

りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ

追加型株式投資信託／バランス型

投資信託説明書（目論見書）

平成19年11月7日

※本文書は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。



大和投資信託

Daiwa Asset Management

りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ

追加型株式投資信託／バランス型

投資信託説明書(交付目論見書)

平成19年11月7日

※本文書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。



大和投資信託

Daiwa Asset Management

投資信託説明書（交付目論見書）

当ファンドは、株式、公社債、不動産投資信託証券など値動きのある証券(外国証券には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

委託会社の情報提供窓口

◆ お電話によるお問合わせ先

電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）

◆ 委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

本文書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。本文書により行なう「りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ」の受益証券の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を平成19年11月6日に関東財務局長に提出しており、平成19年11月7日にその届出の効力が生じております。

当該有価証券届出書第三部の内容を記載した「投資信託説明書(請求目論見書)」は、投資者の請求により交付されます(請求を行なった場合には、その旨をご自身で記録しておくようにして下さい)。なお、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードすることもできます。

下記の内容は、この投資信託(「リそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ」を構成する「リそな・東京応援・資産分散ファンド」「リそな・埼玉応援・資産分散ファンド」「リそな・多摩応援・資産分散ファンド」「リそな・神奈川応援・資産分散ファンド」「リそな・中部応援・資産分散ファンド」「リそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド」「リそな・大阪応援・資産分散ファンド」「リそな・ひょうご応援・資産分散ファンド」(以下総称して「当ファンド」といいます。))をお申込みされる際にあらかじめ、投資家のみなさまに、ご確認いただきたい事項としてお知らせするものです。

各ファンドにかかる、下記の内容および目論見書の内容を十分にお読み下さい。

記

■各ファンドにかかるリスク記載について

当ファンドは、主にわが国の株式、海外の公社債および不動産投資信託証券(リート)を実質的な投資対象としますので、株価、公社債の価格、リートの価格の下落、組入株式、公社債の発行企業・発行体の経営不安、倒産、財政難等の影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、為替レートの変動の影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。

したがって、投資家のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割込むことがあります。

当ファンドの基準価額の変動要因としては、主に「株価、公社債の価格、リートの価格の変動リスク」、「信用リスク」、「為替リスク」などが考えられます。これらのリスクを含むより詳細な内容については、本目論見書の「投資リスク」に記載しておりますのでご確認下さい。

■各ファンドにかかる手数料等について

◆申込手数料

各ファンドの申込手数料の料率の上限は、2.1%（税抜2.0%）です。

※ くわしくは販売会社もしくは申込手数料を記載した書面にてご確認ください。

◆換金（解約）手数料

換金（解約）手数料はありません。

◆信託報酬

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年 1.3125%（税抜 1.25%）の率を乗じて得た額とし、ファンドよりご負担いただきます。

◆その他の費用^(*)

監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料、資産を外国で保管する場合の費用等をファンドでご負担いただきます。

(*) 「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

※当該手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

※くわしくは本目論見書の「手数料等及び税金」に記載しておりますのでご確認ください。

目論見書の概要

りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ

りそな・東京応援・資産分散ファンド（愛称：大江戸ブンさん）

りそな・埼玉応援・資産分散ファンド（愛称：埼玉ブンさん）

りそな・多摩応援・資産分散ファンド（愛称：多摩ブンさん）

りそな・神奈川応援・資産分散ファンド（愛称：はまのブンさん）

りそな・中部応援・資産分散ファンド（愛称：りそちゅーブンさん）

りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド（愛称：京・近江ブンさん）

りそな・大阪応援・資産分散ファンド（愛称：上方ブンさん）

りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド（愛称：ひょうご元気ブンさん）

本概要は、後掲の「有価証券届出書の内容」(交付目論見書本文)を要約したものです。詳細は、交付目論見書本文の該当箇所をご覧ください。

ファンドの概要

目的および基本的性格	追加型株式投資信託／バランス型 安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得により、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	①(※)応援マザーファンドの受益証券 ②ハイグレード・ソブリン・マザーファンドの受益証券 ③世界REITマザーファンドの受益証券
マザーファンドの主要投資対象	①わが国の金融商品取引所上場株式 ②海外の公社債等 ③海外の金融商品取引所上場および店頭登録(上場予定および登録予定を含みます。)の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券(以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。)
投資態度	①主として、各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得により、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。 ②各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。 <ul style="list-style-type: none">・(※)応援マザーファンドの受益証券 ……………信託財産の純資産総額の3分の1・ハイグレード・ソブリン・マザーファンドの受益証券 ……………信託財産の純資産総額の3分の1・世界REITマザーファンドの受益証券 ……………信託財産の純資産総額の3分の1

投資態度 (つづき)	③保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。 ④当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	①株式への直接投資は、行ないません。 ②外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
価額変動リスク	当ファンドは、株式、公社債、不動産投資信託証券など値動きのある証券(外国証券には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。
お買付単位	各ファンドについて、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位 (注) くわしくは、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。
お買付価額 (1万口当り)	各ファンドについて、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額
お買付時の 申込手数料	販売会社が別に定めるものとしします。なお、販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.1%(税抜 2.0%)です。 (注1) くわしくは、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。 (注2) お申込手数料には、消費税等が課されます。 (注3) 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、お申込手数料はかかりません。
お申込みの 受付中止日・ 受付時間	①ニューヨーク証券取引所、ロンドン国際金融先物取引所(LIFFE)またはオーストラリア証券取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を申込受付日とするお買付けおよびご換金の申込みの受け付けは行ないません。 ②委託会社の各営業日*の午後3時(年末年始など半休日においては午前11時)までに受付けたお買付けおよびご換金の申込み(当該お申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを)、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれるお申込みは、翌営業日*の取扱いとなります。 ※前①のお申込受付中止日を除きます。
決算日	毎月13日(休業日の場合翌営業日)
収益分配	毎月1回決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。 (注1) 当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金支払いコース」があります。 (注2) お取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。
信託期間	平成18年9月27日から平成28年10月13日まで
信託報酬率	信託財産の純資産総額に対して年率1.3125%(税抜 1.25%)

◆投資家のみなさまにおかれましては、商品の内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

(注) 上記の「主要投資対象」および「投資態度」の項にある(※)は、以下の各々の場合において、次のように読替えるものとします。

「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の場合	東京
「りそな・埼玉応援・資産分散ファンド」の場合	埼玉
「りそな・多摩応援・資産分散ファンド」の場合	多摩
「りそな・神奈川応援・資産分散ファンド」の場合	神奈川
「りそな・中部応援・資産分散ファンド」の場合	中部
「りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド」の場合	京都滋賀
「りそな・大阪応援・資産分散ファンド」の場合	大阪
「りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド」の場合	兵庫

りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ

ファンドの特色

1

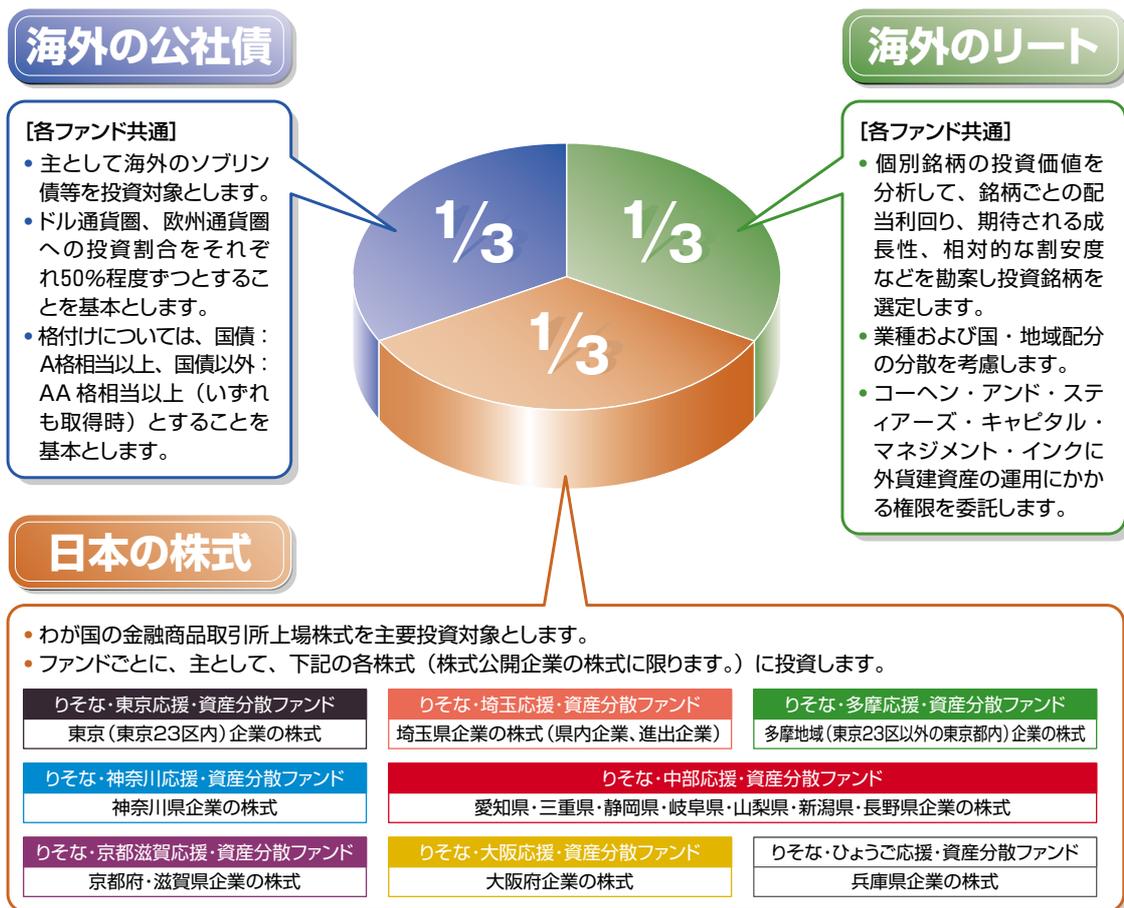
「りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ」は、次の8本のファンドで構成されています。

りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ	
りそな・東京応援・資産分散ファンド	(愛称: 大江戸ブンさん)
りそな・埼玉応援・資産分散ファンド	(愛称: 埼玉ブンさん)
りそな・多摩応援・資産分散ファンド	(愛称: 多摩ブンさん)
りそな・神奈川応援・資産分散ファンド	(愛称: はまのブンさん)
りそな・中部応援・資産分散ファンド	(愛称: りそちゅーブンさん)
りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド	(愛称: 京・近江ブンさん)
りそな・大阪応援・資産分散ファンド	(愛称: 上方ブンさん)
りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド	(愛称: ひょうご元気ブンさん)

2

各ファンドは、マザーファンドを通じて、わが国の株式ならびに海外の公社債および不動産投資信託証券に3分の1ずつを目処に投資し、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得により、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

◆◆◆ 資産配分のイメージ ◆◆◆



(注1) 上記は、「投資態度」に規定されている「各マザーファンドの標準組入比率」をもとに作成した資産配分イメージであり、実際の組入比率とは異なります。

(注2) 各資産への投資は、下記の各マザーファンドを通じて行ないます。各マザーファンドの投資対象および投資方針について、くわしくは後掲のご説明をご参照下さい。



※図中の各記号 (〇〇、□□、◇◇) を、各ファンドごとに次のとおり読替えて下さい。

〇〇	□□	◇◇
東 京	東 京	東京 (東京23区内)
埼 玉	埼 玉	埼玉県 (県内企業、進出企業)
多 摩	多 摩	多摩地域 (東京23区以外の東京都内)
神 奈 川	神 奈 川	神奈川県
中 部	中 部	愛知県・三重県・静岡県・岐阜県・山梨県・新潟県・長野県
京 都 滋 賀	京 都 滋 賀	京都府・滋賀県
大 阪	大 阪	大阪府
ひょうご	兵 庫	兵庫県

◎保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

◎当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

3

毎月1回、13日 (休業日の場合翌営業日) に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

- ◆分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等とします。
- ◆原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- ◆基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益 (評価益を含みます。) 等を中心に分配する場合があります。
- ◆分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ



- 上記は、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
- 分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
- ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

4

販売会社は、各ファンドにおいて、その收受した信託報酬の一部(毎年、各ファンドごとに、8月決算日時点の純資産総額の0.05%程度)を、地方公共団体、社会的課題に取り組む団体、社会貢献活動を行っている非営利団体等に寄付を行ない、当該団体等を通じて各地域の発展に貢献いたします。

- 寄付先・寄付金額については運用報告書等において受益者に報告します。
- ただし、将来的には状況によって寄付金額等が変更になることがあります。

「日本の株式」部分の各マザーファンドの運用について

1. 主要投資対象 [各マザーファンド共通]

