

りそな M M F (マネー・マネージメント・ファンド)

目論見書の訂正部分

「りそな MMF (マネー・マネージメント・ファンド)」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 16 年 7 月 16 日に関東財務局長に提出しており、平成 16 年 8 月 1 日にその届出の効力が生じております。また、同法第 7 条に基づき有価証券届出書の訂正届出書を平成 16 年 8 月 2 日、平成 16 年 8 月 26 日および平成 17 年 2 月 25 日に関東財務局長に提出しております。

- 当ファンドは、公社債等の値動きのある有価証券等 (外貨建証券には為替リスクもあります。) に投資しますので、当ファンドの基準価額が下落し、損失を被ることがあります。
- 当ファンドは、投資家の皆様の投資元本および収益が保証されているものではありません。
- 運用により信託財産に生じた損益は、全て投資家の皆様に帰属します。
- 当ファンドは、預金保険機構あるいは保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。

平成 17 年 2 月 25 日に有価証券届出書の訂正届出書を提出したことに伴い、目論見書の記載内容のうち、一部について新しい内容に改めます。

【訂正箇所及び訂正後の内容】

第二部 ファンド情報

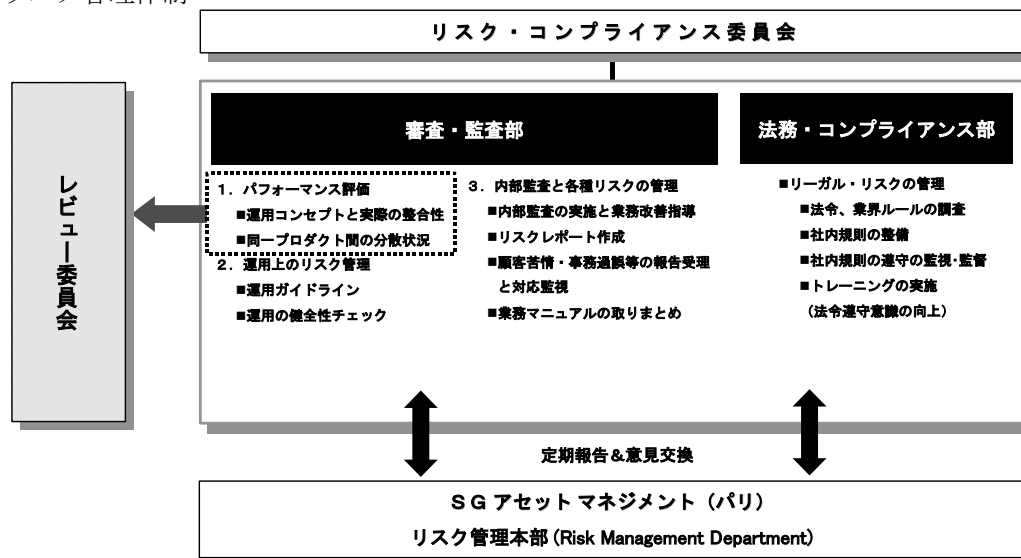
第 1 ファンドの状況

3 投資リスク

(2) リスク管理体制 (以下の内容に訂正します。) …………… (目論見書 P16)

ファンドのリスク管理として、運用の基本方針に沿った資産構成になっているか、あるいは適切な投資行動となっているかを検証しています。また、レビュー委員会において、ファンド特性を踏まえたパフォーマンス評価・検討を行なっています。

委託会社のリスク管理体制



*委託会社のリスク管理体制は、平成 16 年 12 月現在のものであり、今後変更となる場合があります。

5 運用状況（以下の内容に改訂します）……………（目論見書 P19～21）

(1) 投資状況

平成 16 年 12 月 30 日現在

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|----|----------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 11,999,969,086 | 44.05 |
| 社債券 | 日本 | 200,304,790 | 0.74 |
| コマーシャル・ペーパー | 日本 | 5,099,477,652 | 18.72 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | － | 9,938,889,213 | 36.49 |
| 合計（純資産総額） | － | 27,238,640,741 | 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) 運用実績

