



**DL日本株式オープン  
(愛称:技あり一本(るいとう))**

**追加型株式投資信託 / 国内株式型 (一般型) / 自動けいぞく投資専用**

**投資信託説明書(目論見書)**

**(訂正事項分)**

**2005年12月**

**興銀第一ライフ・アセットマネジメント**



**D L 日本株式オープン**  
**(愛称：技あり一本(るいとう))**

**投資信託説明書(交付目論見書)**

(訂正事項分)

2005年12月

興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

1. 「D L 日本株式オープン(愛称：技あり一本(るいとう))」の受益証券の募集については、委託会社は、証券取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を平成17年6月15日に関東財務局長に提出しており、平成17年6月16日にその効力が発生しております。  
また、同法第7条の規定により有価証券届出書の訂正届出書を平成17年12月15日に関東財務局長に提出しております。
  
2. 「D L 日本株式オープン(愛称：技あり一本(るいとう))」の受益証券の価額は、同ファンドに組入れられる有価証券の値動きの影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家のみなさまに帰属します。したがって、当ファンドは**元本が保証されているものではありません。**

1. 投資信託説明書(交付目論見書)の訂正理由  
「D L 日本株式オープン(愛称：技あり一本(るいとう))」投資信託説明書(交付目論見書)2005年6月の記載事項のうち、訂正すべき事項が生じたので、これを以下の文言に訂正いたします。
  
2. 訂正箇所および訂正事項  
(次頁以降)

# 投資方針

## (5) 運用状況

### (1) 【投資状況】

平成17年10月17日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	4,513,479,118	99.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,475,142	0.10
合計(純資産総額)		4,517,954,260	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(参考) マザーファンドの投資状況

D Lジャパン・リサーチ・オープン・マザーファンド

平成17年10月17日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	23,199,127,350	98.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		462,880,662	1.96
合計(純資産総額)		23,662,008,012	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

### (2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成17年10月17日現在

順位	銘柄名	国名	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	D Lジャパン・リサーチ・オープン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,071,229,667	12,051.00	3,701,138,899	14,696.00	4,513,479,118	99.90

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は1銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成17年10月17日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産  
DLジャパン・リサーチ・オープン・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成17年10月17日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	933	908,000.00	847,164,000	1,380,000.00	1,287,540,000	5.44
2	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	株式	日本	情報・通信業	5,120	174,655.99	894,238,679	198,000.00	1,013,760,000	4.28
3	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	176,200	3,880.00	683,656,000	5,280.00	930,336,000	3.93
4	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	853	719,000.00	613,307,000	1,020,000.00	870,060,000	3.68
5	日産自動車	株式	日本	輸送用機器	563,800	1,080.00	608,904,000	1,261.00	710,951,800	3.00
6	新日本製鉄	株式	日本	鉄鋼	1,550,000	259.00	401,450,000	392.00	607,600,000	2.57
7	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	840	556,321.04	467,309,676	662,000.00	556,080,000	2.35
8	KDDI	株式	日本	情報・通信業	770	500,000.00	385,000,000	661,000.00	508,970,000	2.15
9	信越化学工業	株式	日本	化学	95,000	4,047.88	384,548,906	4,980.00	473,100,000	2.00
10	大日本インキ化学工業	株式	日本	化学	1,400,000	321.00	449,400,000	337.00	471,800,000	1.99
11	日本特殊陶業	株式	日本	ガラス・土石製品	275,000	1,342.92	369,303,270	1,688.00	464,200,000	1.96
12	東芝	株式	日本	電気機器	890,000	485.05	431,692,256	519.00	461,910,000	1.95
13	三菱商事	株式	日本	卸売業	200,000	1,469.00	293,800,000	2,110.00	422,000,000	1.78
14	新光電気工業	株式	日本	電気機器	56,000	5,048.29	282,704,450	7,530.00	421,680,000	1.78
15	イオン	株式	日本	小売業	171,300	1,644.00	281,617,200	2,445.00	418,828,500	1.77
16	旭硝子	株式	日本	ガラス・土石製品	342,000	1,059.39	362,311,741	1,207.00	412,794,000	1.74
17	旭化成	株式	日本	化学	690,000	552.26	381,056,218	586.00	404,340,000	1.71
18	住友不動産	株式	日本	不動産業	230,000	1,197.01	275,311,196	1,710.00	393,300,000	1.66
19	住友商事	株式	日本	卸売業	334,000	891.00	297,594,000	1,142.00	381,428,000	1.61
20	住友信託銀行	株式	日本	銀行業	370,000	667.00	246,790,000	909.00	336,330,000	1.42
21	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	47,500	5,767.33	273,948,210	6,500.00	308,750,000	1.30
22	住友電気工業	株式	日本	非鉄金属	206,000	1,144.00	235,664,000	1,480.00	304,880,000	1.29
23	SBIホールディングス	株式	日本	その他金融業	6,007	34,600.00	207,842,200	48,150.00	289,237,050	1.22
24	デンソー	株式	日本	輸送用機器	90,500	2,460.00	222,630,000	3,190.00	288,695,000	1.22
25	芙蓉総合リース	株式	日本	その他金融業	80,500	2,895.00	233,047,500	3,550.00	285,775,000	1.21
26	オートバックスセブン	株式	日本	卸売業	60,300	3,559.58	214,642,678	4,560.00	274,968,000	1.16
27	日立化成工業	株式	日本	化学	121,000	2,018.14	244,194,940	2,250.00	272,250,000	1.15
28	八千代工業	株式	日本	輸送用機器	136,000	1,551.00	210,936,000	1,996.00	271,456,000	1.15
29	川崎重工業	株式	日本	輸送用機器	980,000	202.00	197,960,000	272.00	266,560,000	1.13
30	アステラス製薬	株式	日本	医薬品	60,500	4,353.81	263,405,208	4,370.00	264,385,000	1.12