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

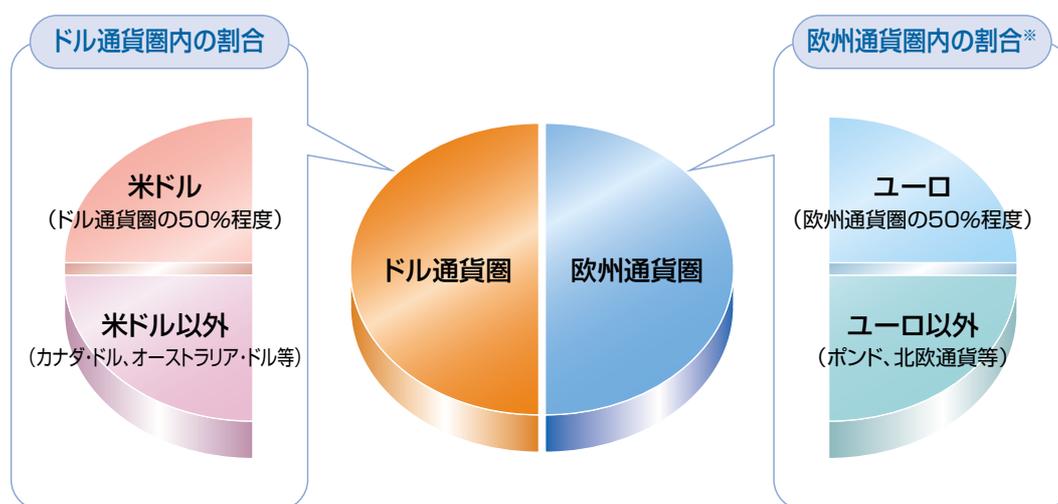
2. 投資態度

東京応援マザーファンド	<p>①主として、東京企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②東京企業とは、東京23区内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、各区毎に投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける業種分散、銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
埼玉応援マザーファンド	<p>①主として、埼玉県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②埼玉県企業とは、埼玉県内に本社を置いている企業（以下、「県内企業」といいます。）と、埼玉県に進出し雇用を創出している企業（以下、「進出企業」といいます。）とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、県内従業員数など埼玉県との関連度、投資対象銘柄の規模（県内企業については時価総額、進出企業については時価総額に一定の値を乗じた額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
多摩応援マザーファンド	<p>①主として、多摩地域企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②多摩地域企業とは、東京23区以外の東京都内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
神奈川応援マザーファンド	<p>①主として、神奈川県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②神奈川県企業とは、神奈川県内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
中部応援マザーファンド	<p>①主として、愛知県・三重県・静岡県・岐阜県・山梨県・新潟県・長野県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②愛知県・三重県・静岡県・岐阜県・山梨県・新潟県・長野県企業とは、愛知県、三重県、静岡県、岐阜県、山梨県、新潟県および長野県内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
京都滋賀応援マザーファンド	<p>①主として、京都府・滋賀県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②京都府・滋賀県企業とは、京都府および滋賀県内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
大阪応援マザーファンド	<p>①主として、大阪府企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②大阪府企業とは、大阪府内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
兵庫応援マザーファンド	<p>①主として、兵庫県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②兵庫県企業とは、兵庫県内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
各マザーファンドに共通の規定	<p>④株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の90%程度以上とすることを基本とします。</p> <p>⑤当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」の運用について

- 1 主として海外のソブリン債等(国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債など)を投資対象とし、安定的な利子等収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
- 2 投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。
 - イ. 米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等をドル通貨圏、ユーロ、ポンドおよび北欧通貨等を欧州通貨圏とし、2通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします(上記の投資割合は10%の範囲内で変動することがあります)。
 - ※北欧通貨：スウェーデン・クローネ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ
 - ロ. ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします。

ポートフォリオのイメージ図



※欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。

- ハ. 国債については、取得時においてA格相当以上(ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上)とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてAA格相当以上(ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上)とすることを基本とします。
- ニ. ポートフォリオの修正デュレーションは5(年)程度から10(年)程度の範囲を基本とします。
- ホ. 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建の国債先物取引等を利用することがあります。

- 3 外貨建資産への投資にあたっては、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建資産の投資比率合計を、信託財産の純資産総額の100%に近づけることを基本とします。
- 4 保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

債券の格付けについて

信用度	ムーディーズ社の場合	S & P 社の場合
高い	Aaa	AAA
	Aa { Aa1, Aa2, Aa3 }	AA { AA+, AA, AA- }
	A { A1, A2, A3 }	A { A+, A, A- }
	Baa	BBB
	Ba	BB
	B	B
	Caa	CCC
	Ca	CC
低い	C	C
		D

※1 } ※2

国債については、取得時においてA格相当以上(※2)とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてAA格相当以上(※1)とすることを基本とします。

債券の格付けとは、償還時までの債券の元本、利息の支払いの確実性に関する将来の見通しを示すもので、ムーディーズ社やスタンダード・アンド・プアーズ社(S & P社)といった格付機関が各債券の格付けを行っています。付与された格付けは、随時見直しが行なわれ、発行体の財務状況の変化などによって格上げや格下げが行なわれることがあります。

デュレーションについて

金利が変動したときに債券の価格がどの程度変化するかを示す指標です。この値が大きいほど金利が変動したときの債券価格への影響が大きくなります。

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

「世界REITマザーファンド」の運用について

- 1 主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録(上場予定および登録予定を含みます。)の不動産投資信託証券を投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
- 2 投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。
 - イ. 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。
 - ロ. 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。
- 3 外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。
- 4 不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。
- 5 保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

[リート(REIT)について]

- ◆リート(REIT)とは、Real Estate Investment Trustの略称です。
- ◆不動産投資に特化した会社(または信託)です。
- ◆リートは投資家から集めた資金等により不動産を購入し、購入した不動産からの収入や売却によって得た利益を配当として投資家に分配します。

〈コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

- 米国最初のリート専門の運用会社として1986年7月に設立。
- リート運用では最大級の資産規模。
- ワールドワイドなリサーチ力と運用力を有する。
- 優先証券、公益株、バリュー株その他の高配当株の運用にも進出。インカム重視の運用を全般に展開。
- 所在地：アメリカ合衆国、ニューヨーク州、ニューヨーク

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

価額変動リスクなど

価額変動リスク

当ファンドは、株式、公社債、不動産投資信託証券など値動きのある証券(外国証券には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

投資家のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します(値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。)。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合(債務不履行)、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します(利息および償還金が支払われないこともあります。)。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

③ リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

リートは、株式と同様に金融商品取引所等で売買され、その価格は、不動産市況に対する見通しや市場における需給等、さまざまな要因で変動します。

- リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
- 金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

価額変動リスクなど

リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
- リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
- リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
- 法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもあります。

リートに関する法制度(税制、会計制度等)が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。

- その他、不動産を取巻く規制(建築規制、環境規制等)に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
- 金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

組入リートの市場価格が下落した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

④ 外国証券への投資に伴うリスク

イ. 為替リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

当ファンドにおいては、保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。そのため、外貨建資産を実質的に組入れた部分は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ. カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。

⑤ その他

イ. 解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ. ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります(信用リスク)。この場合、基準価額が下落する要因となります。

換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付を中止することがあります。ご換金の申込みの受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

お買付けは…

お買付時期

原則としていつでもお買付けをお申込みいただけます。

- ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン国際金融先物取引所(LIFFE)またはオーストラリア証券取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を申込受付日とするお申込みの受付けは行ないません。
- なお、委託会社の各営業日*の午後3時(年末年始など半休日においては午前11時)までに受付けたお申込み(当該お申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの)を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれるお申込みは、翌営業日*の取扱いとなります。

※上記のお申込受付中止日を除きます。

お買付単位

各ファンドについて、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位とします。

(注) くわしくは、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

お買付価額

お買付価額(1万口当り)は、各ファンドについて、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

申込手数料

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.1%(税抜 2.0%)です。

(注1) くわしくは、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

(注2) 申込手数料には、消費税等が課されます。

(注3) 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

収益分配金は…

分配時期

毎月1回決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

- 決算日は、毎月13日(休業日の場合翌営業日)です。

支払方法

当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金支払いコース」があります。

- 「分配金再投資コース」をご利用の場合
収益分配金は、税金を差引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。
- 「分配金支払いコース」をご利用の場合
収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いいたします(税金が差引かれます。)

(注) お取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異なる場合があります。

収益分配金に対する税金は…

●個人の受益者の場合

普通分配金について、平成21年3月31日まで10%(所得税7%および地方税3%)の税率による源泉徴収が行なわれます。申告不要制度が適用されますが、確定申告を行ない、総合課税を選択することもできます。

上記に記載の10%(所得税7%および地方税3%)の税率は、平成21年4月1日から、20%(所得税15%および地方税5%)となります。

●法人の受益者の場合

普通分配金について、平成21年3月31日まで7%(所得税7%)の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。上記に記載の7%(所得税7%)の税率は、平成21年4月1日から、15%(所得税15%)となります。

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「特別分配金」(受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分で、税金はかかりません。)の区分があります。

- ①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
- ②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

(注) 税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

ご換金は…

ご換金時期

原則としていつでもご換金をお申込みいただけます。

- ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン国際金融先物取引所(LIFFE)またはオーストラリア証券取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を申込受付日とするお申込みの受け付けは行ないません。
- なお、委託会社の各営業日*の午後3時(年末年始など半休日においては午前11時)までに受付けたお申込み(当該お申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを)、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれるお申込みは、翌営業日*の取扱いとなります。

※上記のお申込受付中止日を除きます。

ご換金単位

各ファンドについて、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位とします。

※信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の「解約請求」には制限があります。

お手取額

1万口当りのお手取額は、次のとおりです。

[個人の受益者の場合]

●「解約請求」の場合

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、所得税および地方税(個別元本超過額の10%。平成21年4月1日から20%)を差引いた金額となります。申告不要制度が適用されますが、確定申告を行ない、総合課税を選択することもできます。なお、解約差損については、確定申告により、株式の売買益との通算が可能となります。

[法人の受益者の場合]

●「解約請求」の場合

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、所得税(個別元本超過額の7%。平成21年4月1日から15%)を差引いた金額となります。地方税の源泉徴収はありません。

(注) 税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

支払開始日

代金は、原則としてお申込受付日から起算して5営業日目以降にお支払いいたします。

信託期間は…

平成28年10月13日が信託期間終了日です。

- ただし、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合等には、繰上償還することがあります。

償還金は…

支払開始日など

償還金は、原則として信託終了日から起算して5営業日までにお支払いいたします。

- 個人の受益者の場合、償還時の個別元本超過額について、平成21年3月31日まで10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行なわれます。申告不要制度が適用されますが、確定申告を行ない、総合課税を選択することもできます。なお、償還差損については、確定申告により、株式の売買益との通算が可能となります。

上記に記載の10%（所得税7%および地方税3%）の税率は、平成21年4月1日から、20%（所得税15%および地方税5%）となります。

- 法人の受益者の場合、償還時の個別元本超過額について、平成21年3月31日まで7%（所得税7%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。

上記に記載の7%（所得税7%）の税率は、平成21年4月1日から、15%（所得税15%）となります。

（注）税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

受益証券は…

- ファンドの受益権は、社債等の振替に関する法律(政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。)の規定の適用を受け、委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。

信託報酬などは…

信託報酬など

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.3125%(税抜 1.25%)の率を乗じて得た額とし、信託財産でご負担いただきます。

(注1) 信託報酬の配分については、交付目論見書本文をご参照下さい。

(注2) 委託会社は、「世界REITマザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を支払うものとします。くわしくは、交付目論見書本文をご参照下さい。

- 監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を信託財産でご負担いただきます。

(注) 信託報酬、監査報酬および有価証券売買時の売買委託手数料に対する消費税等に相当する金額を信託財産でご負担いただきます。

運用経過のお知らせは…

- 毎年2月および8月の計算期末に、期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「運用報告書」を作成し、あらかじめお申出いただいたご住所にお届けいたします。
- 基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

● 用語のご説明 ●

<p>1. 基準価額</p>	<p>純資産総額(信託財産に属する資産を時価により評価して得た資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。)を、計算日における受益権口数で除した1万口当りの価額をいいます。基準価額は、組入有価証券の値動き等により、日々変動します。</p>
<p>2. 個別元本</p>	<p>受益者ごとの信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。</p> <p>受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行なうつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。</p> <p>受益者が特別分配金を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。</p>

有価証券届出書の内容
(交付目論見書本文)

提出先 関東財務局長 殿

提出日 平成19年11月6日提出

発行者名 大和証券投資信託委託株式会社

代表者の役職氏名 取締役社長 樋口三千人

本店の所在の場所 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号

事務連絡者氏名 長谷川英男

連絡場所 本店の所在の場所と同じ

電話番号 03-5695-2111

届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称

りそな・東京応援・資産分散ファンド（愛称：大江戸ブンさん）
りそな・埼玉応援・資産分散ファンド（愛称：埼玉ブンさん）
りそな・多摩応援・資産分散ファンド（愛称：多摩ブンさん）
りそな・神奈川応援・資産分散ファンド（愛称：はまのブンさん）
りそな・中部応援・資産分散ファンド（愛称：りそちゅーブンさん）
りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド（愛称：京・近江ブンさん）
りそな・大阪応援・資産分散ファンド（愛称：上方ブンさん）
りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド（愛称：ひょうご元気ブンさん）
(総称を「りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ」とします。)

届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額

継続申込期間（平成19年11月7日から平成20年11月6日まで）
各ファンドについて1兆円を上限とし、合計で8兆円を上限とします。

縦覧に供する場所

該当ありません。

目 次

	頁
第一部 証券情報	1
第二部 ファンド情報	
第1 ファンドの状況	
1 ファンドの性格	4
2 投資方針	13
3 投資リスク	27
4 手数料等及び税金	29
5 運用状況	32
6 手続等の概要	69
7 管理及び運営の概要	70
第2 財務ハイライト情報	74
第3 内国投資信託受益証券事務の概要	90
第4 ファンドの詳細情報の項目	91

第一部 証券情報

(1) ファンドの名称

- りそな・東京応援・資産分散ファンド（愛称：大江戸ブンさん）
- りそな・埼玉応援・資産分散ファンド（愛称：埼玉ブンさん）
- りそな・多摩応援・資産分散ファンド（愛称：多摩ブンさん）
- りそな・神奈川応援・資産分散ファンド（愛称：はまのブンさん）
- りそな・中部応援・資産分散ファンド（愛称：りそちゅーブンさん）
- りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド（愛称：京・近江ブンさん）
- りそな・大阪応援・資産分散ファンド（愛称：上方ブンさん）
- りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド（愛称：ひょうご元気ブンさん）

（注1）上記の総称を「りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ」とします。

（注2）以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指しているものとします。

(2) 内国投資信託受益証券の形態等

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。格付けは、取得しておりません。

ファンドの受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(3) 発行（売出）価額の総額

各ファンドについて1兆円を上限とし、合計で8兆円を上限とします。

(4) 発行（売出）価格

各ファンドについて1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問い合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）
- ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 申込手数料