① 純資産の推移

平成 16 年 12 月 30 日（直近日）現在、同日前 1 年以内における各月末、および下記各特定期間末におけるファンドの純資産総額、および基準価額（1 万口当りの純資産額）の推移は次の通りです。

| | 純資産総額（百万円） | | 基準価額（円） | |
|------------------------|------------|---------|---------|--------|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第6期特定期間末(平成7年5月30日) | 149,212 | 149,218 | 10,000 | 10,000 |
| 第7期特定期間末(平成7年11月29日) | 173,097 | 173,100 | 10,000 | 10,000 |
| 第8期特定期間末(平成8年5月30日) | 148,257 | 148,259 | 10,000 | 10,000 |
| 第9期特定期間末(平成8年11月28日) | 196,169 | 196,172 | 10,000 | 10,000 |
| 第10期特定期間末(平成9年5月29日) | 154,438 | 154,441 | 10,000 | 10,000 |
| 第11期特定期間末(平成9年11月27日) | 118,704 | 118,706 | 10,000 | 10,000 |
| 第12期特定期間末(平成10年5月28日) | 106,325 | 106,326 | 10,000 | 10,000 |
| 第13期特定期間末(平成10年11月29日) | 69,303 | 69,304 | 10,000 | 10,000 |
| 第14期特定期間末(平成11年5月30日) | 103,914 | 103,915 | 10,000 | 10,000 |
| 第15期特定期間末(平成11年11月29日) | 188,465 | 183,466 | 10,000 | 10,000 |
| 第16期特定期間末(平成12年5月30日) | 282,517 | 282,518 | 10,000 | 10,000 |
| 第17期特定期間末(平成12年11月29日) | 240,750 | 240,751 | 10,000 | 10,000 |
| 第18期特定期間末(平成13年5月30日) | 254,925 | 254,926 | 10,000 | 10,000 |
| 第19期特定期間末(平成13年11月30日) | 210,263 | 210,264 | 10,000 | 10,000 |
| 第20期特定期間末(平成14年5月31日) | 72,542 | 72,542 | 10,000 | 10,000 |
| 第21期特定期間末(平成14年11月30日) | 60,263 | 60,263 | 10,000 | 10,000 |
| 第22期特定期間末(平成15年5月31日) | 47,062 | 47,062 | 10,000 | 10,000 |
| 第23期特定期間末(平成15年11月30日) | 38,453 | 38,453 | 10,000 | 10,000 |
| 第24期特定期間末(平成16年5月31日) | 31,627 | 31,627 | 10,000 | 10,000 |
| 第25期特定期間末(平成16年11月30日) | 28,509 | 28,509 | 10,000 | 10,000 |
| 平成 15 年 12 月末日 | 36,915 | 36,915 | 10,000 | 10,000 |
| 平成 16 年 1 月末日 | 34,912 | 34,912 | 10,000 | 10,000 |
| 2 月末日 | 33,835 | 33,835 | 10,000 | 10,000 |
| 3 月末日 | 33,223 | 33,223 | 10,000 | 10,000 |
| 4 月末日 | 32,483 | 32,483 | 10,000 | 10,000 |
| 5 月末日 | 31,627 | 31,627 | 10,000 | 10,000 |
| 6 月末日 | 30,523 | 30,523 | 10,000 | 10,000 |
| 7 月末日 | 30,537 | 30,537 | 10,000 | 10,000 |
| 8 月末日 | 30,151 | 30,151 | 10,000 | 10,000 |
| 9 月末日 | 29,444 | 29,444 | 10,000 | 10,000 |
| 10 月末日 | 29,661 | 29,661 | 10,000 | 10,000 |
| 11 月末日 | 28,509 | 28,509 | 10,000 | 10,000 |
| 12 月 30 日 | 27,238 | 27,238 | 10,000 | 10,000 |

② 分配の推移

| 計算期間 | 1万口当り分配金（円） |
|-------------------------------|-------------|
| 第6期特定期間(H6. 11. 30～H7. 5. 30) | 101.67 |
| 第7期特定期間(H7. 5. 31～H7. 11. 29) | 47.31 |
| 第8期特定期間(H7. 11. 30～H8. 5. 30) | 31.58 |
| 第9期特定期間(H8. 5. 31～H8. 11. 28) | 31.39 |