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 種類別業種別投資比率

平成17年10月17日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	銀行業	13.20
	輸送用機器	12.18
	電気機器	10.13
	化学	8.74
	情報・通信業	8.65
	卸売業	7.16
	小売業	4.98
	機械	4.54
	医薬品	3.83
	ガラス・土石製品	3.71
	非鉄金属	3.55
	その他金融業	3.54
	陸運業	3.45
	鉄鋼	3.06
	不動産業	2.66
	その他製品	1.05
	精密機器	0.92
	パルプ・紙	0.85
	サービス業	0.72
	食料品	0.53
ゴム製品	0.40	
水産・農林業	0.11	
証券、商品先物取引業	0.09	
合計		98.04

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

**(3)【運用実績】****【純資産の推移】**

直近日（平成17年10月17日）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成11年3月15日現在）	231	244	1.0469	1.1079
第2期末（平成12年3月15日現在）	2,483	3,536	1.1084	1.5784
第3期末（平成13年3月15日現在）	4,442	4,442	0.7604	0.7604
第4期末（平成14年3月15日現在）	5,164	5,164	0.6879	0.6879
第5期末（平成15年3月17日現在）	3,004	3,004	0.4731	0.4731
第6期末（平成16年3月15日現在）	4,049	4,049	0.6518	0.6518
第7期末（平成17年3月15日現在）	4,087	4,087	0.6969	0.6969
平成16年10月末	3,849		0.6307	
11月末	3,898		0.6406	
12月末	4,018		0.6683	
平成17年1月末	4,053		0.6755	
2月末	4,088		0.6925	
3月末	4,018		0.6887	
4月末	3,844		0.6613	
5月末	3,859		0.6675	
6月末	3,952		0.6916	
7月末	4,043		0.7167	
8月末	4,203		0.7678	
9月末	4,635		0.8617	
10月17日	4,517		0.8424	

**【分配の推移】**

	1口当たりの分配額（円）
第1期	0.0610
第2期	0.4700
第3期	-
第4期	-
第5期	-
第6期	-
第7期	-

**【収益率の推移】**

	収益率（％）
第1期	10.79
第2期	50.77
第3期	31.40
第4期	9.53
第5期	31.23
第6期	37.77
第7期	6.92
第8期中間計算期間	15.10

(注)収益率 = (当期分配付き基準価額 - 前期分配落ち基準価額) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