- ① 販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.1%（税抜2.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問い合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）

- ② 申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されま
す。
- ③ 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6) 申込単位

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）

(7) 申込期間

平成19年11月7日から平成20年11月6日まで（継続申込期間）
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 申込取扱場所

委託会社にお問合わせ下さい。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）
- ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 払込期日

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）を販売会社において支払うものとします。
販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

(10) 払込取扱場所

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、申込取扱場所において支払うものとします。
申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

(11) 振替機関に関する事項

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) その他

- ① 受益権の取得申込者は、申込取扱場所において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。
- ② ニューヨーク証券取引所、ロンドン国際金融先物取引所（LIFFE）またはオーストラリア証券取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を申込受付日とする受益権の取得お

よび換金の申込みの受付は、行ないません。

- ③ 委託会社の各営業日（※）の午後 3 時（年末年始など半休日においては午前 11 時）までに受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。上記の時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日（※）の扱いとなります。
（※）前②の申込受付中止日を除きます。
- ④ 当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異なる場合があります。
- ⑤ 「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。
- ⑥ 取得申込金額に利息は付きません。
- ⑦ 振替受益権について
ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。
ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

◆投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

- ・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(1) ファンドの目的及び基本的性格

当ファンドは、追加型株式投資信託（バランス型）であり、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得により、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

なお、「バランス型」とは、社団法人投資信託協会による追加型株式投資信託の商品分類において、「約款上の株式組入限度 70%未満のファンドで、株式、公社債等のバランス運用、あるいは公社債中心の運用を行なうもの」をいいます。

<信託金の限度額>

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて次の額を限度として信託金を追加することができます。

りそな・東京応援・資産分散ファンド（愛称：大江戸ブンさん）	3,000億円
りそな・埼玉応援・資産分散ファンド（愛称：埼玉ブンさん）	1,500億円
りそな・多摩応援・資産分散ファンド（愛称：多摩ブンさん）	600億円
りそな・神奈川応援・資産分散ファンド（愛称：はまのブンさん）	3,000億円
りそな・中部応援・資産分散ファンド（愛称：りそちゅーブンさん）	3,000億円
りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド（愛称：京・近江ブンさん）	1,500億円
りそな・大阪応援・資産分散ファンド（愛称：上方ブンさん）	3,000億円
りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド（愛称：ひょうご元気ブンさん）	1,200億円

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1

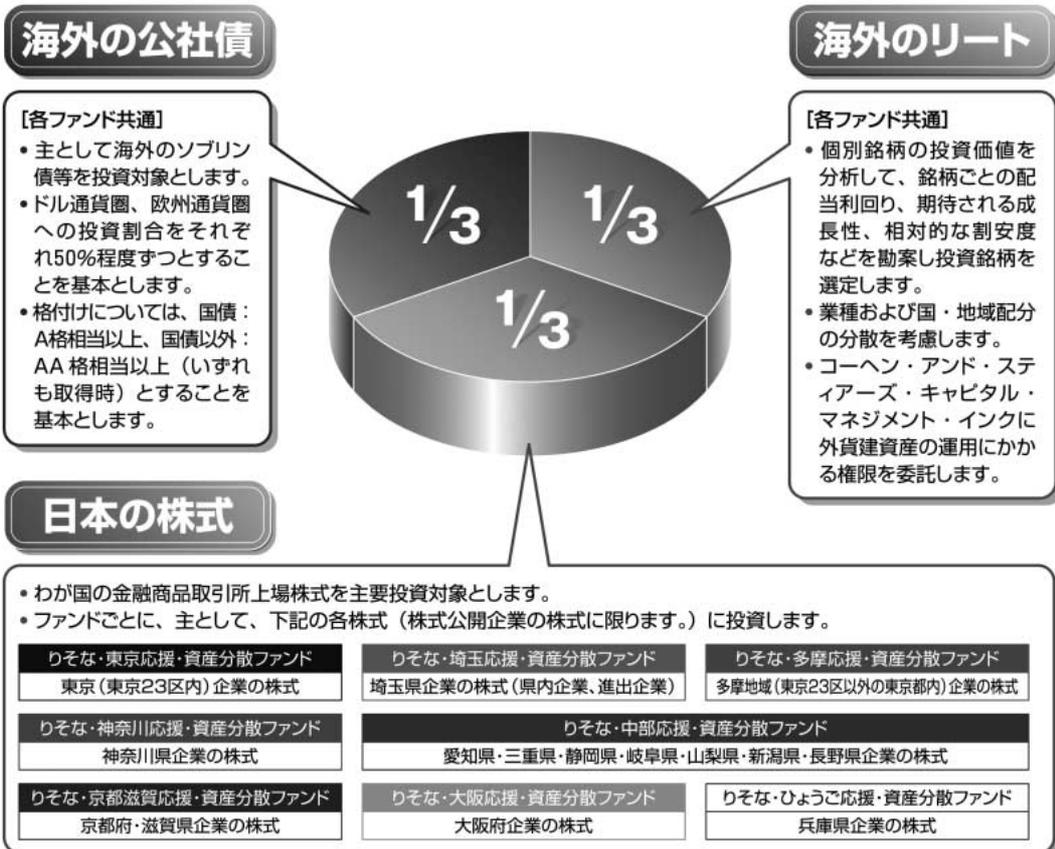
「りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ」は、次の8本のファンドで構成されています。

りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ
りそな・東京応援・資産分散ファンド（愛称：大江戸ブンさん）
りそな・埼玉応援・資産分散ファンド（愛称：埼玉ブンさん）
りそな・多摩応援・資産分散ファンド（愛称：多摩ブンさん）
りそな・神奈川応援・資産分散ファンド（愛称：はまのブンさん）
りそな・中部応援・資産分散ファンド（愛称：りそちゅーブンさん）
りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド（愛称：京・近江ブンさん）
りそな・大阪応援・資産分散ファンド（愛称：上方ブンさん）
りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド（愛称：ひょうご元気ブンさん）

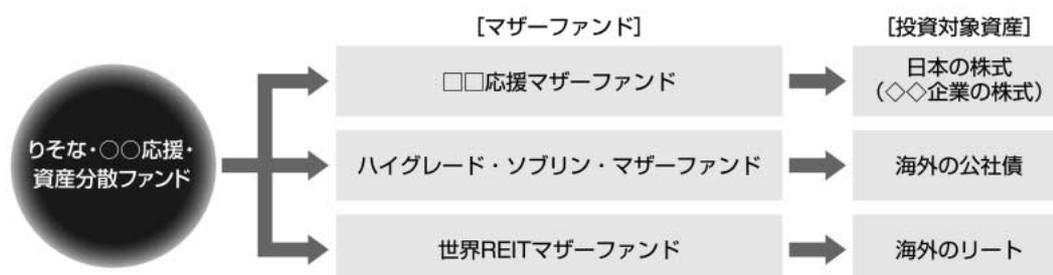
2

各ファンドは、マザーファンドを通じて、わが国の株式ならびに海外の公社債および不動産投資信託証券に3分の1ずつを目処に投資し、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得により、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

◆◆◆ 資産配分のイメージ ◆◆◆



- (注1) 上記は、「投資態度」に規定されている「各マザーファンドの標準組入比率」をもとに作成した資産配分イメージであり、実際の組入比率とは異なります。
- (注2) 各資産への投資は、下記の各マザーファンドを通じて行ないます。各マザーファンドの投資対象および投資方針について、くわしくは後掲のご説明をご参照下さい。



※図中の各記号（〇〇、□□、◇◇）を、各ファンドごとに次のとおり読替えて下さい。

〇〇	□□	◇◇
東 京	東 京	東京（東京23区内）
埼 玉	埼 玉	埼玉県（県内企業、進出企業）
多 摩	多 摩	多摩地域（東京23区以外の東京都内）
神 奈 川	神 奈 川	神奈川県
中 部	中 部	愛知県・三重県・静岡県・岐阜県・山梨県・新潟県・長野県
京都滋賀	京都滋賀	京都府・滋賀県
大 阪	大 阪	大阪府
ひょうご	兵 庫	兵庫県

- ◎保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ◎当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

3 毎月1回、13日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

- ◆分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ◆原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- ◆基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。
- ◆分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ



- 上記は、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
- 分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
- ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

4

販売会社は、各ファンドにおいて、その收受した信託報酬の一部(毎年、各ファンドごとに、8月決算日時点の純資産総額の0.05%程度)を、地方公共団体、社会的課題に取り組む団体、社会貢献活動を行っている非営利団体等に寄付を行ない、当該団体等を通じて各地域の発展に貢献いたします。

- 寄付先・寄付金額については運用報告書等において受益者に報告します。
- ただし、将来的には状況によって寄付金額等が変更になることがあります。

「日本の株式」部分の各マザーファンドの運用について

1. 主要投資対象 [各マザーファンド共通]

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

2. 投資態度

東京応援マザーファンド	<p>①主として、東京企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②東京企業とは、東京23区内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、各区毎に投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける業種分散、銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
埼玉応援マザーファンド	<p>①主として、埼玉県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②埼玉県企業とは、埼玉県内に本社を置いている企業（以下、「県内企業」といいます。）と、埼玉県に進出し雇用を創出している企業（以下、「進出企業」といいます。）とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、県内従業員数など埼玉県との関連度、投資対象銘柄の規模（県内企業については時価総額、進出企業については時価総額に一定の値を乗じた額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
多摩応援マザーファンド	<p>①主として、多摩地域企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②多摩地域企業とは、東京23区以外の東京都内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
神奈川応援マザーファンド	<p>①主として、神奈川県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②神奈川県企業とは、神奈川県内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
中部応援マザーファンド	<p>①主として、愛知県・三重県・静岡県・岐阜県・山梨県・新潟県・長野県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②愛知県・三重県・静岡県・岐阜県・山梨県・新潟県・長野県企業とは、愛知県、三重県、静岡県、岐阜県、山梨県、新潟県および長野県内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
京都滋賀応援マザーファンド	<p>①主として、京都府・滋賀県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②京都府・滋賀県企業とは、京都府および滋賀県内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
大阪応援マザーファンド	<p>①主として、大阪府企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②大阪府企業とは、大阪府内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
兵庫応援マザーファンド	<p>①主として、兵庫県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②兵庫県企業とは、兵庫県内に本社を置いている企業とします。</p> <p>③ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
各マザーファンドに共通の規定	<p>④株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の90%程度以上とすることを基本とします。</p> <p>⑤当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」の運用について

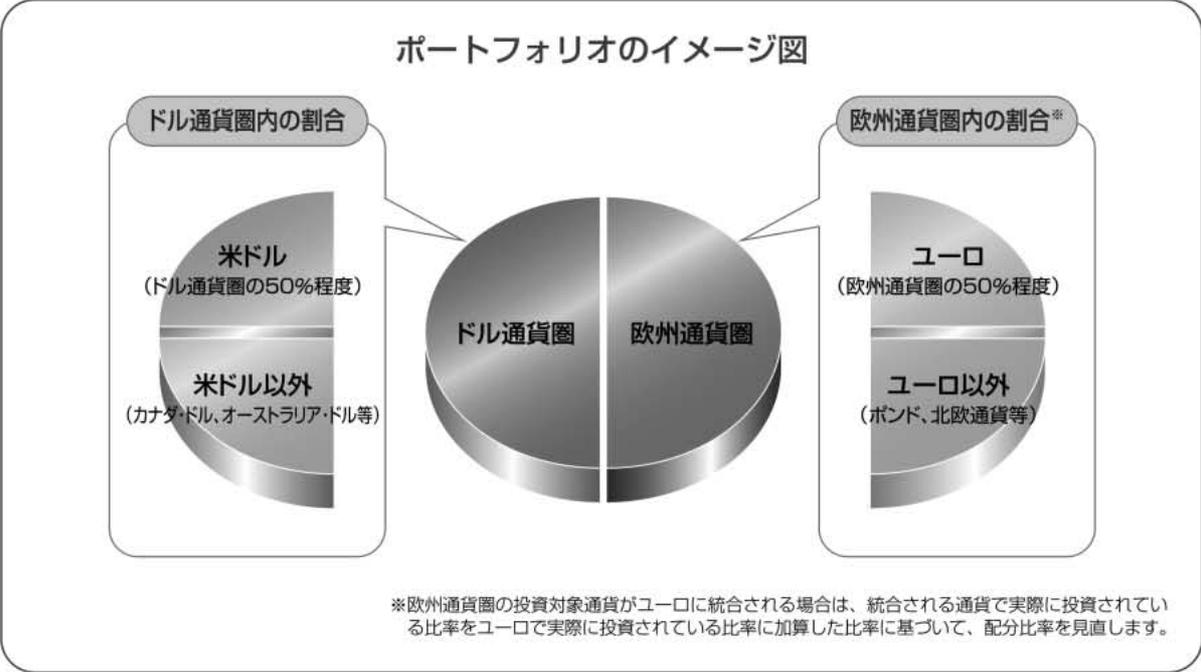
1 主として海外のソブリン債等(国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債など)を投資対象とし、安定的な利子等収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。

2 投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。

イ. 米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等をドル通貨圏、ユーロ、ポンドおよび北欧通貨等を欧州通貨圏とし、2通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします(上記の投資割合は10%の範囲内で変動することがあります)。

※北欧通貨：スウェーデン・クローネ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ

ロ. ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします。



ハ. 国債については、取得時においてA格相当以上(ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上)とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてAA格相当以上(ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上)とすることを基本とします。

ニ. ポートフォリオの修正デュレーションは5(年)程度から10(年)程度の範囲を基本とします。

ホ. 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建の国債先物取引等を利用することがあります。

- 3 外貨建資産への投資にあたっては、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建資産の投資比率合計を、信託財産の純資産総額の100%に近づけることを基本とします。
- 4 保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