| | |
|-----------------------------------|--------|
| 第10期特定期間 (H8. 11. 29～H9. 5. 29) | 30. 17 |
| 第11期特定期間 (H9. 5. 30～H9. 11. 27) | 33. 02 |
| 第12期特定期間 (H9. 11. 28～H10. 5. 28) | 36. 25 |
| 第13期特定期間 (H10. 5. 29～H10. 11. 29) | 26. 65 |
| 第14期特定期間 (H10. 11. 30～H11. 5. 30) | 19. 29 |
| 第15期特定期間 (H11. 5. 31～H11. 11. 29) | 11. 71 |
| 第16期特定期間 (H11. 11. 30～H12. 5. 30) | 10. 42 |
| 第17期特定期間 (H12. 5. 31～H12. 11. 29) | 10. 91 |
| 第18期特定期間 (H12. 11. 30～H13. 5. 30) | 11. 93 |
| 第19期特定期間 (H13. 5. 31～H13. 11. 30) | 6. 04 |
| 第20期特定期間 (H13. 12. 1～H14. 5. 31) | 6. 16 |
| 第21期特定期間 (H14. 6. 1～H14. 11. 30) | 1. 56 |
| 第22期特定期間 (H14. 12. 1～H15. 5. 31) | 1. 22 |
| 第23期特定期間 (H15. 6. 1～H15. 11. 30) | 0. 46 |
| 第24期特定期間 (H15. 12. 1～H16. 5. 31) | 0. 37 |
| 第25期特定期間 (H16. 6. 1～H16. 11. 30) | 0. 36 |

③収益率の推移

| 計算期間 | 収益率 (%) |
|-----------------------------------|---------|
| 第6期特定期間 (H6. 11. 30～H7. 5. 30) | 1. 02 |
| 第7期特定期間 (H7. 5. 31～H7. 11. 29) | 0. 47 |
| 第8期特定期間 (H7. 11. 30～H8. 5. 30) | 0. 32 |
| 第9期特定期間 (H8. 5. 31～H8. 11. 28) | 0. 31 |
| 第10期特定期間 (H8. 11. 29～H9. 5. 29) | 0. 30 |
| 第11期特定期間 (H9. 5. 30～H9. 11. 27) | 0. 33 |
| 第12期特定期間 (H9. 11. 28～H10. 5. 28) | 0. 36 |
| 第13期特定期間 (H10. 5. 29～H10. 11. 29) | 0. 27 |
| 第14期特定期間 (H10. 11. 30～H11. 5. 30) | 0. 19 |
| 第15期特定期間 (H11. 5. 31～H11. 11. 29) | 0. 12 |
| 第16期特定期間 (H11. 11. 30～H12. 5. 30) | 0. 10 |
| 第17期特定期間 (H12. 5. 31～H12. 11. 29) | 0. 11 |
| 第18期特定期間 (H12. 11. 30～H13. 5. 30) | 0. 12 |
| 第19期特定期間 (H13. 5. 31～H13. 11. 30) | 0. 06 |
| 第20期特定期間 (H13. 12. 1～H14. 5. 31) | 0. 06 |
| 第21期特定期間 (H14. 6. 1～H14. 11. 30) | 0. 02 |
| 第22期特定期間 (H14. 12. 1～H15. 5. 31) | 0. 01 |
| 第23期特定期間 (H15. 6. 1～H15. 11. 30) | 0. 00 |
| 第24期特定期間 (H15. 12. 1～H16. 5. 31) | 0. 00 |
| 第25期特定期間 (H16. 6. 1～H16. 11. 30) | 0. 00 |

(注) 収益率の算出方法：特定期間末の基準価額（当該特定期間における1万口当り分配金の合計額を含む。）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を、前期末基準価額で除して100を乗じた数値です。