## 財務ハイライト情報

- (1) 当財務ハイライト情報は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」の「第4 ファンドの経理状況」の「中間財務諸表」（以下「中間財務諸表」という。）より抜粋しております。
- (2) 当ファンドの中間財務諸表は証券取引法第193条の2の規定に基づき、第7期中間計算期間（平成16年3月16日から平成16年9月15日まで）及び第8期中間計算期間（平成17年3月16日から平成17年9月15日まで）について、新日本監査法人による中間監査を受けております。  
その中間監査報告書は、当該中間財務諸表に添付しております。

## (1)【中間貸借対照表】

科目	注記 番号	第7期中間計算期間末 平成16年9月15日現在	第8期中間計算期間末 平成17年9月15日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託		39,181	29,387
コール・ローン		13,976,178	14,358,188
親投資信託受益証券		4,013,593,683	4,323,967,856
未収入金		39,000,000	35,000,000
流動資産合計		4,066,609,042	4,373,355,431
資産合計		4,066,609,042	4,373,355,431
負債の部			
流動負債			
未払解約金		6,238,985	7,049,388
未払受託者報酬		2,175,618	2,114,776
未払委託者報酬		31,328,883	30,452,639
その他未払費用		49,939	48,549
流動負債合計		39,793,425	39,665,352
負債合計		39,793,425	39,665,352
純資産の部			
元本			
元本		6,138,706,678	5,402,801,817
剰余金			
中間欠損金		2,111,891,061	1,069,111,738
(うち分配準備積立金)		(115,793,144)	(97,474,541)
剰余金合計		2,111,891,061	1,069,111,738
純資産合計		4,026,815,617	4,333,690,079
負債・純資産合計		4,066,609,042	4,373,355,431

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

科目	注記 番号	第7期中間計算期間	第8期中間計算期間
		自平成16年3月16日 至平成16年9月15日	自平成17年3月16日 至平成17年9月15日
		金額(円)	金額(円)
経常損益の部			
営業損益の部			
営業収益			
受取利息		-	1
有価証券売買等損益		60,285,570	611,453,057
営業収益合計		60,285,570	611,453,058
営業費用			
受託者報酬		2,175,618	2,114,776
委託者報酬		31,328,883	30,452,639
その他費用		49,939	48,549
営業費用合計		33,554,440	32,615,964
営業利益		26,731,130	578,837,094
経常利益		26,731,130	578,837,094
中間純利益		26,731,130	578,837,094
一部解約に伴う中間純利益分配額		4,637,504	10,707,760
期首欠損金		2,163,271,667	1,777,810,077
欠損金減少額		95,033,231	177,231,918
中間一部解約に伴う欠損金減少額		95,033,231	177,231,918
欠損金増加額		65,746,251	36,662,913
中間追加信託に伴う欠損金増加額		65,746,251	36,662,913
分配金		-	-
中間欠損金		2,111,891,061	1,069,111,738

重要な会計方針

項目	第7期中間計算期間	第8期中間計算期間
	自平成16年3月16日 至平成16年9月15日	自平成17年3月16日 至平成17年9月15日
有価証券の評価基準及び 評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評 価しております。時価評価にあたっては、 親投資信託受益証券の基準価額に基づいて 評価しております。	親投資信託受益証券 同左

**D L 日本株式オープン**  
**(愛称：技あり一本(るいとう))**

**投資信託説明書(請求目論見書)**

(訂正事項分)

2005年12月

興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

1. 「D L 日本株式オープン(愛称：技あり一本(るいとう))」の受益証券の募集については、委託会社は、証券取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を平成17年6月15日に関東財務局長に提出しており、平成17年6月16日にその効力が発生しております。  
また、同法第7条の規定により有価証券届出書の訂正届出書を平成17年12月15日に関東財務局長に提出しております。
  
2. 「D L 日本株式オープン(愛称：技あり一本(るいとう))」の受益証券の価額は、同ファンドに組入れられる有価証券の値動きの影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家のみなさまに帰属します。したがって、当ファンドは**元本が保証されているものではありません。**

1. 投資信託説明書(請求目論見書)の訂正理由  
「D L 日本株式オープン(愛称：技あり一本(るいとう))」投資信託説明書(請求目論見書)2005年6月の記載事項のうち、訂正すべき事項が生じたので、これを以下の文言に訂正いたします。
  