債券の格付けについて

信用度	ムーディーズ社の場合	S & P社の場合
高い	Aaa	AAA
	Aa { Aa1 Aa2 Aa3 }	AA { AA+ AA AA- }
	A { A1 A2 A3 }	A { A+ A A- }
	Baa	BBB
	Ba	BB
	B	B
	Caa	CCC
	Ca	CC
	C	C
低い		D

※1 }
※2 }

国債については、取得時においてA格相当以上(※2)とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてAA格相当以上(※1)とすることを基本とします。

債券の格付けとは、償還時までの債券の元本、利息の支払いの確実性に関する将来の見通しを示すもので、ムーディーズ社やスタンダード・アンド・プアーズ社(S & P社)といった格付機関が各債券の格付けを行なっています。付与された格付けは、随時見直しが行なわれ、発行体の財務状況の変化などによって格上げや格下げが行なわれることがあります。

デュレーションについて

金利が変動したときに債券の価格がどの程度変化するかを示す指標です。この値が大きいほど金利が変動したときの債券価格への影響が大きくなります。

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

「世界REITマザーファンド」の運用について

- 1 主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録(上場予定および登録予定を含みます。)の不動産投資信託証券を投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
- 2 投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。
 - イ. 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。
 - ロ. 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。
- 3 外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。
- 4 不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。
- 5 保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

[リート(REIT)について]

- ◆リート(REIT)とは、Real Estate Investment Trustの略称です。
- ◆不動産投資に特化した会社(または信託)です。
- ◆リートは投資家から集めた資金等により不動産を購入し、購入した不動産からの収入や売却によって得た利益を配当として投資家に分配します。

〈コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

- 米国最初のリート専門の運用会社として1986年7月に設立。
- リート運用では最大級の資産規模。
- ワールドワイドなリサーチ力と運用力を有する。
- 優先証券、公益株、バリュー株その他の高配当株の運用にも進出。インカム重視の運用を全般に展開。
- 所在地：アメリカ合衆国、ニューヨーク州、ニューヨーク

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) ファンドの仕組み

受益者	お申込者	
	収益分配金（注1）、償還金など↑↓お申込金（※5）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※5）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など
↓運用指図 ↑↓※2	損益↑↓信託金（※5）	
受託会社	りそな信託銀行株式会社 再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など
	損益↑↓投資	
投資対象	わが国の株式、海外の公社債、海外の不動産投資信託証券 など（マザーファンド方式で運用を行ないます。なお、世界REITマザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク（投資顧問会社）（注2）に運用の指図にかかる権限を委託します。）	

（注1）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

（注2）投資顧問会社は、委託会社との間の運用委託契約（※3）に基づき、委託会社から権限の委託を受けて、世界REITマザーファンドにおける外貨建資産の運用の指図を行ないます（※4）。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

※3：運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等

が定められています。

※4: 投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

※5: 販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

◎委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

[マザーファンド方式について]

当ファンドは、マザーファンド方式で運用を行ないます。マザーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主として各マザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用を各マザーファンドで行なうしくみです。

<委託会社の概況（平成19年9月末日現在）>

- ・資本金の額 151億7,427万2,500円
- ・沿革
 - 昭和34年12月12日 設立登記
 - 昭和35年2月17日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
 - 昭和35年4月1日 営業開始
 - 昭和60年11月8日 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
 - 平成7年5月31日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
 - 平成7年9月14日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
- ・大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区大手町二丁目6番4号	株 2,608,525	% 100.00

2 投資方針

(1) 投資方針

① 主要投資対象<各ファンド共通>

下記の各マザーファンド（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

1. (※) 応援マザーファンドの受益証券
2. ハイグレード・ソブリン・マザーファンドの受益証券
3. 世界REITマザーファンドの受益証券

② 投資態度<各ファンド共通>

イ. 主として、各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得により、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

ロ. 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

(※) 応援マザーファンドの受益証券……………信託財産の純資産総額の3分の1
ハイグレード・ソブリン・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3分の1
世界REITマザーファンドの受益証券……………信託財産の純資産総額の3分の1

ハ. 保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ない

ません。

- ニ、当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

<各ファンド共通>

- ① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - 有価証券
 - 約束手形
 - 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの
 - 次に掲げる特定資産以外の資産
 - 為替手形
- ② 委託会社は、信託金を、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、りそな信託銀行株式会社を受託者として締結された（※）応援マザーファンドの受益証券、ハイグレード・ソブリン・マザーファンドの受益証券および世界REITマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
- コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
 - 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
 - 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

（注）上記の（※）は、以下の各々の場合において、次のように読替えるものとします。

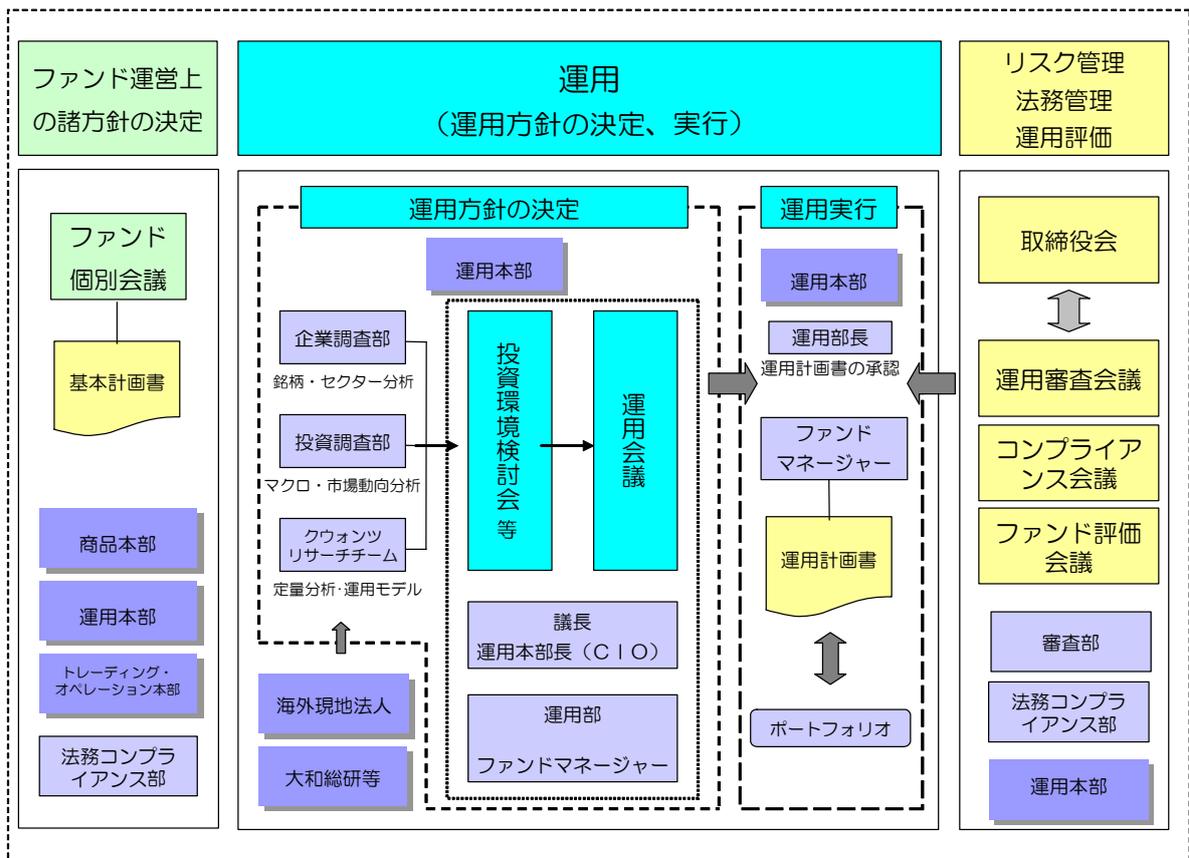
「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の場合	東京
「りそな・埼玉応援・資産分散ファンド」の場合	埼玉
「りそな・多摩応援・資産分散ファンド」の場合	多摩
「りそな・神奈川応援・資産分散ファンド」の場合	神奈川
「りそな・中部応援・資産分散ファンド」の場合	中部
「りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド」の場合	京都滋賀
「りそな・大阪応援・資産分散ファンド」の場合	大阪
「りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド」の場合	兵庫

- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みません。）により運用することを指図することができます。
- 預金
 - 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - コール・ローン
 - 手形割引市場において売買される手形

(3) 運用体制

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ. 基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ. 投資環境の検討

運用最高責任者である運用本部長（CIO）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ. 基本的な運用方針の決定

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ. 運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用本部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

③ 職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

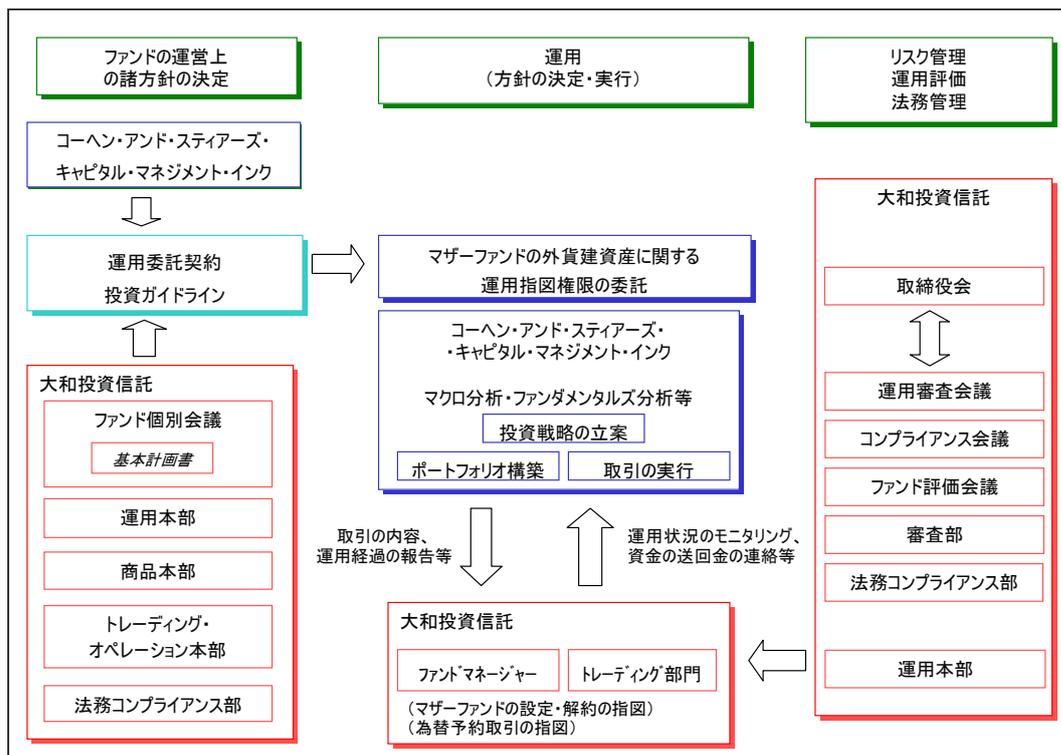
イ. 運用本部長（CIO）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営

- ・ファンドマネージャーの任命・変更
 - ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
 - ・各ファンドの分配政策の決定
 - ・代表取締役に対する随時的的確な状況報告
 - ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定
- ロ. 運用副本部長（1～5名程度）
C I Oを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。
- ハ. 運用部長（各運用部に1名）
ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。
- ニ. ファンドマネージャー
ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。
- ④ ファンド評価会議・運用審査会議・コンプライアンス会議
ファンド評価会議は、運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、ファンドの運用リスク管理の状況についての報告を受けて、必要事項を審議・決定します。
さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるコンプライアンス会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。
これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は15～25名程度です。
- ⑤ 受託会社に対する管理体制
信託財産の管理業務を通じて、受託会社の信託事務の正確性・迅速性、システム対応力等を総合的に検証しています。また、年次で受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受けています。

※海外のリート部分にかかる運用体制について
(世界REITマザーファンドにかかるものを含みます。)



イ. ファンド運営上の諸方針の決定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。なお、世界REITマザーファンドでは、コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに外貨建資産の運用の指図にかかる権限を委託します。このため、コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクと委託会社の間で締結する運用委託契約に基づく投資ガイドラインに、このファンド運営上の諸方針が反映されます。

ロ. 運用の実行

コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクは、投資ガイドラインに基づき、投資戦略の立案、ポートフォリオ構築を行ない、取引を実行します。

ハ. モニタリング

委託会社は、コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクとの間で取引の内容、運用経過の報告等を受け、資金動向等について必要な連絡を取るとともに、運用の状況、投資ガイドラインの遵守状況等をモニタリングします。

また、定期的なアンケートの実施およびコンプライアンスレポートの徴求により、運用体制、管理体制、コンプライアンス体制等についての報告を受けています。さらに、現地訪問による調査も行なっています。これらの報告及び調査をもとに評価を行ない、委託会社でのファンド個別会議へ報告しています。

ニ. リスク管理、運用評価、法務管理

(前④に同じ。)

※ 上記の運用体制は平成19年9月末日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 分配方針

<各ファンド共通>

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1および第2計算期末には、収益の分配は行ないません。
- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 投資制限

<各ファンド共通>

- ① 株式（信託約款）
株式への直接投資は、行ないません。
- ② 外貨建資産（信託約款）
外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ③ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）
外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- ④ 外国為替予約取引（信託約款）
委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、

外国為替の売買の予約を指図することができます。

⑤ 資金の借入れ（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ハ. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考>マザーファンドの概要

1. 東京応援マザーファンド
2. 埼玉応援マザーファンド
3. 多摩応援マザーファンド
4. 神奈川応援マザーファンド
5. 中部応援マザーファンド
6. 京都滋賀応援マザーファンド
7. 大阪応援マザーファンド
8. 兵庫応援マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

わが国の金融商品取引所（※）上場株式を主要投資対象とします。

※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。

② 投資態度

イ. (※)

ロ. (※)

ハ. (※)

