



**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）

2006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)

2006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 18 年 6 月 15 日に関東財務局長に提出しており、平成 18 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 18 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等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、**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) 2006 年 6 月 (以下「原目論見書」といいます。) 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

変更後の内容を記載しています。

(次頁以降)

投資方針

(原目論見書 8 頁)

(5) 運用状況

(1) 【投資状況】

平成18年10月5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	4,777,347,740	99.88
現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		5,605,736	0.12
合 計 (純資産総額)		4,782,953,476	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18年10月5日現在

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率(%)
株式	日本	25,020,763,500	98.05
現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		496,711,733	1.95
合 計 (純資産総額)		25,517,475,233	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】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

平成18年10月5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	2,628,816,233	18,085.42	4,754,325,604	18,173.00	4,777,347,740	99.88

(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18年10月5日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.88
合計	99.88

(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 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【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

① 投資有価証券の主要銘柄

平成18年10月5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	1,035	1,473,405.69	1,524,974,890	1,530,000.00	1,583,550,000	6.21
2	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	193,500	5,775.40	1,117,539,900	6,760.00	1,308,060,000	5.13
3	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	791	1,120,000.00	885,920,000	1,250,000.00	988,750,000	3.87
4	日本電信電話	株式	日本	情報・ 通信業	1,455	532,367.99	774,595,426	614,000.00	893,370,000	3.50
5	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	108,200	6,987.77	756,077,042	7,590.00	821,238,000	3.22
6	信越化学工業	株式	日本	化学	103,800	5,842.86	606,488,807	7,820.00	811,716,000	3.18
7	キャノン	株式	日本	電気機器	87,500	5,161.06	451,592,750	6,550.00	573,125,000	2.25
8	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	60,300	7,674.72	462,785,501	9,150.00	551,745,000	2.16
9	三菱地所	株式	日本	不動産業	196,000	2,209.48	433,057,402	2,740.00	537,040,000	2.10
10	ジェイ エフ イー ホールディングス	株式	日本	鉄鋼	113,000	4,484.05	506,697,547	4,620.00	522,060,000	2.05
11	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	121,600	3,515.00	427,424,000	4,100.00	498,560,000	1.95
12	カシオ計算機	株式	日本	電気機器	189,600	1,858.00	352,276,800	2,420.00	458,832,000	1.80
13	小松製作所	株式	日本	機械	211,000	2,040.00	430,440,000	2,095.00	442,045,000	1.73
14	村田製作所	株式	日本	電気機器	50,500	7,055.29	356,292,051	8,490.00	428,745,000	1.68
15	HOYA	株式	日本	精密機器	94,200	3,900.00	367,380,000	4,550.00	428,610,000	1.68
16	三菱電機	株式	日本	電気機器	425,000	874.00	371,450,000	1,006.00	427,550,000	1.68
17	エーザイ	株式	日本	医薬品	70,000	4,880.99	341,669,597	6,070.00	424,900,000	1.67
18	デンソー	株式	日本	輸送用機器	96,200	3,625.70	348,792,413	4,400.00	423,280,000	1.66
19	住友信託銀行	株式	日本	銀行業	325,000	1,086.77	353,200,098	1,240.00	403,000,000	1.58
20	三菱瓦斯化学	株式	日本	化学	304,000	1,228.09	373,338,135	1,240.00	376,960,000	1.48
21	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	株式	日本	情報・ 通信業	1,950	170,749.44	332,961,415	192,000.00	374,400,000	1.47
22	松下電器産業	株式	日本	電気機器	145,000	2,349.82	340,723,850	2,525.00	366,125,000	1.43
23	住友電気工業	株式	日本	非鉄金属	218,000	1,613.90	351,830,996	1,634.00	356,212,000	1.40
24	日本電産	株式	日本	電気機器	39,500	7,860.00	310,470,000	8,740.00	345,230,000	1.35
25	エルピーダメモリ	株式	日本	電気機器	61,300	4,472.51	274,164,778	5,540.00	339,602,000	1.33
26	イビデン	株式	日本	電気機器	54,000	5,468.91	295,321,352	6,240.00	336,960,000	1.32
27	コニカミノルタホールディングス	株式	日本	電気機器	199,000	1,349.44	268,538,560	1,684.00	335,116,000	1.31
28	三井海洋開発	株式	日本	機械	134,000	2,674.95	358,442,667	2,480.00	332,320,000	1.30
29	メディセオ・パルタックホールディングス	株式	日本	卸売業	140,000	1,982.84	277,597,711	2,370.00	331,800,000	1.30
30	ワイエイシイ	株式	日本	機械	107,000	2,920.00	312,440,000	2,990.00	319,930,000	1.25