(3) 設定及び解約の実績

| 計算期間 | 設定数量 (口) | 解約数量 (口) |
|-----------------------------------|--------------------|--------------------|
| 第6期特定期間 (H6. 11. 30～H7. 5. 30) | 161, 617, 426, 255 | 130, 076, 199, 997 |
| 第7期特定期間 (H7. 5. 31～H7. 11. 29) | 201, 941, 957, 397 | 178, 057, 397, 358 |
| 第8期特定期間 (H7. 11. 30～H8. 5. 30) | 186, 515, 660, 774 | 211, 355, 782, 790 |
| 第9期特定期間 (H8. 5. 31～H8. 11. 28) | 212, 500, 154, 701 | 164, 587, 128, 363 |
| 第10期特定期間 (H8. 11. 29～H9. 5. 29) | 167, 946, 900, 310 | 209, 678, 372, 052 |
| 第11期特定期間 (H9. 5. 30～H9. 11. 27) | 119, 344, 077, 775 | 155, 077, 865, 794 |
| 第12期特定期間 (H9. 11. 28～H10. 5. 28) | 92, 924, 996, 733 | 105, 303, 652, 257 |
| 第13期特定期間 (H10. 5. 29～H10. 11. 29) | 66, 369, 119, 189 | 103, 391, 457, 389 |
| 第14期特定期間 (H10. 11. 30～H11. 5. 30) | 117, 737, 965, 534 | 83, 127, 299, 753 |
| 第15期特定期間 (H11. 5. 31～H11. 11. 29) | 193, 823, 235, 305 | 109, 272, 350, 266 |
| 第16期特定期間 (H11. 11. 30～H12. 5. 30) | 271, 216, 605, 420 | 177, 164, 724, 447 |
| 第17期特定期間 (H12. 5. 31～H12. 11. 29) | 251, 491, 027, 041 | 293, 257, 700, 783 |
| 第18期特定期間 (H12. 11. 30～H13. 5. 30) | 203, 502, 585, 035 | 189, 327, 543, 235 |
| 第19期特定期間 (H13. 5. 31～H13. 11. 30) | 97, 975, 254, 706 | 142, 636, 889, 385 |
| 第20期特定期間 (H13. 12. 1～H14. 5. 31) | 21, 149, 360, 233 | 158, 870, 796, 812 |
| 第21期特定期間 (H14. 6. 1～H14. 11. 30) | 10, 183, 914, 373 | 22, 462, 627, 057 |

| | | |
|----------------------------------|---------------|----------------|
| 第22期特定期間 (H14. 12. 1～H15. 5. 31) | 8,755,093,761 | 21,955,871,373 |
| 第23期特定期間 (H15. 6. 1～H15. 11. 30) | 3,895,017,111 | 12,504,689,718 |
| 第24期特定期間 (H15. 12. 1～H16. 5. 31) | 3,567,942,953 | 10,393,758,580 |
| 第25期特定期間 (H16. 6. 1～H16. 11. 30) | 4,533,172,494 | 7,651,308,469 |

第2 ファンドの経理状況（以下の内容に改訂します）……………（目論見書 P27～36）

(1) 当ファンドの財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）ならびに同規則第 2 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）（以下「投資信託財産計算規則」という）に基づいて作成しております。

なお、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) 当ファンドの計算期間は 6 ヶ月未満であるため、財務諸表は 6 ヶ月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは証券取引法第 193 条の 2 の規定に基づき、前期（平成 15 年 12 月 1 日から平成 16 年 5 月 31 日まで）及び当期（平成 16 年 6 月 1 日から平成 16 年 11 月 30 日まで）の財務諸表については、新日本監査法人による監査を受けております。




なお、当ファンドの委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社は平成 16 年 8 月 1 日をもってエスジー山一アセットマネジメント株式会社を存続会社として合併し、商号をソシエテジェネラルアセットマネジメント株式会社に変更しております。

独立監査人の監査報告書

平成16年7月29日

りそな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 長井 孝雄 
関与社員
代表社員 公認会計士 水守 理智 
関与社員
関与社員 公認会計士 上林 敏子 

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」に掲げられているりそなMMF（マネー・マネージメント・ファンド）（以下「ファンド」という。）の平成15年12月1日から平成16年5月31日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、及び附属明細表について監査を行った。この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、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は当監査法人に財務諸表に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。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積もりの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として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企業会計の基準に準拠して、ファンドの平成16年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

りそな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


独立監査人の監査報告書

平成17年 | 月 28 日

ソシエテジェネラル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 水守理智 
業務執行社員

業務執行社員 公認会計士 上林敏子 

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」に掲げられているりそなMMF（マネー・マネージメント・ファンド）の平成16年6月1日から平成16年11月30日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、及び附属明細表について監査を行った。この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、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として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企業会計の基準に準拠して、りそなMMF（マネー・マネージメント・ファンド）の平成16年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

