537.93	14.1	96.7
6月末	34,639	28.0	3,805.00	22.7	98.1
7月末	35,817	32.4	3,861.80	24.5	99.3
8月末	36,321	34.3	3,878.51	25.1	99.2
9月末	38,028	40.6	3,898.26	25.7	98.1
(期 末) 2023年10月20日	36,721	35.7	3,784.60	22.1	97.8

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2022年10月21日～2023年10月20日)

■期中の基準価額等の推移

期首：27,054円
 期末：36,721円
 騰落率：35.7%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・日銀が金融緩和政策を維持したこと
- ・保有している三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱商事、三菱重工業などの株価が上昇したこと

マイナス要因

- ・米国の長期金利が高止まりしていること

■投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初、米国のコアCPI（消費者物価指数）が事前予想を下回ったことから、利上げに対する過度な懸念が和らぎ、国内株式市場は上昇しました。2023年3月には米国の地方銀行が経営破綻したことで、金融システム不安が世界的に波及する懸念が高まり国内株式市場は下落しましたが、その後FRB（米連邦準備制度理事会）などが迅速に預金者救済措置を発表したことで金融システム不安が和らぎ、上昇に転じました。期半ば以降は、2024年3月期の企業業績見通しが堅調な内容となったことや、日銀が金融緩和政策を維持したことなどが好感され、国内株式市場は上昇しました。期末にかけては、米国の長期金利が高止まりしたことや、中東で地政学的リスクが高まったことが嫌気され、国内株式市場は下落しました。

■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2022年12月初旬と2023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UFJフィナンシャル・グループ、三菱商事、三菱重工業などの株価が上昇したことから、基準価額は35.7%上昇しました。

○今後の運用方針

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。



(注) 参考指数は期首(2022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(配当込み)です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年10月21日～2023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 21 (21)	% 0.067 (0.067)	(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	21	0.067	
期中の平均基準価額は、31,405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

(2022年10月21日～2023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 5,216	千円 8,321,345	千株 643	千円 1,071,928

(注) 金額は受渡代金です。

○ 株式売買比率

(2022年10月21日～2023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	9,393,274千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,275,131千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.49

(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10月21日～2023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	768	70	1,129

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

(2023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 (0.4%)			
ピーエス三菱	95.4	61.3	49,040
食料品 (6.0%)			
キリンホールディングス	103.5	355.1	735,589
化学 (7.6%)			
三菱瓦斯化学	46.4	164.7	332,611
三菱ケミカルグループ	214.8	655.2	560,327
大日本塗料	40.1	33.9	31,832
石油・石炭製品 (5.8%)			
E.N.E.O.Sホールディングス	405	1,259	711,335
ガラス・土石製品 (4.6%)			
AGC	32.6	107.9	557,735
鉄鋼 (1.1%)			
三菱製鋼	58.5	94.1	130,328
非鉄金属 (2.2%)			
三菱マテリアル	29.4	115.7	269,002
機械 (7.7%)			
三菱化工機	22.1	21.5	57,942
三菱重工業	37.2	111.3	880,828
電気機器 (7.7%)			
三菱電機	209.2	537.4	948,511
輸送用機器 (2.6%)			
三菱自動車工業	137.6	599.1	314,168

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 (2.5%)				
ニコン	58.2	207.6	309,324	
海運業 (6.1%)				
日本郵船	63.2	192	741,696	
倉庫・運輸関連業 (1.8%)				
三菱倉庫	17.3	57.3	222,266	
情報・通信業 (0.9%)				
三菱総合研究所	11.5	23.9	114,959	
卸売業 (9.7%)				
三菱食品	16.7	55	215,600	
三菱商事	68.1	140.2	973,969	
小売業 (2.9%)				
ローソン	19	50.6	350,911	
銀行業 (9.1%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	424.8	905.3	1,118,045	
保険業 (9.2%)				
東京海上ホールディングス	120.5	336.9	1,129,625	
その他金融業 (5.0%)				
三菱HCキャピタル	222.4	637.2	611,457	
不動産業 (7.1%)				
三菱地所	143.4	447.6	874,834	
合 計	株 数・金 額	2,596	7,169	12,241,939
	銘柄数<比率>	24	24	<97.8%>

(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

(2023年10月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	12,241,939	93.8
コール・ローン等、その他	803,338	6.2
投資信託財産総額	13,045,277	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年10月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	13,045,277,589
コール・ローン等	329,200,010
株式(評価額)	12,241,939,900
未収入金	315,586,779
未収配当金	158,550,900
(B) 負債	529,709,252
未払解約金	529,709,139
未払利息	113
(C) 純資産総額(A-B)	12,515,568,337
元本	3,408,306,323
次期繰越損益金	9,107,262,014
(D) 受益権総口数	3,408,306,323口
1万口当たり基準価額(C/D)	36,721円

(注) 当親ファンドの期首元本額は1,295,909,301円、期中追加設定元本額は2,731,142,292円、期中一部解約元本額は618,745,270円です。

<元本の内訳>

ダイヤセレクト日本株オープン 3,408,306,323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 (2022年10月21日～2023年10月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	269,621,501
受取配当金	269,702,850
受取利息	1,066
その他収益金	1,206
支払利息	△ 83,621
(B) 有価証券売買損益	1,587,241,598
売買益	1,622,133,028
売買損	△ 34,891,430
(C) 当期損益金(A+B)	1,856,863,099
(D) 前期繰越損益金	2,210,062,214
(E) 追加信託差損益金	6,479,035,336
(F) 解約差損益金	△1,438,698,635
(G) 計(C+D+E+F)	9,107,262,014
次期繰越損益金(G)	9,107,262,014

(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。

○お知らせ

当マザーファンドを投資対象とする公募投信が、NISA「成長投資枠」の対象商品になるための要件を満たすため、当マザーファンドにおいて所要の約款変更を2023年7月21日付で行いました。