ニ. 株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の90%程度以上とすることを基本とします。

ホ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(注) 上記の(※)は、以下の各々の場合において、次のように読替えるものとします。

「東京応援マザーファンド」の場合	イ. 主として、東京企業（株式公開企業に限りません。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。 ロ. 東京企業とは、東京23区内に本社を置いている企業とします。
------------------	---

	<p>ハ. ポートフォリオの構築にあたっては、各区毎に投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける業種分散、銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
「埼玉応援マザーファンド」の場合	<p>イ. 主として、埼玉県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>ロ. 埼玉県企業とは、埼玉県内に本社を置いている企業（以下「県内企業」といいます。）と、埼玉県に進出し雇用を創出している企業（以下「進出企業」といいます。）とします。</p> <p>ハ. ポートフォリオの構築にあたっては、県内従業員数など埼玉県との関連度、投資対象銘柄の規模（県内企業については時価総額、進出企業については時価総額に一定の値を乗じた額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
「多摩応援マザーファンド」の場合	<p>イ. 主として、多摩地域企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>ロ. 多摩地域企業とは、東京 23 区以外の東京都内に本社を置いている企業とします。</p> <p>ハ. ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
「神奈川応援マザーファンド」の場合	<p>イ. 主として、神奈川県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>ロ. 神奈川県企業とは、神奈川県内に本社を置いている企業とします。</p> <p>ハ. ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
「中部応援マザーファンド」の場合	<p>イ. 主として、愛知県・三重県・静岡県・岐阜県・山梨県・新潟県・長野県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>ロ. 愛知県・三重県・静岡県・岐阜県・山梨県・新潟県・長野県企業とは、愛知県、三重県、静岡県、岐阜県、山梨県、新潟県および長野県内に本社を置いている企業とします。</p> <p>ハ. ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
「京都滋賀応援マザーファンド」の場合	<p>イ. 主として、京都府・滋賀県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>ロ. 京都府・滋賀県企業とは、京都府および滋賀県内に本社を置いている企業とします。</p> <p>ハ. ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
「大阪応援マザーファンド」の場合	<p>イ. 主として、大阪府企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>ロ. 大阪府企業とは、大阪府内に本社を置いている企業とします。</p> <p>ハ. ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>

「兵庫応援マザーファンド」の場合	<p>イ. 主として、兵庫県企業（株式公開企業に限ります。）の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>ロ. 兵庫県企業とは、兵庫県内に本社を置いている企業とします。</p> <p>ハ. ポートフォリオの構築にあたっては、投資対象銘柄の規模（時価総額）、株式ポートフォリオにおける銘柄分散、市場流動性、投資リスク等を考慮して組入銘柄を選定し各銘柄の組入比率を決定します。</p>
------------------	---

(2) 投資対象

- ① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産(本邦通貨表示のものに限ります。)の種類は、次に掲げるものとします。
 1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）
 - ハ. 約束手形
 - ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの
 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形
- ② 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
 1. 株券または新株引受権証書
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 19. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みません。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

- ① 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③ 外貨建資産への投資は、行ないません。
- ④ 先物取引等
 - イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
 1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
 - ロ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
 1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の

時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑤ スワップ取引

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑥ 金利先渡取引

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

9. ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

海外の公社債等を主要投資対象とします。

② 投資態度

- イ. 主として海外のソブリン債等（国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債など）を投資対象とし、安定的な利子等収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
- ロ. 投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。
 - a. 米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等をドル通貨圏、ユーロ、ポンドおよび北欧通貨等を欧州通貨圏とし、2 通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします（上記の投資割合は10%の範囲

内で変動することがあります。)

※北欧通貨：スウェーデン・クローネ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ

- b. ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を 50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を 50%程度とすることを基本とします（ただし、欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。）。
 - c. 国債については、取得時においてA格相当以上（ムーディーズでA 3以上またはS & PでA-以上）とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてAA格相当以上（ムーディーズでA a 3以上またはS & PでAA-以上）とすることを基本とします。
 - d. ポートフォリオの修正デュレーションは 5(年)程度から 10(年)程度の範囲を基本とします。
 - e. 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建の国債先物取引等を利用することがあります。
- ハ. 外貨建資産の投資にあたっては、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建資産の投資比率合計を、信託財産の純資産総額の 100%に近づけることを基本とします。
- ニ. 保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
- ホ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

- ① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第 3 条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、後掲 (3) ④、⑤および⑥に定めるものに限りません。）
 - ハ. 約束手形
 - ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第 22 条第 1 項第 5 号に掲げるもの
 - 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形
- ② 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
 - 1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限りません。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券
 - 2. 国債証券
 - 3. 地方債証券
 - 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. コマーシャル・ペーパー
 8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
 9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの
 なお、前1.の証券または証書、前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みません。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

- ① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ④ 先物取引等
 - イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
 - ロ. 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

- ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- ⑤ スワップ取引
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。
- ⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

10. 世界REITマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

海外の金融商品取引所（※）上場および店頭登録（上場予定および登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。

② 投資態度

- イ. 主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券を投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
- ロ. 投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。
 - (a) 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。
 - (b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。
- ハ. 外貨建資産の運用にあたっては、コーペン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。
- ニ. 不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。
- ホ. 保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
- ヘ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

- ① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. 約束手形
 - ハ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの
 - 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形
- ② 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
 - 1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
 - 2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
 - 3. 外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 4. 外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 - 5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 6. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みません。）により運用することを指図することができます。
 - 1. 預金
 - 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3. コール・ローン
 - 4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

- ① 株式への直接投資は、行ないません。
- ② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ③ 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(4) 運用指図権限の委託

- ① 委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次の者に委託します。
コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク
280 パーク・アベニュー、ニューヨーク、ニューヨーク州 10017
- ② 前①の規定にかかわらず、前①により委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

3 投資リスク

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式、公社債、不動産投資信託証券など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

投資家のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

③ リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

イ．リートは、株式と同様に金融商品取引所等で売買され、その価格は、不動産市況に対する見通しや市場における需給等、さまざまな要因で変動します。

・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。

・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リーートの価格や配当は、リーートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
 - ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
 - ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
 - ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもあります。
- ハ．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。
- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
 - ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。
- ニ．組入リートの市場価格が下落した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。
- ④ 外国証券への投資に伴うリスク
- イ．為替リスク
- 外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。
- 当ファンドにおいては、保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。そのため、外貨建資産を実質的に組入れた部分は、為替レートの変動の影響を直接受けます。
- ロ．カントリー・リスク
- 投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。
- ⑤ その他
- イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。
- ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

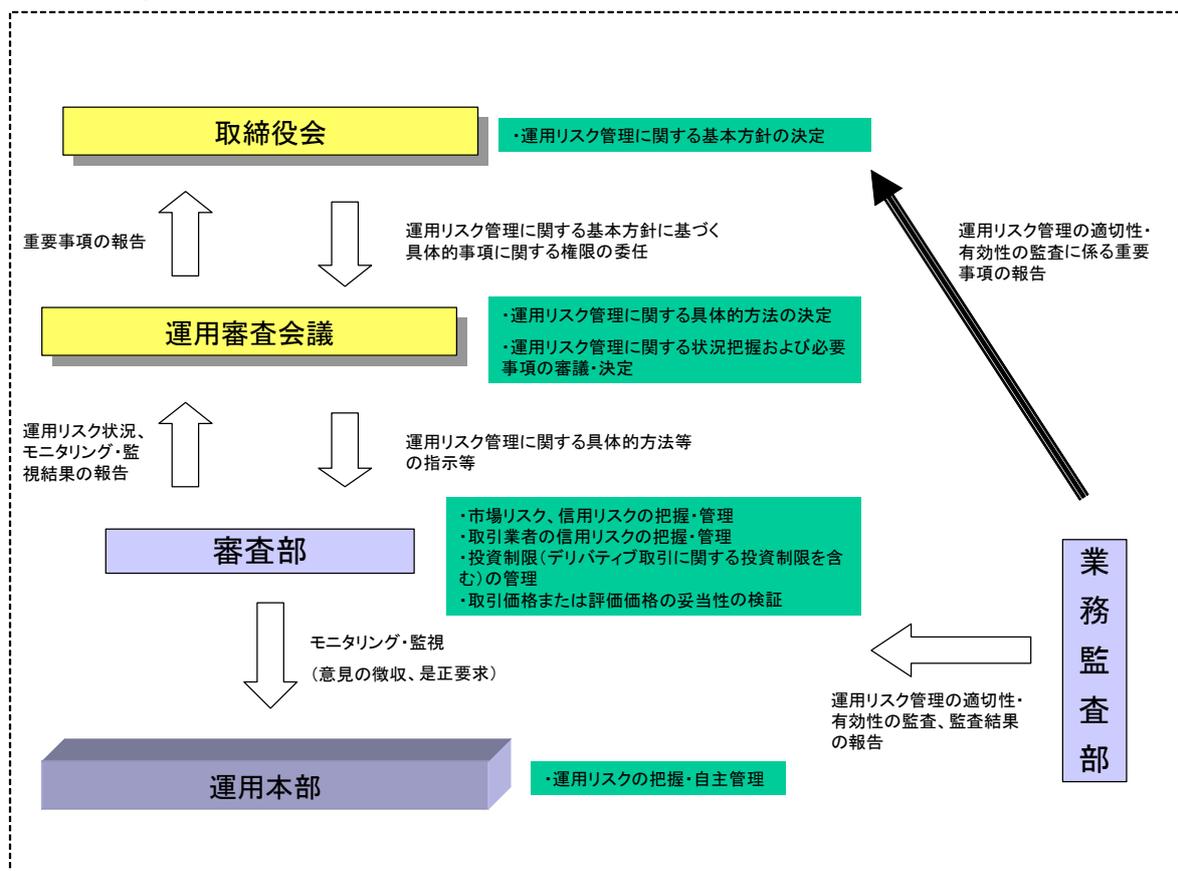
(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付を中止することがあります。ご換金の申込みの受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回で

きます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) リスク管理体制



4 手数料等及び税金

(1) 申込手数料

① 販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.1%（税抜2.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）

② 申込手数料には、消費税等が課されます。

③ 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 換金（解約）手数料

ありません。

(3) 信託報酬等

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.3125%（税抜1.25%）の率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

- ② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、信託財産の純資産総額に応じて次のとおりです。

	委託会社	販売会社	受託会社
100 億円未満	年 0.5775% (税抜 0.55%)	年 0.6825% (税抜 0.65%)	年 0.0525% (税抜 0.05%)
100 億円以上 300 億円未満	年 0.5250% (税抜 0.50%)	年 0.7350% (税抜 0.70%)	
300 億円以上 500 億円未満	年 0.4725% (税抜 0.45%)	年 0.7875% (税抜 0.75%)	
500 億円以上	年 0.4200% (税抜 0.40%)	年 0.8400% (税抜 0.80%)	

- ④ 前③の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から收受した後、販売会社に支払われます。
- ⑤ 委託会社は、「世界 R E I T マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を支払うものとし、その額は当該マザーファンドの日々の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年 3 月 9 日および 9 月 9 日または信託終了のときに行なうものとします。

275 億円以下の部分	年 0.57%
275 億円超 1,500 億円以下の部分	年 0.47%
1,500 億円超 3,000 億円以下の部分	年 0.37%
3,000 億円超の部分	年 0.30%

- ⑥ 販売会社は、各ファンドにおいて、その收受した信託報酬の一部（毎年、各ファンドごとに、8 月決算日時点の純資産総額の 0.05% 程度）を、地方公共団体、社会的課題に取り組む団体、社会貢献活動を行なっている非営利団体等に寄付を行ない、当該団体等を通じて各地域の発展に貢献いたします。寄付先・寄付金額については運用報告書等において受益者に報告します。ただし、将来的には状況によって寄付金額等が変更になることがあります。

(4) その他の手数料等

- ① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。
- ② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要な費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。
- ④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

<マザーファンドより支弁する手数料等>

各マザーファンドの投資対象等に応じて、売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5) 課税上の取扱い

① 個人の受益者に対する課税

個人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金には課税されません。なお、確定申告を行ない、総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、株式の売買益との通算が可能となります。

なお、上記の10%（所得税7%および地方税3%）の税率は、平成21年4月1日から、20%（所得税15%および地方税5%）となります。

② 法人の受益者に対する課税

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、平成21年3月31日までは7%（所得税7%）、平成21年4月1日から15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金には課税されません。

なお、税額控除制度が適用されます。益金不算入制度の適用はありません。

<注1> 個別元本について

① 受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

② 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行なうつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

③ 受益者が特別分配金を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「特別分配金」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

② 受益者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

（注）税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

5 運用状況

りそな・東京応援・資産分散ファンド

(1) 投資状況 (平成19年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	17,867,002,549	98.08
内 日本	17,867,002,549	98.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	349,689,327	1.92
純資産総額	18,216,691,876	100.00

(参考) 東京応援マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	5,842,236,750	98.21
内 日本	5,842,236,750	98.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	106,427,314	1.79
純資産総額	5,948,664,064	100.00

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	235,817,747,487	98.10
内 オーストラリア	31,388,190,499	13.06
内 カナダ	30,922,422,497	12.86
内 デンマーク	3,426,474,927	1.43
内 ユーロ	57,989,333,562	24.12
内 英国	44,393,321,455	18.47
内 ノルウェー	4,885,469,850	2.03
内 スウェーデン	7,029,050,167	2.92
内 米国	55,783,484,530	23.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,568,189,866	1.90
純資産総額	240,385,937,353	100.00

(参考) 世界REITマザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	227,516,677,676	96.22
内 オーストラリア	33,724,219,743	14.26
内 カナダ	7,568,251,422	3.20
内 ユーロ	29,270,433,171	12.38
内 英国	33,589,037,814	14.21
内 香港	7,611,722,265	3.22
内 ニュージーランド	2,016,935,516	0.85
内 シンガポール	5,714,560,841	2.42
内 米国	108,021,516,904	45.69
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,930,836,000	3.78
純資産総額	236,447,513,676	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引 (買建)	24,324,253	0.01
内 日本	24,324,253	0.01
為替予約取引 (売建)	24,288,036	△0.01
内 日本	24,288,036	△0.01