ソシエテジェネラル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

1 財務諸表

りそなMMF（マネー・マネージメント・ファンド）

(1) 貸借対照表

| 科目 | 前期末 | 当期末 |
|-------------|----------------|-----------------|
| | (平成16年5月31日現在) | (平成16年11月30日現在) |
| | 金額(円) | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| I 流動資産 | | |
| コール・ローン | 1,130,641,494 | 2,409,693,712 |
| 国債証券 | 16,999,782,977 | 16,999,930,476 |
| コマーシャル・ペーパー | 4,499,723,571 | 4,099,552,606 |
| 現先取引勘定 | 8,997,097,899 | 4,999,919,469 |
| 未収利息 | 39,469 | 31,351 |
| 流動資産合計 | 31,627,285,410 | 28,509,127,614 |
| 資産合計 | 31,627,285,410 | 28,509,127,614 |
| 負債の部 | | |
| I 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | 605 | - |
| 未払委託者報酬 | 3,715 | - |
| その他未払費用 | 453 | 410 |
| 流動負債合計 | 4,773 | 410 |
| 負債合計 | 4,773 | 410 |
| 純資産の部 | | |
| I 元本 | | |
| 元本 | 31,627,249,184 | 28,509,113,209 |
| II 剰余金 | | |
| 期末剰余金 | 31,453 | 13,995 |
| 純資産合計 | 31,627,280,637 | 28,509,127,204 |
| 負債・純資産合計 | 31,627,285,410 | 28,509,127,614 |

(2) 損益及び剰余金計算書

| 科目 | 前期 | 当期 |
|---------------------|----------------------------|----------------------------|
| | 自平成15年12月1日 至平成16年5月31日 | 自平成16年6月1日 至平成16年11月30日 |
| | 金額(円) | 金額(円) |
| 経常損益の部 | | |
| 営業損益の部 | | |
| I 営業収益 | | |
| 受取利息 | 1,353,257 | 1,154,116 |
| 有価証券売買等損益 | 742,344 | 687,499 |
| その他収益 | 152,474 | 51,458 |
| 営業収益合計 | 2,248,075 | 1,893,073 |
| II 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 121,223 | 104,615 |
| 委託者報酬 | 744,608 | 642,521 |
| その他費用 | 90,826 | 79,190 |
| 営業費用合計 | 956,657 | 826,326 |
| 営業利益 | 1,291,418 | 1,066,747 |
| 経常利益 | 1,291,418 | 1,066,747 |
| 当期純利益 | 1,291,418 | 1,066,747 |
| III 一部解約に伴う当期純利益分配額 | - | - |
| IV 期首剰余金 | 22,388 | 31,453 |
| V 剰余金増加額 | - | - |
| VI 剰余金減少額 | - | - |
| VII 分配金 | 1,282,353 | 1,084,205 |
| VIII 期末剰余金 | 31,453 | 13,995 |

重要な会計方針

| 項目 | 前期 | 当期 |
|--------------------|---|--|
| | 自 平成 15 年 12 月 1 日 至 平成 16 年 5 月 31 日 | 自 平成 16 年 6 月 1 日 至 平成 16 年 11 月 30 日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券、コマーシャル・ペーパーは個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 証券取引所に上場されている有価証券等 証券取引所に上場されている有価証券等は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場又は清算値段で評価しております。 特定期間末日に当該証券取引所の最終相場等がない場合には、当該証券取引所における直近の日の最終相場等で評価しておりますが、直近の日の最終相場等によることが適当でないと認められた場合は、当該証券取引所における特定期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券等 当該有価証券等については、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券等 適正な評価額を入手できなかった場合、又は入手した評価額が時価として認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額で、もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(4) 残存期間 1 年以内の公社債等 買付けにかかる約定日から 1 年以内で償還を迎える公社債等（償還日の前年応答日が到来したものを含む）で、価額変動性が限定的であり、償却原価法による評価方法が合理的かつ受益者の利益を害しないと投資信託委託業者が判断した場合は、当該方法により評価しております。ただし、時価と評価額に乖離が生じ、投資信託委託業者が適正な基準価額の計算上必要と判断した場合には、速やかに時価による評価換えを行うものとします。</p> | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券、コマーシャル・ペーパーは個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 証券取引所に上場されている有価証券等 同 左</p> <p>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券等 同 左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券等 同 左</p> <p>(4) 残存期間 1 年以内の公社債等 同 左</p> |
| 2. 収益及び費用の計上基準 | 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。 | 有価証券売買等損益の計上基準 同 左 |

注記事項

(貸借対照表関係)

| 前期末 (平成 16 年 5 月 31 日現在) | | 当期末 (平成 16 年 11 月 30 日現在) | |
|--------------------------------------|------------------|--------------------------------------|------------------|
| 1. 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額 | | 1. 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額 | |
| 期首元本額 | 38,453,064,811 円 | 期首元本額 | 31,627,249,184 円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,567,942,953 円 | 期中追加設定元本額 | 4,533,172,494 円 |
| 期中一部解約元本額 | 10,393,758,580 円 | 期中一部解約元本額 | 7,651,308,469 円 |