(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18年10月5日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	電気機器	21.43
	銀行業	12.97
	輸送用機器	10.51
	情報・通信業	10.34
	化学	6.77
	医薬品	5.84
	機械	4.57
	卸売業	4.27
	不動産業	3.30
	小売業	2.44
	精密機器	2.40
	非鉄金属	2.08
	鉄鋼	2.05
	その他金融業	1.78
	陸運業	1.42
	証券、商品先物取引業	1.32
	電気・ガス業	0.95
	繊維製品	0.91
	ゴム製品	0.90
	サービス業	0.86
	鉱業	0.65
	食料品	0.28
合計		98.05

(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 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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】

① 【純資産の推移】

直近日（平成18年10月5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
第8期末（平成18年3月15日現在）	5,144	5,194	1.0207	1.0307
平成17年10月末	4,687	—	0.8765	—
11月末	4,955	—	0.9441	—
12月末	5,300	—	1.0238	—
平成18年1月末	5,526	—	1.0725	—
2月末	5,244	—	1.0362	—
3月末	5,359	—	1.0729	—
4月末	5,239	—	1.0639	—
5月末	4,753	—	0.9765	—
6月末	4,791	—	0.9845	—
7月末	4,726	—	0.9749	—
8月末	4,802	—	1.0028	—
9月末	4,718	—	0.9989	—
10月5日	4,782	—	1.0161	—

② 【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	-
第8期	0.0100

③ 【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	47.90
第9期中間計算期間	△ 4.19

(注) 収益率 = (当期分配付基準価額 - 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

(原目論見書 28 頁の後に追加)

- (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。第9期中間計算期間(平成18年3月16日から平成18年9月15日まで)について、あらた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8期中間計算期間末 平成17年9月15日現在	第9期中間計算期間末 平成18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		29,387	9,795
コール・ローン		14,358,188	14,128,539
親投資信託受益証券		4,323,967,856	4,636,071,671
未収入金		35,000,000	41,000,000
流動資産合計		4,373,355,431	4,691,210,005
資産合計		4,373,355,431	4,691,210,005
負 債 の 部			
流動負債			
未払解約金		7,049,388	5,182,575
未払受託者報酬		2,114,776	2,597,386
未払委託者報酬		30,452,639	37,402,190
その他未払費用		48,549	59,652
流動負債合計		39,665,352	45,241,803
負債合計		39,665,352	45,241,803
純 資 産 の 部			
元 本 等			
元本		5,402,801,817	4,751,079,230
剰余金			
中間欠損金	*3	1,069,111,738	105,111,028
(うち分配準備積立金)		(97,474,541)	(779,171,885)
剰余金合計		△ 1,069,111,738	△ 105,111,028
元本等合計		—	4,645,968,202
純 資 産 合 計		4,333,690,079	4,645,968,202
負債・純資産合計		4,373,355,431	4,691,210,005

2【中間損益及び剰余金計算書】

科目	注記 番号	第8期中間計算期間 自平成17年3月16日 至平成17年9月15日	第9期中間計算期間 自平成18年3月16日 至平成18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	4,483
有価証券売買等損益		611,453,057	△ 159,235,931
営業収益合計		611,453,058	△ 159,231,448
営業費用			
受託者報酬		2,114,776	2,597,386
委託者報酬		30,452,639	37,402,190
その他費用		48,549	59,652
営業費用合計		32,615,964	40,059,228
営業利益		578,837,094	-
営業損失金額		-	199,290,676
経常利益		578,837,094	-
経常損失金額		-	199,290,676
中間純利益		578,837,094	-
中間純損失金額		-	199,290,676
一部解約に伴う中間純利益分配額		10,707,760	-
一部解約に伴う中間純利益金額分配額		-	1,637,767
期首剰余金又は期首欠損金（△）		△ 1,777,810,077	104,342,648
剰余金増加額又は欠損金減少額		177,231,918	473,128
中間追加信託に伴う剰余金増加額		-	473,128
中間一部解約に伴う欠損金減少額		177,231,918	-
剰余金減少額又は欠損金増加額		36,662,913	8,998,361
中間一部解約に伴う剰余金減少額		-	8,998,361
中間追加信託に伴う欠損金増加額		36,662,913	-
分配金		-	-
中間欠損金		1,069,111,738	105,111,028