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産(平成19年9月28日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位:円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	世界REITマザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	4,653,304,051	1.23020 5,724,494,643	1.2955 6,028,355,398	— —	33.09%
2	東京応援マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	5,735,751,288	0.97389 5,586,048,179	1.0371 5,948,547,660	— —	32.65%
3	ハイグレード・ソブリン・マザーフ ァンド 日本	親投資信託 受益証券 —	5,126,283,282	1.13310 5,808,592,027	1.1490 5,890,099,491	— —	32.33%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.08%
合計	98.08%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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) 東京応援マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	57,800	5,010 289,578,000	5,510 318,478,000	— —	5.35%
2	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	328	865,000 283,720,000	906,000 297,168,000	— —	5.00%
3	国際石油開発帝石 日本	株式 鉱業	244	1,060,000 258,640,000	1,180,000 287,920,000	— —	4.84%
4	三井不動産 日本	株式 不動産業	90,000	3,110 279,900,000	3,190 287,100,000	— —	4.83%
5	キヤノン 日本	株式 電気機器	43,400	6,180 268,212,000	6,270 272,118,000	— —	4.57%
6	新日本製鐵 日本	株式 鉄鋼	326,000	824 268,624,000	827 269,602,000	— —	4.53%
7	本田技研 日本	株式 輸送用機器	69,000	4,000 276,000,000	3,860 266,340,000	— —	4.48%
8	ソニー 日本	株式 電気機器	47,300	5,730 271,029,000	5,570 263,461,000	— —	4.43%
9	野村ホールディングス 日本	株式 証券・商品先 物取引業	130,000	2,065 268,450,000	1,926 250,380,000	— —	4.21%
10	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,510	166,000 250,660,000	164,000 247,640,000	— —	4.16%
11	住友不動産 日本	株式 不動産業	59,000	3,880 228,920,000	4,040 238,360,000	— —	4.01%
12	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	110,900	2,540 281,686,000	2,120 235,108,000	— —	3.95%
13	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	232	1,160,000 269,120,000	1,003,000 232,696,000	— —	3.91%
14	HOYA 日本	株式 精密機器	54,300	3,920 212,856,000	3,920 212,856,000	— —	3.58%
15	エーザイ 日本	株式 医薬品	37,000	5,110 189,070,000	5,430 200,910,000	— —	3.38%
16	NTTデータ 日本	株式 情報・通信業	350	511,000 178,850,000	512,000 179,200,000	— —	3.01%
17	損害保険ジャパン 日本	株式 保険業	123,000	1,350 166,050,000	1,318 162,114,000	— —	2.73%
18	セコム 日本	株式 サービス業	29,100	5,260 153,066,000	5,530 160,923,000	— —	2.71%
19	いすゞ自動車 日本	株式 輸送用機器	212,000	601 127,412,000	658 139,496,000	— —	2.34%
20	日立建機 日本	株式 機械	24,500	4,180 102,410,000	4,590 112,455,000	— —	1.89%
21	住友重機械 日本	株式 機械	76,000	1,495 113,620,000	1,479 112,404,000	— —	1.89%
22	アサヒビール 日本	株式 食料品	60,400	1,705 102,982,000	1,750 105,700,000	— —	1.78%

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
23	大正製薬 日本	株式 医薬品	40,000	2,355 94,200,000	2,260 90,400,000	— —	1.52%
24	日本航空 日本	株式 空運業	341,000	248 84,568,000	249 84,909,000	— —	1.43%
25	レオパレス21 日本	株式 不動産業	19,900	3,680 73,232,000	3,770 75,023,000	— —	1.26%
26	クレディセゾン 日本	株式 その他金融 業	22,600	2,840 64,184,000	2,960 66,896,000	— —	1.12%
27	IHI 日本	株式 機械	183,000	461 84,363,000	361 66,063,000	— —	1.11%
28	スタンレー電気 日本	株式 電気機器	23,500	2,620 61,570,000	2,770 65,095,000	— —	1.09%
29	丸井 日本	株式 小売業	46,000	1,374 63,204,000	1,268 58,328,000	— —	0.98%
30	東武鉄道 日本	株式 陸運業	107,000	535 57,245,000	540 57,780,000	— —	0.97%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.21%
合計	98.21%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
鉱業	4.84%
建設業	0.11%
食料品	1.88%
繊維製品	0.03%
化学	0.93%
医薬品	10.25%
鉄鋼	4.53%
非鉄金属	0.57%
機械	5.65%
電気機器	10.82%
輸送用機器	7.08%
精密機器	3.98%
その他製品	0.58%
陸運業	5.97%
空運業	1.43%
情報・通信業	11.40%
卸売業	0.34%
小売業	1.76%
銀行業	3.91%
証券・商品先物取引業	4.21%
保険業	2.73%
その他金融業	1.12%
不動産業	10.98%

業種	投資比率
サービス業	3.11%
合計	98.21%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	21,642,852,000	130.91 28,333,233,759	129.20 27,962,564,784	8.000000 21/06/07	11.63%
2	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	20,814,612,000	120.41 25,064,112,403	118.67 24,701,740,791	6.250000 24/01/04	10.28%
3	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	15,548,421,000	134.12 20,853,652,337	132.51 20,603,990,088	8.125000 21/05/15	8.57%
4	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND オーストラリア	国債証券 —	17,087,365,000	100.45 17,165,796,005	98.82 16,887,271,956	6.000000 17/02/15	7.03%
5	BELGIUM GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	13,609,554,000	124.36 16,926,066,214	122.49 16,670,614,886	8.000000 15/03/28	6.93%
6	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 —	10,387,629,000	156.63 16,270,662,684	154.49 16,048,575,176	9.000000 25/06/01	6.68%
7	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND オーストラリア	国債証券 —	12,218,330,000	92.67 11,323,242,793	92.63 11,317,961,262	5.250000 19/03/15	4.71%
8	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	7,953,127,000	138.89 11,046,098,090	136.85 10,884,570,081	9.000000 18/11/15	4.53%
9	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	7,190,861,000	129.68 9,325,108,545	128.28 9,224,436,491	8.750000 17/08/25	3.84%
10	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	9,328,998,000	97.96 9,139,292,172	97.51 9,097,358,980	3.750000 13/07/04	3.78%
11	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	7,272,090,000	99.60 7,243,183,805	99.60 7,243,074,361	4.125000 12/08/31	3.01%
12	SWEDISH GOVERNMENT BOND スウェーデン	国債証券 —	5,794,164,000	115.14 6,671,978,250	113.94 6,601,870,462	6.750000 14/05/05	2.75%
13	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 —	4,012,092,000	146.23 5,866,923,636	145.26 5,828,004,960	8.000000 27/06/01	2.42%
14	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	5,972,865,000	97.25 5,808,611,213	97.26 5,809,208,499	4.250000 11/03/07	2.42%

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
15	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	3,543,701,000	134.21 4,756,284,608	131.70 4,667,160,528	7.625000 25/02/15	1.94%
16	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND ノルウェー	国債証券 —	4,027,779,000	109.09 4,394,081,172	108.06 4,352,659,654	6.500000 13/05/15	1.81%
17	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	3,058,895,000	133.17 4,073,736,154	132.85 4,064,017,308	8.125000 21/08/15	1.69%
18	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	3,757,740,000	99.61 3,743,423,011	99.55 3,740,980,480	3.750000 09/01/04	1.56%
19	DANISH GOVERNMENT BOND デンマーク	国債証券 —	3,043,299,000	104.53 3,181,455,090	103.36 3,145,797,310	5.000000 13/11/15	1.31%
20	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND オーストラリア	国債証券 —	3,079,995,000	101.44 3,124,346,928	100.08 3,082,582,196	6.250000 15/04/15	1.28%
21	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 —	2,801,547,000	98.39 2,756,470,109	98.15 2,749,774,411	3.750000 11/09/01	1.14%
22	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 —	2,467,206,000	104.12 2,568,977,095	104.06 2,567,596,612	5.250000 12/06/01	1.07%
23	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	2,043,111,000	99.98 2,042,784,102	99.18 2,026,500,508	4.000000 12/11/15	0.84%
24	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	1,633,800,000	101.09 1,651,624,758	99.03 1,618,050,168	4.250000 17/07/04	0.67%
25	SPANISH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	1,192,674,000	120.39 1,435,872,155	117.21 1,397,968,976	6.000000 29/01/31	0.58%
26	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 —	1,187,487,000	99.96 1,187,112,884	100.07 1,188,413,240	4.250000 09/09/01	0.49%
27	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 —	807,030,000	141.05 1,138,372,307	139.32 1,124,378,407	8.000000 23/06/01	0.47%
28	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	1,038,870,000	99.98 1,038,662,226	100.07 1,039,680,319	4.000000 09/08/31	0.43%
29	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	808,010,000	127.29 1,028,564,410	125.01 1,010,133,702	7.250000 22/08/15	0.42%
30	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	772,959,000	100.08 773,637,096	99.77 771,181,194	5.000000 12/03/07	0.32%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.10%
合計	98.10%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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) 世界REITマザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	UNIBAIL-RODAMCO ユーロ	投資証券 —	490,507	27,580 13,528,437,928	29,393 14,417,813,546	— —	6.10%
2	LAND SECURITIES PLC 英国	投資証券 —	2,586,400	4,096 10,595,660,135	3,965 10,256,405,151	— —	4.34%
3	BOSTON PROPERTIES INC 米国	投資証券 —	697,242	11,151 7,775,247,202	11,871 8,277,639,942	— —	3.50%
4	WESTFIELD GROUP オーストラリア	投資証券 —	3,393,720	2,190 7,434,138,799	2,187 7,423,789,650	— —	3.14%
5	BRITISH LAND CO PLC 英国	投資証券 —	2,493,248	2,869 7,153,920,118	2,796 6,972,882,140	— —	2.95%
6	HOST HOTELS&RESORTS INC 米国	投資証券 —	2,625,800	2,474 6,496,867,124	2,594 6,813,600,193	— —	2.88%
7	VORNADO REALTY TRUST 米国	投資証券 —	508,633	12,051 6,129,623,003	12,661 6,440,065,224	— —	2.72%
8	LIBERTY PROPERTY TRUST 米国	投資証券 —	1,282,198	4,425 5,674,477,774	4,614 5,917,204,523	— —	2.50%
9	EQUITY RESIDENTIAL 米国	投資証券 —	1,124,734	4,590 5,163,261,374	5,005 5,629,344,058	— —	2.38%
10	SIMON PROPERTY GROUP INC 米国	投資証券 —	474,300	10,633 5,043,427,122	11,536 5,471,559,993	— —	2.31%
11	FONCIERE DES REGIONS ユーロ	投資証券 —	300,710	17,326 5,210,236,479	16,785 5,047,616,179	— —	2.13%
12	HAMMERSON PLC 英国	投資証券 —	1,717,679	2,849 4,894,360,983	2,775 4,767,633,633	— —	2.02%
13	SEGRO 英国	投資証券 —	3,776,846	1,196 4,519,651,934	1,164 4,398,482,975	— —	1.86%
14	MACQUARIE COUNTRYWIDE TRU オーストラリア	投資証券 —	20,761,736	209 4,347,486,757	206 4,284,173,843	— —	1.81%
15	MACQUARIE DDR TRUST オーストラリア	投資証券 —	34,417,400	122 4,215,727,096	120 4,163,249,165	— —	1.76%
16	GPT GROUP オーストラリア	投資証券 —	7,906,710	502 3,971,593,343	509 4,026,622,528	— —	1.70%
17	TISHMAN SPEYER OFFICE FUN オーストラリア	投資証券 —	17,140,000	237 4,076,937,540	228 3,920,132,250	— —	1.66%
18	DEVELOPERS DIV REALTY 米国	投資証券 —	553,367	6,064 3,356,000,529	6,489 3,591,061,091	— —	1.52%
19	VENTAS INC 米国	投資証券 —	665,807	4,379 2,915,844,630	4,819 3,208,658,759	— —	1.36%

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
20	LINK REIT 香港	投資証券 —	12,041,500	241 2,902,675,824	253 3,056,768,491	— —	1.29%
21	UDR INC 米国	投資証券 —	1,061,942	2,751 2,922,407,936	2,844 3,020,370,339	— —	1.28%
22	PRIMARIS RETAIL REAL ESTA カナダ	投資証券 —	1,362,475	2,079 2,833,718,559	2,123 2,893,408,861	— —	1.22%
23	MACK-CALI REALTY CORP 米国	投資証券 —	587,100	4,699 2,758,874,077	4,788 2,811,056,170	— —	1.19%
24	STRATEGIC HOTELS&RESORTS 米国	投資証券 —	1,155,217	2,401 2,774,497,765	2,414 2,789,612,929	— —	1.18%
25	SOVRAN SELF STORAGE INC 米国	投資証券 —	520,693	5,003 2,605,490,756	5,327 2,773,780,816	— —	1.17%
26	BRIXTON PLC 英国	投資証券 —	3,012,687	898 2,707,623,849	851 2,566,491,514	— —	1.09%
27	CORIO NV ユーロ	投資証券 —	253,121	8,629 2,184,366,292	9,810 2,483,362,284	— —	1.05%
28	ING OFFICE FUND オーストラリア	投資証券 —	13,669,642	182 2,501,134,397	179 2,452,501,228	— —	1.04%
29	CAPITACOMMERCIAL TRUST シンガポール	投資証券 —	11,478,000	203 2,338,295,864	212 2,436,095,311	— —	1.03%
30	DB RREEF TRUST オーストラリア	投資証券 —	11,619,300	198 2,303,148,598	209 2,433,069,801	— —	1.03%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.22%
合計	96.22%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2007年10月	売建	210,505	24,298,562	24,288,036	△0.01%
		英ポンド買/円売 2007年10月	買建	103,897	24,298,562	24,324,253	0.01%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(3) 運用実績