2. 訂正箇所および訂正事項  
(次頁以降)

## 第4 ファンドの経理状況

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは証券取引法第193条の2の規定に基づき、第7期中間計算期間(平成16年3月16日から平成16年9月15日まで)及び第8期中間計算期間(平成17年3月16日から平成17年9月15日まで)の中間財務諸表について、新日本監査法人による中間監査を受けております。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成16年11月22日

興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

## 新日本監査法人

代表社員 公認会計士

関与社員 山本 禎良



関与社員 公認会計士

山内 功彦



当監査法人は、証券取引法第193条の2の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDL日本株式オープンの平成16年3月16日から平成16年9月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表及び中間損益及び剰余金計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DL日本株式オープンの平成16年9月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成16年3月16日から平成16年9月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は関与社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

# 独立監査人の中間監査報告書

平成17年11月15日

興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

## 新日本監査法人

代表社員 公認会計士  
業務執行社員

山本 禎良 

業務執行社員 公認会計士

山内 三彦 

当監査法人は、証券取引法第193条の2の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDL日本株式オープンの平成17年3月16日から平成17年9月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表及び中間損益及び剰余金計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DL日本株式オープンの平成17年9月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成17年3月16日から平成17年9月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

中間財務諸表

D L 日本株式オープン

(1) 【中間貸借対照表】

科目	注記 番号	第7期中間計算期間末 平成16年9月15日現在	第8期中間計算期間末 平成17年9月15日現在
		金額(円)	金額(円)
資 産 の 部			
流動資産			
金銭信託		39,181	29,387
コール・ローン		13,976,178	14,358,188
親投資信託受益証券		4,013,593,683	4,323,967,856
未収入金		39,000,000	35,000,000
流動資産合計		4,066,609,042	4,373,355,431
資産合計		4,066,609,042	4,373,355,431
負 債 の 部			
流動負債			
未払解約金		6,238,985	7,049,388
未払受託者報酬		2,175,618	2,114,776
未払委託者報酬		31,328,883	30,452,639
その他未払費用		49,939	48,549
流動負債合計		39,793,425	39,665,352
負債合計		39,793,425	39,665,352
純 資 産 の 部			
元 本			
元本		6,138,706,678	5,402,801,817
剰余金			
中間欠損金		2,111,891,061	1,069,111,738
(うち分配準備積立金)		(115,793,144)	(97,474,541)
剰余金合計		2,111,891,061	1,069,111,738
純資産合計		4,026,815,617	4,333,690,079
負債・純資産合計		4,066,609,042	4,373,355,431

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

科目	注記 番号	第7期中間計算期間	第8期中間計算期間
		自平成16年3月16日 至平成16年9月15日	自平成17年3月16日 至平成17年9月15日
		金額(円)	金額(円)
経常損益の部			
営業損益の部			
営業収益			
受取利息		-	1
有価証券売買等損益		60,285,570	611,453,057
営業収益合計		60,285,570	611,453,058
営業費用			
受託者報酬		2,175,618	2,114,776
委託者報酬		31,328,883	30,452,639
その他費用		49,939	48,549
営業費用合計		33,554,440	32,615,964
営業利益		26,731,130	578,837,094
経常利益		26,731,130	578,837,094
中間純利益		26,731,130	578,837,094
一部解約に伴う中間純利益分配額		4,637,504	10,707,760
期首欠損金		2,163,271,667	1,777,810,077
欠損金減少額		95,033,231	177,231,918
中間一部解約に伴う欠損金減少額		95,033,231	177,231,918
欠損金増加額		65,746,251	36,662,913
中間追加信託に伴う欠損金増加額		65,746,251	36,662,913
分配金		-	-
中間欠損金		2,111,891,061	1,069,111,738

重要な会計方針

項目	第7期中間計算期間	第8期中間計算期間
	自平成16年3月16日 至平成16年9月15日	自平成17年3月16日 至平成17年9月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第7期中間計算期間末 平成16年9月15日現在		第8期中間計算期間末 平成17年9月15日現在	
1. 期首元本額	6,212,464,029円	1. 期首元本額	5,865,333,596円
期中追加設定元本額	199,406,934円	期中追加設定元本額	121,921,206円
期中解約元本額	273,164,285円	期中解約元本額	584,452,985円
2. 元本の欠損		2. 元本の欠損	
中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,111,891,061円であります。		中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,069,111,738円であります。	