(損益及び剰余金計算書関係)

| 前期 自 平成 15 年 12 月 1 日 至 平成 16 年 5 月 31 日 | | | 当期 自 平成 16 年 6 月 1 日 至 平成 16 年 11 月 30 日 | | |
|--|------------------|-------------|--|------------------|-------------|
| 1. 受託会社との取引高 営業取引 (受託者報酬) 121,223 円 | | | 1. 受託会社との取引高 営業取引 (受託者報酬) 104,615 円 | | |
| 2. 分配金の計算過程 特定期間における分配対象金額 1,313,806 円のうち、 1,282,353 円(一万口当たり 0.37 円)を分配金額としてお ります。 | | | 2. 分配金の計算過程 特定期間における分配対象金額 1,098,200 円のうち、 1,084,205 円(一万口当たり 0.36 円)を分配金額としてお ります。 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 配当等収益額 | A | 1,353,257 円 | 配当等収益額 | A | 1,154,116 円 |
| 有価証券売買等損益 | B | 742,344 円 | 有価証券売買等損益 | B | 687,499 円 |
| その他収益 | C | 152,474 円 | その他収益 | C | 51,458 円 |
| 期首剰余金 | D | 22,388 円 | 期首剰余金 | D | 31,453 円 |
| 控除費用 | E | 956,657 円 | 控除費用 | E | 826,326 円 |
| 当ファンドの分配対象収 益額 | F = A+B+C+D-E | 1,313,806 円 | 当ファンドの分配対象 収益額 | F = A+B+C+D-E | 1,098,200 円 |
| 一万口当たりの分配額 | G | 0.37 円 | 一万口当たりの分配額 | G | 0.36 円 |
| 収益分配金金額 | H | 1,282,353 円 | 収益分配金金額 | H | 1,084,205 円 |

(有価証券関係)

前期 (自 平成 15 年 12 月 1 日 至 平成 16 年 5 月 31 日)

売買目的有価証券

(単位: 円)

| 種 類 | 貸借対照表計上額 | 当特定期間の損益に 含まれた評価差額 |
|-------------|----------------|-----------------------|
| 国債証券 | 16,999,782,977 | 246,977 |
| コマーシャル・ペーパー | 4,499,723,571 | 37,929 |
| 合 計 | 21,499,506,548 | 284,906 |

当期 (自 平成 16 年 6 月 1 日 至 平成 16 年 11 月 30 日)

売買目的有価証券

(単位: 円)

| 種 類 | 貸借対照表計上額 | 当特定期間の損益に 含まれた評価差額 |
|-------------|----------------|-----------------------|
| 国債証券 | 16,999,930,476 | 140,476 |
| コマーシャル・ペーパー | 4,099,552,606 | 30,779 |
| 合 計 | 21,099,483,082 | 171,255 |

(デリバティブ取引関係)

前期 (自 平成 15 年 12 月 1 日 至 平成 16 年 5 月 31 日)

該当事項はありません。

当期 (自 平成 16 年 6 月 1 日 至 平成 16 年 11 月 30 日)

該当事項はありません。

(一口当たり情報)

| | 前期 (平成 16 年 5 月 31 日現在) | 当期 (平成 16 年 11 月 30 日現在) |
|-----------|----------------------------|-----------------------------|
| 一口当たり純資産額 | 1 円 | 1 円 |

(重要な後発事象)

前期 (自 平成 15 年 12 月 1 日 至 平成 16 年 5 月 31 日)

該当事項はありません。

当期（自平成16年6月1日 至平成16年11月30日）

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

① 有価証券明細表

1) 株式

該当事項はありません。

2) 株式以外の有価証券

(平成16年12月30日現在)