① 純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
設定時 (平成18年9月27日)	6,521,117,018	—	1.0000	—
平成18年9月末日	6,774,486,033	—	1.0131	—
10月末日	8,456,292,236	—	1.0266	—
11月末日	9,265,143,908	—	1.0385	—
12月末日	10,449,100,644	—	1.0334	—
平成19年1月末日	13,382,629,079	—	1.0271	—
第1特定期間末 (平成19年2月13日)	14,238,477,772	14,687,619,751	1.0108	1.0427
2月末日	17,091,497,229	—	0.9902	—
3月末日	20,325,377,510	—	0.9775	—
4月末日	21,309,023,448	—	0.9967	—
5月末日	21,449,688,600	—	1.0081	—
6月末日	20,741,480,465	—	0.9996	—
7月末日	18,735,132,914	—	0.9416	—
第2特定期間末 (平成19年8月13日)	18,437,950,983	18,477,621,631	0.9296	0.9316
8月末日	18,139,762,742	—	0.9231	—
9月末日	18,216,691,876	—	0.9398	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.1000
第2特定期間	0.0120

③ 収益率の推移

	収益率(%)
第1特定期間	11.1
第2特定期間	△6.8

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

りそな・埼玉応援・資産分散ファンド

(1) 投資状況 (平成19年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	8,109,729,710	98.16
内 日本	8,109,729,710	98.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	152,327,947	1.84
純資産総額	8,262,057,657	100.00

(参考) 埼玉応援マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	2,507,356,500	97.81
内 日本	2,507,356,500	97.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	56,246,748	2.19
純資産総額	2,563,603,248	100.00

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(2) 投資資産(平成19年9月28日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位:円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	世界REITマザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	2,146,422,841	1.23020 2,640,529,378	1.2955 2,780,690,790	— —	33.66%
2	ハイグレード・ソブリン・マザー ファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	2,406,902,362	1.13310 2,727,261,068	1.1490 2,765,530,813	— —	33.47%
3	埼玉応援マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	2,777,064,357	0.87840 2,439,373,331	0.9231 2,563,508,107	— —	31.03%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.16%
合計	98.16%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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) 埼玉応援マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	東芝 日本	株式 電気機器	132,000	1,090 143,880,000	1,073 141,636,000	— —	5.52%
2	SMC 日本	株式 機械	8,300	15,290 126,907,000	15,730 130,559,000	— —	5.09%
3	ヤマダ電機 日本	株式 小売業	11,000	11,640 128,040,000	11,370 125,070,000	— —	4.88%
4	本田技研 日本	株式 輸送用機器	31,900	4,000 127,600,000	3,860 123,134,000	— —	4.80%
5	しまむら 日本	株式 小売業	10,800	11,180 120,744,000	10,750 116,100,000	— —	4.53%
6	武蔵野銀行 日本	株式 銀行業	19,800	5,500 108,900,000	5,450 107,910,000	— —	4.21%
7	三菱マテリアル 日本	株式 非鉄金属	144,000	639 92,016,000	714 102,816,000	— —	4.01%
8	島忠 日本	株式 小売業	29,600	3,490 103,304,000	3,040 89,984,000	— —	3.51%
9	りそなホールディングス 日本	株式 銀行業	450	239,000 107,550,000	197,000 88,650,000	— —	3.46%
10	大正製薬 日本	株式 医薬品	37,000	2,355 87,135,000	2,260 83,620,000	— —	3.26%
11	アドバンテスト 日本	株式 電気機器	23,000	4,680 107,640,000	3,580 82,340,000	— —	3.21%
12	テイ・エス テック 日本	株式 輸送用機器	16,100	4,620 74,382,000	4,360 70,196,000	— —	2.74%
13	キャノン電子 日本	株式 電気機器	23,900	3,150 75,285,000	2,935 70,146,500	— —	2.74%
14	タムロン 日本	株式 精密機器	15,700	3,550 55,735,000	4,250 66,725,000	— —	2.60%
15	アイチ コーポレーション 日本	株式 機械	45,700	1,352 61,786,400	1,401 64,025,700	— —	2.50%
16	ショーワ 日本	株式 輸送用機器	43,800	1,519 66,532,200	1,369 59,962,200	— —	2.34%
17	ワコム 日本	株式 電気機器	241	244,000 58,804,000	238,000 57,358,000	— —	2.24%
18	東武鉄道 日本	株式 陸運業	99,000	535 52,965,000	540 53,460,000	— —	2.09%
19	サイゼリヤ 日本	株式 小売業	30,100	1,740 52,374,000	1,736 52,253,600	— —	2.04%
20	曙ブレーキ 日本	株式 輸送用機器	64,000	780 49,920,000	737 47,168,000	— —	1.84%
21	サンケン電気 日本	株式 電気機器	72,000	885 63,720,000	563 40,536,000	— —	1.58%

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
22	伊勢丹 日本	株式 小売業	25,900	1,836 47,552,400	1,549 40,119,100	— —	1.56%
23	安川電機 日本	株式 電気機器	28,000	1,417 39,676,000	1,431 40,068,000	— —	1.56%
24	三国コカ・コーラ 日本	株式 食料品	30,800	1,195 36,806,000	1,284 39,547,200	— —	1.54%
25	ベルーナ 日本	株式 小売業	31,900	1,299 41,438,100	1,166 37,195,400	— —	1.45%
26	ヤオコー 日本	株式 小売業	11,500	2,890 33,235,000	2,985 34,327,500	— —	1.34%
27	三井金属 日本	株式 非鉄金属	66,000	493 32,538,000	495 32,670,000	— —	1.27%
28	ツツミ 日本	株式 その他製品	11,600	2,765 32,074,000	2,790 32,364,000	— —	1.26%
29	ボッシュ 日本	株式 輸送用機器	52,000	566 29,432,000	558 29,016,000	— —	1.13%
30	クラリオン 日本	株式 電気機器	163,000	166 27,058,000	149 24,287,000	— —	0.95%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.81%
合計	97.81%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	0.14%
食料品	1.54%
繊維製品	0.15%
化学	1.09%
医薬品	3.26%
ゴム製品	0.39%
鉄鋼	0.17%
非鉄金属	5.66%
金属製品	0.90%
機械	9.16%
電気機器	20.38%
輸送用機器	14.79%
精密機器	4.11%
その他製品	2.04%
陸運業	2.63%
小売業	22.90%
銀行業	7.67%
サービス業	0.83%
合計	97.81%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(3) 運用実績

① 純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
設定時 (平成18年9月27日)	4,114,198,196	—	1.0000	—
平成18年9月末日	4,279,568,657	—	1.0122	—
10月末日	5,173,266,323	—	1.0175	—
11月末日	5,658,608,989	—	1.0333	—
12月末日	6,737,591,551	—	1.0305	—
平成19年1月末日	8,381,898,515	—	1.0215	—
第1特定期間末 (平成19年2月13日)	8,708,411,726	8,810,819,834	1.0109	1.0228
2月末日	9,060,394,360	—	0.9955	—
3月末日	9,409,139,865	—	0.9851	—
4月末日	9,596,960,931	—	1.0008	—
5月末日	9,532,218,263	—	1.0009	—
6月末日	9,443,117,982	—	1.0107	—
7月末日	8,536,072,992	—	0.9526	—
第2特定期間末 (平成19年8月13日)	8,354,909,030	8,372,772,218	0.9354	0.9374
8月末日	8,209,755,130	—	0.9216	—
9月末日	8,262,057,657	—	0.9318	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0720
第2特定期間	0.0120

③ 収益率の推移

	収益率(%)
第1特定期間	8.3
第2特定期間	△6.3

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

りそな・多摩応援・資産分散ファンド

(1) 投資状況 (平成19年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,607,192,461	97.14
内 日本	2,607,192,461	97.14
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	76,775,411	2.86
純資産総額	2,683,967,872	100.00

(参考) 多摩応援マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	813,027,400	96.27
内 日本	813,027,400	96.27
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	31,523,206	3.73
純資産総額	844,550,606	100.00

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(2) 投資資産(平成19年9月28日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位:円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	世界REITマザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	681,945,859	1.23019 838,929,795	1.2955 883,460,860	— —	32.92%
2	ハイグレード・ソブリン・マザーフ ァンド 日本	親投資信託 受益証券 —	765,172,978	1.13310 867,017,502	1.1490 879,183,751	— —	32.76%
3	多摩応援マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	901,620,423	0.90510 816,057,361	0.9367 844,547,850	— —	31.47%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.14%
合計	97.14%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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) 多摩応援マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	日野自動車 日本	株式 輸送用機器	50,000	780 39,000,000	878 43,900,000	— —	5.20%
2	JUKI 日本	株式 機械	40,000	1,005 40,200,000	1,094 43,760,000	— —	5.18%
3	ミツミ電機 日本	株式 電気機器	9,300	4,307 40,056,751	4,690 43,617,000	— —	5.16%
4	シチズンホールディングス 日本	株式 精密機器	37,500	1,141 42,787,500	1,156 43,350,000	— —	5.13%
5	サンドラッグ 日本	株式 小売業	16,500	2,575 42,487,500	2,615 43,147,500	— —	5.11%
6	横河電機 日本	株式 電気機器	28,200	1,583 44,653,290	1,398 39,423,600	— —	4.67%
7	京王電鉄 日本	株式 陸運業	55,000	737 40,535,000	716 39,380,000	— —	4.66%
8	立飛企業 日本	株式 不動産業	5,400	6,687 36,114,671	6,790 36,666,000	— —	4.34%
9	東京精密 日本	株式 精密機器	13,500	3,514 47,442,125	2,390 32,265,000	— —	3.82%
10	ケンウッド 日本	株式 電気機器	140,000	162 22,786,625	162 22,680,000	— —	2.69%
11	日本マイクロニクス 日本	株式 電気機器	7,600	3,867 29,393,428	2,730 20,748,000	— —	2.46%
12	フオスター電機 日本	株式 電気機器	9,000	1,717 15,453,000	2,055 18,495,000	— —	2.19%
13	いなげや 日本	株式 小売業	20,000	904 18,085,906	911 18,220,000	— —	2.16%
14	アロカ 日本	株式 電気機器	11,500	1,447 16,640,500	1,545 17,767,500	— —	2.10%
15	飯田産業 日本	株式 不動産業	12,000	1,782 21,384,386	1,473 17,676,000	— —	2.09%
16	昭和飛行機 日本	株式 輸送用機器	13,000	1,431 18,603,000	1,332 17,316,000	— —	2.05%
17	よみうりランド 日本	株式 サービス業	32,000	571 18,297,991	502 16,064,000	— —	1.90%
18	アーネストワン 日本	株式 不動産業	24,500	687 16,831,500	653 15,998,500	— —	1.89%
19	新川 日本	株式 機械	7,600	2,340 17,784,000	2,105 15,998,000	— —	1.89%
20	新立川航空機 日本	株式 機械	4,100	3,330 13,653,000	3,520 14,432,000	— —	1.71%
21	日本電子 日本	株式 電気機器	30,000	633 19,000,984	436 13,080,000	— —	1.55%

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
22	タチエス 日本	株式 輸送用機器	13,500	1,009 13,621,500	910 12,285,000	— —	1.45%
23	シダックス 日本	株式 サービス業	150	77,882 11,682,414	78,300 11,745,000	— —	1.39%
24	東栄住宅 日本	株式 不動産業	10,200	1,412 14,402,400	1,112 11,342,400	— —	1.34%
25	わらべや日洋 日本	株式 食料品	6,400	1,463 9,363,200	1,680 10,752,000	— —	1.27%
26	ジャムコ 日本	株式 輸送用機器	10,000	1,200 12,000,000	1,025 10,250,000	— —	1.21%
27	松屋フーズ 日本	株式 小売業	7,200	1,395 10,044,000	1,376 9,907,200	— —	1.17%
28	富士通フロンテック 日本	株式 電気機器	9,500	933 8,863,500	1,021 9,699,500	— —	1.15%
29	セイジョー 日本	株式 小売業	4,000	2,520 10,080,000	2,350 9,400,000	— —	1.11%
30	共立 日本	株式 機械	26,000	348 9,048,000	335 8,710,000	— —	1.03%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.27%
合計	96.27%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
食料品	1.27%
繊維製品	0.64%
パルプ・紙	0.23%
化学	0.28%
ガラス・土石製品	0.21%
金属製品	1.68%
機械	11.64%
電気機器	24.45%
輸送用機器	10.53%
精密機器	9.90%
その他製品	0.15%
陸運業	5.09%
倉庫・運輸関連業	0.68%
情報・通信業	0.61%
卸売業	0.53%
小売業	12.73%
不動産業	11.40%
サービス業	4.25%
合計	96.27%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(3) 運用実績

① 純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
設定時 (平成18年9月27日)	3,319,368,889	—	1.0000	—
平成18年9月末日	3,358,602,030	—	1.0099	—
10月末日	3,527,632,559	—	1.0108	—
11月末日	3,592,307,145	—	1.0235	—
12月末日	3,361,195,050	—	1.0305	—
平成19年1月末日	3,338,025,682	—	1.0268	—
第1特定期間末 (平成19年2月13日)	3,300,944,086	3,382,179,290	1.0109	1.0357
2月末日	3,290,459,464	—	0.9959	—
3月末日	3,308,712,198	—	0.9822	—
4月末日	3,338,925,875	—	1.0017	—
5月末日	3,212,882,456	—	0.9934	—
6月末日	3,090,068,277	—	0.9993	—
7月末日	2,791,587,742	—	0.9539	—
第2特定期間末 (平成19年8月13日)	2,735,694,986	2,741,534,274	0.9370	0.9390
8月末日	2,684,453,047	—	0.9256	—
9月末日	2,683,967,872	—	0.9334	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0760
第2特定期間	0.0120