3【中間注記表】

前中間計算期間については「重要な会計方針」及び「注記事項」を記載しております。

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第8期中間計算期間 自平成17年3月16日 至平成17年9月15日	第9期中間計算期間 自平成18年3月16日 至平成18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

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	第8期中間計算期間末 平成17年9月15日現在	第9期中間計算期間末 平成18年9月15日現在
*1 期首元本額	5,865,333,596円	5,039,664,579円
期中追加設定元本額	121,921,206円	147,849,203円
期中解約元本額	584,452,985円	436,434,552円
*2 中間計算期間末日における受益権 の総数	-----	4,751,079,230口
*3 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 1,069,111,738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 105,111,028円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期中間計算期間末 平成17年9月15日現在	第9期中間計算期間末 平成18年9月15日現在
1口当たり純資産額	0.8021円	0.9779円
(1万口当たり純資産額)	(8,021円)	(9,779円)

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)

2006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 18 年 6 月 15 日に関東財務局長に提出しており、平成 18 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 18 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等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、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) 2006 年 6 月 (以下「原目論見書」といいます。) 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

変更後の内容を記載しています。
(次頁以降)

第4 ファンドの経理状況

(原目論見書17頁、2【ファンドの現況】の前に追加)

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、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)については、改正前の「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、第9期中間計算期間(平成18年3月16日から平成18年9月15日まで)については、改正後の「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、「投資信託財産の計算に関する規則」(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。第9期中間計算期間(平成18年3月16日から平成18年9月15日まで)の中間財務諸表について、あらた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
業務執行社員 公認会計士

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にあり、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

独立監査人の中間監査報告書

平成18年11月8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

あらた監査法人

代表社員 公認会計士
業務執行社員

石井 貴司



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18年3月16日から平成18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、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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にあり、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18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18年3月16日から平成18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8期中間計算期間末 平成17年9月15日現在	第9期中間計算期間末 平成18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		29,387	9,795
コール・ローン		14,358,188	14,128,539
親投資信託受益証券		4,323,967,856	4,636,071,671
未収入金		35,000,000	41,000,000
流動資産合計		4,373,355,431	4,691,210,005
資産合計		4,373,355,431	4,691,210,005
負 債 の 部			
流動負債			
未払解約金		7,049,388	5,182,575
未払受託者報酬		2,114,776	2,597,386
未払委託者報酬		30,452,639	37,402,190
その他未払費用		48,549	59,652
流動負債合計		39,665,352	45,241,803
負債合計		39,665,352	45,241,803
純 資 産 の 部			
元 本 等			
元本		5,402,801,817	4,751,079,230
剰余金			
中間欠損金	*3	1,069,111,738	105,111,028
(うち分配準備積立金)		(97,474,541)	(779,171,885)
剰余金合計		△ 1,069,111,738	△ 105,111,028
元本等合計		—	4,645,968,202
純 資 産 合 計		4,333,690,079	4,645,968,202
負 債 ・ 純 資 産 合 計		4,373,355,431	4,691,210,005

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

科目	注記 番号	第8期中間計算期間 自平成17年3月16日 至平成17年9月15日	第9期中間計算期間 自平成18年3月16日 至平成18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	4,483
有価証券売買等損益		611,453,057	△ 159,235,931
営業収益合計		611,453,058	△ 159,231,448
営業費用			
受託者報酬		2,114,776	2,597,386
委託者報酬		30,452,639	37,402,190
その他費用		48,549	59,652
営業費用合計		32,615,964	40,059,228
営業利益		578,837,094	-
営業損失金額		-	199,290,676
経常利益		578,837,094	-
経常損失金額		-	199,290,676
中間純利益		578,837,094	-
中間純損失金額		-	199,290,676
一部解約に伴う中間純利益分配額		10,707,760	-
一部解約に伴う中間純利益金額分配額		-	1,637,767
期首剰余金又は期首欠損金 (△)		△ 1,777,810,077	104,342,648
剰余金増加額又は欠損金減少額		177,231,918	473,128
中間追加信託に伴う剰余金増加額		-	473,128
中間一部解約に伴う欠損金減少額		177,231,918	-
剰余金減少額又は欠損金増加額		36,662,913	8,998,361
中間一部解約に伴う剰余金減少額		-	8,998,361
中間追加信託に伴う欠損金増加額		36,662,913	-
分配金		-	-
中間欠損金		1,069,111,738	105,111,028