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 |
|-------------|--------------|----------------|----------------|
| 国債証券 | 第299回政府短期証券 | 3,000,000,000 | 2,999,995,980 |
| | 第301回政府短期証券 | 2,000,000,000 | 1,999,990,040 |
| | 第305回政府短期証券 | 2,000,000,000 | 1,999,989,506 |
| | 第306回政府短期証券 | 3,000,000,000 | 2,999,982,222 |
| | 第307回政府短期証券 | 3,000,000,000 | 2,999,990,040 |
| | 第310回政府短期証券 | 4,000,000,000 | 3,999,982,688 |
| | 小計 | 17,000,000,000 | 16,999,930,476 |
| コマーシャル・ペーパー | ダイヤモンドリース | 1,400,000,000 | 1,399,943,542 |
| | エイチジーエム・アセット | 900,000,000 | 899,802,093 |
| | エイチジーエム・アセット | 100,000,000 | 99,977,522 |
| | エイチジーエム・アセット | 300,000,000 | 299,864,736 |
| | スミショウリース | 1,400,000,000 | 1,399,964,713 |
| | 小計 | 4,100,000,000 | 4,099,552,606 |
| | 合計 | | 21,099,483,082 |

② 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2 ファンドの現況

(1) 純資産額計算書

平成16年12月30日現在

| | |
|-------------------------|------------------|
| I 資産総額 | 27,238,642,624 円 |
| II 負債総額 | 1,883 円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 27,238,640,741 円 |
| IV 発行済口数 | 27,238,617,319 口 |
| V 1万口当たり純資産額 (III / IV) | 1.0000 円 |

(2) 投資有価証券の主要銘柄

平成16年12月30日現在

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 額面 (円) | 帳簿価額 | | 時価評価額 | | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----|------|-------------|---------------------------|---------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-----------|-----------|-----------------|
| | | | | | 単価 (円) | 金額 (円) | 単価 (円) | 金額 (円) | | | |
| 1 | 日本 | 国債証券 | 第310回政府短期証券 | 4,000,000,000 | 99.99 | 3,999,988,448 | 99.99 | 3,999,988,448 | 0 | 2005/2/28 | 14.69 |
| 2 | 日本 | 国債証券 | 第307回政府短期証券 | 3,000,000,000 | 99.99 | 2,999,994,360 | 99.99 | 2,999,994,360 | 0 | 2005/2/7 | 11.01 |
| 3 | 日本 | 国債証券 | 第306回政府短期証券 | 3,000,000,000 | 99.99 | 2,999,990,952 | 99.99 | 2,999,990,952 | 0 | 2005/1/31 | 11.01 |
| 4 | 日本 | 国債証券 | 第305回政府短期証券 | 2,000,000,000 | 99.99 | 1,999,995,326 | 99.99 | 1,999,995,326 | 0 | 2005/1/24 | 7.34 |
| 5 | 日本 | 社債券 | 第5回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ | 200,000,000 | 100.15 | 200,304,790 | 100.15 | 200,304,790 | 0.4 | 2005/6/17 | 0.74 |
| 6 | 日本 | コマーシャル・ペーパー | スミショウリース | 1,400,000,000 | - | 1,399,964,713 | - | 1,399,964,713 | - | - | 5.14 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|----|-------------|----------------------|---------------|---|---------------|---|---------------|---|---|------|
| 7 | 日本 | コマーシャル・ペーパー | ダイヤモンド リース | 1,400,000,000 | - | 1,399,943,542 | - | 1,399,943,542 | - | - | 5.14 |
| 8 | 日本 | コマーシャル・ペーパー | ニホン シヨウケン キンユウ | 1,000,000,000 | - | 999,925,046 | - | 999,925,046 | - | - | 3.67 |
| 9 | 日本 | コマーシャル・ペーパー | エイチジー エム・ アセット | 900,000,000 | - | 899,802,093 | - | 899,802,093 | - | - | 3.30 |
| 10 | 日本 | コマーシャル・ペーパー | エイチジー エム・ アセット | 300,000,000 | - | 299,864,736 | - | 299,864,736 | - | - | 1.10 |
| 11 | 日本 | コマーシャル・ペーパー | エイチジー エム・ アセット | 100,000,000 | - | 99,977,522 | - | 99,977,522 | - | - | 0.37 |

*全11銘柄

*投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価評価額比率です。

*単価は額面100円当りの価格です。

種類別投資比率

平成16年12月30日現在

| 地域 | 種類 | 投資比率 (%) |
|----|-------------|----------|
| 日本 | 国債証券 | 44.05 |
| | 社債券 | 0.74 |
| | コマーシャル・ペーパー | 18.72 |
| 合計 | | 63.51 |

*投資比率はファンドの純資産総額に対する評価額比率です。

(3) 投資不動産物件

該当事項はありません。

(4) その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。