(中間損益及び剰余金計算書関係)

該当事項はありません。

(有価証券関係)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第7期中間計算期間末 平成16年9月15日現在		第8期中間計算期間末 平成17年9月15日現在	
1口当たり純資産額	0.6560円	1口当たり純資産額	0.8021円
(1万口当たり純資産額)	(6,560円)	(1万口当たり純資産額)	(8,021円)

(参考)

当ファンドは「DLジャパン・リサーチ・オープン・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「DLジャパン・リサーチ・オープン・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成16年9月15日現在	平成17年9月15日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託		541,122	314,426
コール・ローン		258,132,467	207,636,975
株式		21,347,908,100	22,288,277,300
未収入金		495,987,920	372,110,606
未収配当金		4,386,150	4,886,523
流動資産合計		22,106,955,759	22,873,225,830
資産合計		22,106,955,759	22,873,225,830
負債の部			
流動負債			
未払金		405,768,850	223,985,220
未払解約金		86,000,000	75,000,000
流動負債合計		491,768,850	298,985,220
負債合計		491,768,850	298,985,220
純資産の部			
元本			
元本		19,198,960,328	16,156,671,132
剰余金			
剰余金		2,416,226,581	6,417,569,478
剰余金合計		2,416,226,581	6,417,569,478
純資産合計		21,615,186,909	22,574,240,610
負債・純資産合計		22,106,955,759	22,873,225,830

重要な会計方針

項目	自平成16年3月16日 至平成16年9月15日	自平成17年3月16日 至平成17年9月15日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、証券取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、日本証券業協会が発表する基準値、又は証券会社等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、証券取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、証券取引所が発表する基準値、又は証券会社等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、いまだ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。	受取配当金 同左
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成16年6月12日から平成17年6月13日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本半期報告書における開示対象ファンドと異なり、平成17年6月14日から平成18年6月12日までとなっております。

注記事項

（貸借対照表関係）

平成16年9月15日現在		平成17年9月15日現在	
本半期報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	23,333,255,864円	本半期報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,480,822,102円
同期中追加設定元本額	723,155,009円	同期中追加設定元本額	685,370,460円
同期中解約元本額	4,857,450,545円	同期中解約元本額	2,009,521,430円
平成16年9月15日における元本の内訳		平成17年9月15日における元本の内訳	
DL ジャパン・リサーチ・オープン	15,078,527,789円	DL ジャパン・リサーチ・オープン	12,181,451,381円
DL 日本株式オープン	3,564,787,000円	DL 日本株式オープン	3,094,737,945円
DIAM 日本株式オープン<DC 年金>	555,645,539円	DIAM 日本株式オープン<DC 年金>	880,481,806円
(合計)	19,198,960,328円	(合計)	16,156,671,132円

（有価証券関係）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等関係）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成16年9月15日現在		平成17年9月15日現在	
1口当たり純資産額	1.1259円	1口当たり純資産額	1.3972円
(1万口当たり純資産額)	(11,259円)	(1万口当たり純資産額)	(13,972円)

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

平成17年10月17日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	4,535,329,061円
負債総額	17,374,801円
純資産総額 ( - )	4,517,954,260円
発行済数量	5,363,076,169口
1口当たり純資産額 ( / )	0.8424円

(参考) マザーファンドの現況

D L ジャパン・リサーチ・オープン・マザーファンド

平成17年10月17日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	24,733,618,150円
負債総額	1,071,610,138円
純資産総額 ( - )	23,662,008,012円
発行済数量	16,100,887,029口
1口当たり純資産額 ( / )	1.4696円

## 第5 設定及び解約の実績

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

	設定口数	解約口数
第1期	222,329,781	1,555,488
第2期	2,698,831,519	678,945,576
第3期	4,427,338,946	826,456,264
第4期	2,468,585,969	801,950,962
第5期	757,295,968	1,916,131,216
第6期	402,982,617	539,861,265
第7期	339,519,980	686,650,413
第8期中間計算期間	121,921,206	584,452,985

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。