(3) 【中間注記表】

前中間計算期間については「重要な会計方針」及び「注記事項」を記載しております。

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第8期中間計算期間 自平成17年3月16日 至平成17年9月15日	第9期中間計算期間 自平成18年3月16日 至平成18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

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	第8期中間計算期間末 平成17年9月15日現在	第9期中間計算期間末 平成18年9月15日現在
*1 期首元本額	5,865,333,596円	5,039,664,579円
期中追加設定元本額	121,921,206円	147,849,203円
期中解約元本額	584,452,985円	436,434,552円
*2 中間計算期間末日における受益権 の総数	-----	4,751,079,230口
*3 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 1,069,111,738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 105,111,028円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期中間計算期間末 平成17年9月15日現在	第9期中間計算期間末 平成18年9月15日現在
1口当たり純資産額	0.8021円	0.9779円
(1万口当たり純資産額)	(8,021円)	(9,779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17年9月15日現在	平成18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		314,426	13,252
コール・ローン		207,636,975	364,008,858
株式		22,288,277,300	24,703,947,000
未収入金		372,110,606	460,316,339
未収配当金		4,886,523	8,261,100
流 動 資 産 合 計		22,873,225,830	25,536,546,549
資 産 合 計		22,873,225,830	25,536,546,549
負 債 の 部			
流 動 負 債			
未払金		223,985,220	386,176,779
未払解約金		75,000,000	50,000,000
流 動 負 債 合 計		298,985,220	436,176,779
負 債 合 計		298,985,220	436,176,779
純 資 産 の 部			
元 本 等			
元本		16,156,671,132	14,364,571,349
剰余金			
剰余金		6,417,569,478	10,735,798,421
剰余金合計		6,417,569,478	10,735,798,421
元本等合計		—	25,100,369,770
純 資 産 合 計		22,574,240,610	25,100,369,770
負 債 ・ 純 資 産 合 計		22,873,225,830	25,536,546,549

注記表

平成17年3月16日から平成17年9月15日までのについては「重要な会計方針」及び「注記事項」を記載しております。

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成17年3月16日 至平成17年9月15日	自平成18年3月16日 至平成18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）、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。	株式 同左
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。	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18年6月13日から平成19年6月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成17年9月15日現在	平成18年9月15日現在
*1 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	14,819,318,302円
同期中追加設定元本額	685,370,460円	1,220,632,557円
同期中解約元本額	2,009,521,430円	1,675,379,510円
同期末における元本の内訳		
D L ジャパン・リサーチ・オープン	12,181,451,381円	9,968,640,977円
D L 日本株式オープン	3,094,737,945円	2,653,125,599円
D I A M 日本株式オープン <D C 年金>	880,481,806円	1,742,804,773円
(合 計)	16,156,671,132円	14,364,571,349円
*2 本半期報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における 受益権総数	—————	14,364,571,349口

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成17年9月15日現在	平成18年9月15日現在
1口当たり純資産額	1.3972円	1.7474円
(1万口当たり純資産額)	(13,972円)	(17,474円)

(原目論見書 17 頁)

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成18年10月5日現在

項 目	金額又は口数
I 資産総額	4,803,068,186円
II 負債総額	20,114,710円
III 純資産総額 (I - II)	4,782,953,476円
IV 発行済数量	4,707,290,956口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.0161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18年10月5日現在

項 目	金額又は口数
I 資産総額	25,636,347,216円
II 負債総額	118,871,983円
III 純資産総額 (I - II)	25,517,475,233円
IV 発行済数量	14,041,129,009口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.8173円

第5 設定及び解約の実績

(原目論見書 17 頁)

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	322,808,215	1,148,477,232
第9期中間計算期間	147,849,203	436,434,552

(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。