③ 収益率の推移

	収益率(%)
第1特定期間	8.7
第2特定期間	△6.1

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

りそな・神奈川応援・資産分散ファンド

(1) 投資状況 (平成19年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,763,436,309	98.16
内 日本	1,763,436,309	98.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	33,129,027	1.84
純資産総額	1,796,565,336	100.00

(参考) 神奈川応援マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	563,579,700	96.98
内 日本	563,579,700	96.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	17,538,458	3.02
純資産総額	581,118,158	100.00

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(2) 投資資産(平成19年9月28日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位:円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	世界REITマザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	457,313,617	1.23020 562,587,211	1.2955 592,449,790	— —	32.98%
2	ハイグレード・ソブリン・マザーフ ァンド 日本	親投資信託 受益証券 —	513,366,338	1.13310 581,695,398	1.1490 589,857,922	— —	32.83%
3	神奈川応援マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	630,633,313	0.86550 545,813,132	0.9215 581,128,597	— —	32.35%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.16%
合計	98.16%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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) 神奈川応援マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	NECエレクトロニクス 日本	株式 電気機器	9,200	3,460 31,832,000	3,300 30,360,000	— —	5.22%
2	富士通 日本	株式 電気機器	36,000	726 26,136,000	812 29,232,000	— —	5.03%
3	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	24,900	1,211 30,153,900	1,151 28,659,900	— —	4.93%
4	横浜銀行 日本	株式 銀行業	35,000	837 29,295,000	793 27,755,000	— —	4.78%
5	アマダ 日本	株式 機械	21,000	1,240 26,040,000	1,284 26,964,000	— —	4.64%
6	富士電機HLDGS 日本	株式 電気機器	52,000	445 23,140,000	512 26,624,000	— —	4.58%
7	日揮 日本	株式 建設業	12,000	2,280 27,360,000	2,215 26,580,000	— —	4.57%
8	千代田化工建 日本	株式 建設業	12,000	2,030 24,360,000	2,070 24,840,000	— —	4.27%
9	東邦チタニウム 日本	株式 非鉄金属	5,400	4,820 26,028,000	4,220 22,788,000	— —	3.92%
10	日本発条 日本	株式 金属製品	22,000	983 21,626,000	876 19,272,000	— —	3.32%
11	相模鉄道 日本	株式 陸運業	38,000	395 15,010,000	404 15,352,000	— —	2.64%
12	アルバック 日本	株式 電気機器	3,800	4,620 17,556,000	3,720 14,136,000	— —	2.43%
13	光栄 日本	株式 情報・通信業	6,100	2,020 12,322,000	2,200 13,420,000	— —	2.31%
14	ニフコ 日本	株式 化学	4,800	2,575 12,360,000	2,750 13,200,000	— —	2.27%
15	日立ソフトウェア 日本	株式 情報・通信業	5,800	2,500 14,500,000	2,190 12,702,000	— —	2.19%
16	東京応化工業 日本	株式 化学	4,200	2,410 10,122,000	2,485 10,437,000	— —	1.80%
17	東芝プラントシステム 日本	株式 建設業	9,000	1,020 9,180,000	1,117 10,053,000	— —	1.73%
18	アマノ 日本	株式 機械	7,200	1,468 10,569,600	1,389 10,000,800	— —	1.72%
19	関東自動車 日本	株式 輸送用機器	6,400	1,573 10,067,200	1,550 9,920,000	— —	1.71%
20	日産車体 日本	株式 輸送用機器	14,000	679 9,506,000	707 9,898,000	— —	1.70%
21	ファンケル 日本	株式 化学	6,300	1,676 10,558,800	1,496 9,424,800	— —	1.62%

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
22	岡村製作所 日本	株式 その他製品	10,000	956 9,560,000	903 9,030,000	— —	1.55%
23	富士ソフト 日本	株式 情報・通信業	3,400	2,385 8,109,000	2,350 7,990,000	— —	1.37%
24	スルガコーポレーション 日本	株式 建設業	3,400	2,095 7,123,000	2,100 7,140,000	— —	1.23%
25	サカタのタネ 日本	株式 水産・農林業	4,600	1,504 6,918,400	1,547 7,116,200	— —	1.22%
26	コココーラセントラルジャパン 日本	株式 食料品	8	903,000 7,224,000	883,000 7,064,000	— —	1.22%
27	新興プランテック 日本	株式 建設業	4,000	1,336 5,344,000	1,664 6,656,000	— —	1.15%
28	アンリツ 日本	株式 電気機器	11,000	532 5,852,000	484 5,324,000	— —	0.92%
29	アイダエンジニア 日本	株式 機械	7,000	764 5,348,000	738 5,166,000	— —	0.89%
30	プレス工業 日本	株式 輸送用機器	10,000	456 4,560,000	477 4,770,000	— —	0.82%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.98%
合計	96.98%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	1.22%
建設業	12.95%
食料品	1.83%
繊維製品	0.49%
化学	6.06%
石油・石炭製品	0.34%
ガラス・土石製品	0.41%
非鉄金属	3.92%
金属製品	4.17%
機械	8.90%
電気機器	23.27%
輸送用機器	10.58%
その他製品	1.55%
陸運業	4.18%
倉庫・運輸関連業	0.98%
情報・通信業	6.91%
卸売業	2.09%
小売業	2.00%
銀行業	4.78%
不動産業	0.33%
合計	96.98%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(3) 運用実績

① 純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
設定時 (平成18年9月27日)	2,156,421,034	—	1.0000	—
平成18年9月末日	2,231,987,321	—	1.0127	—
10月末日	2,360,313,753	—	1.0134	—
11月末日	2,431,405,448	—	1.0286	—
12月末日	2,339,631,771	—	1.0281	—
平成19年1月末日	2,290,618,245	—	1.0282	—
第1特定期間末 (平成19年2月13日)	2,266,666,805	2,315,779,504	1.0104	1.0323
2月末日	2,212,326,651	—	0.9935	—
3月末日	2,126,835,007	—	0.9767	—
4月末日	2,152,712,307	—	0.9927	—
5月末日	2,118,575,245	—	0.9975	—
6月末日	2,039,966,215	—	1.0014	—
7月末日	1,859,716,209	—	0.9480	—
第2特定期間末 (平成19年8月13日)	1,808,360,623	1,812,264,347	0.9265	0.9285
8月末日	1,779,243,893	—	0.9157	—
9月末日	1,796,565,336	—	0.9311	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0700
第2特定期間	0.0120

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

③ 収益率の推移

	収益率(%)
第1特定期間	8.0
第2特定期間	△7.1

りそな・中部応援・資産分散ファンド

(1) 投資状況 (平成19年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	8,429,225,561	98.20
内 日本	8,429,225,561	98.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	154,743,045	1.80
純資産総額	8,583,968,606	100.00

(参考) 中部応援マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	2,771,052,800	97.79
内 日本	2,771,052,800	97.79
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	62,498,080	2.21
純資産総額	2,833,550,880	100.00

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(2) 投資資産(平成19年9月28日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位:円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	中部応援マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	2,575,704,874	1.03790 2,673,324,088	1.1001 2,833,532,931	— —	33.01%
2	ハイグレード・ソブリン・マザーフ ファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	2,439,571,643	1.13310 2,764,278,629	1.1490 2,803,067,817	— —	32.65%
3	世界REITマザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	2,155,634,746	1.23019 2,651,861,864	1.2955 2,792,624,813	— —	32.53%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.20%
合計	98.20%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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) 中部応援マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	スズキ 日本	株式 輸送用機器	42,100	3,210 135,141,000	3,400 143,140,000	— —	5.05%
2	ファナック 日本	株式 電気機器	12,100	12,140 146,894,000	11,710 141,691,000	— —	5.00%
3	デンソー 日本	株式 輸送用機器	29,700	4,260 126,522,000	4,330 128,601,000	— —	4.54%
4	イビデン 日本	株式 電気機器	13,200	9,030 119,196,000	9,670 127,644,000	— —	4.50%
5	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	102	1,150,000 117,300,000	1,220,000 124,440,000	— —	4.39%
6	日本碍子 日本	株式 ガラス・土石 製品	33,000	3,750 123,750,000	3,700 122,100,000	— —	4.31%
7	アイシン精機 日本	株式 輸送用機器	25,900	4,530 117,327,000	4,590 118,881,000	— —	4.20%
8	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	17,400	7,070 123,018,000	6,780 117,972,000	— —	4.16%
9	豊田自動織機 日本	株式 輸送用機器	23,400	5,160 120,744,000	4,950 115,830,000	— —	4.09%
10	中部電力 日本	株式 電気・ガス業	37,900	3,310 125,449,000	2,975 112,752,500	— —	3.98%
11	豊田通商 日本	株式 卸売業	31,000	3,050 94,550,000	3,050 94,550,000	— —	3.34%
12	ヤマハ発動機 日本	株式 輸送用機器	25,100	3,200 80,320,000	2,930 73,543,000	— —	2.60%
13	静岡銀行 日本	株式 銀行業	61,000	1,189 72,529,000	1,116 68,076,000	— —	2.40%
14	トヨタ紡織 日本	株式 輸送用機器	16,500	3,310 54,615,000	3,880 64,020,000	— —	2.26%
15	マキタ 日本	株式 機械	12,600	4,680 58,968,000	5,040 63,504,000	— —	2.24%
16	ジェイテクト 日本	株式 機械	27,100	1,922 52,086,200	2,025 54,877,500	— —	1.94%
17	セイコーエプソン 日本	株式 電気機器	17,300	3,110 53,803,000	2,845 49,218,500	— —	1.74%
18	ヤマハ 日本	株式 その他製品	18,200	2,540 46,228,000	2,575 46,865,000	— —	1.65%
19	豊田合成 日本	株式 輸送用機器	11,100	3,790 42,069,000	4,160 46,176,000	— —	1.63%
20	日本特殊陶業 日本	株式 ガラス・土石 製品	22,000	2,000 44,000,000	1,785 39,270,000	— —	1.39%
21	八十二銀行 日本	株式 銀行業	46,000	887 40,802,000	827 38,042,000	— —	1.34%

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
22	ブラザー工業 日本	株式 電気機器	25,200	1,415 35,658,000	1,470 37,044,000	— —	1.31%
23	大同特殊鋼 日本	株式 鉄鋼	36,000	868 31,248,000	979 35,244,000	— —	1.24%
24	スルガ銀行 日本	株式 銀行業	25,000	1,520 38,000,000	1,403 35,075,000	— —	1.24%
25	スズケン 日本	株式 卸売業	8,500	3,520 29,920,000	3,870 32,895,000	— —	1.16%
26	新光電気工業 日本	株式 電気機器	11,700	2,685 31,414,500	2,550 29,835,000	— —	1.05%
27	オークマ 日本	株式 機械	17,000	1,731 29,427,000	1,676 28,492,000	— —	1.01%
28	東邦瓦斯 日本	株式 電気・ガス業	49,000	602 29,498,000	567 27,783,000	— —	0.98%
29	ミネベア 日本	株式 電気機器	35,000	690 24,150,000	786 27,510,000	— —	0.97%
30	東海理化電機 日本	株式 輸送用機器	8,500	3,190 27,115,000	3,200 27,200,000	— —	0.96%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.79%
合計	97.79%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
食料品	0.57%
パルプ・紙	0.38%
化学	0.26%
医薬品	0.37%
ゴム製品	0.78%
ガラス・土石製品	5.93%
鉄鋼	1.72%
非鉄金属	0.39%
金属製品	0.40%
機械	7.00%
電気機器	16.45%
輸送用機器	32.28%
その他製品	1.65%
電気・ガス業	4.96%
陸運業	6.07%
卸売業	4.82%
小売業	3.41%
銀行業	8.85%
サービス業	1.51%
合計	97.79%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(3) 運用実績

① 純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
設定時 (平成18年9月27日)	2,276,149,882	—	1.0000	—
平成18年9月末日	2,320,889,585	—	1.0119	—
10月末日	2,892,925,650	—	1.0281	—
11月末日	3,339,566,953	—	1.0410	—
12月末日	4,722,145,545	—	1.0314	—
平成19年1月末日	6,066,809,629	—	1.0321	—
第1特定期間末 (平成19年2月13日)	6,378,218,910	6,592,301,944	1.0102	1.0441
2月末日	7,932,541,562	—	0.9899	—
3月末日	9,586,087,136	—	0.9771	—
4月末日	10,061,276,979	—	0.9983	—
5月末日	9,977,805,434	—	0.9976	—
6月末日	9,745,469,847	—	1.0069	—
7月末日	8,796,548,360	—	0.9648	—
第2特定期間末 (平成19年8月13日)	8,646,975,093	8,665,126,575	0.9508	0.9527
8月末日	8,525,700,168	—	0.9409	—
9月末日	8,583,968,606	—	0.9595	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.1000
第2特定期間	0.0120

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

③ 収益率の推移

	収益率(%)
第1特定期間	11.0
第2特定期間	△4.7

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) 京都滋賀応援マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	任 天 堂 日本	株式 その他製品	700	53,700 37,590,000	59,800 41,860,000	— —	6.61%
2	日本電産 日本	株式 電気機器	4,700	7,580 35,626,000	8,030 37,741,000	— —	5.96%
3	オムロン 日本	株式 電気機器	10,400	2,960 30,784,000	3,040 31,616,000	— —	4.99%
4	ロ ー ム 日本	株式 電気機器	3,100	9,790 30,349,000	10,150 31,465,000	— —	4.97%
5	村田製作所 日本	株式 電気機器	3,800	8,540 32,452,000	8,280 31,464,000	— —	4.97%
6	日本電気硝子 日本	株式 ガラス・土石 製品	17,000	1,816 30,872,669	1,850 31,450,000	— —	4.97%
7	京都銀行 日本	株式 銀行業	22,000	1,582 34,804,000	1,393 30,646,000	— —	4.84%
8	島津製作所 日本	株式 精密機器	25,000	1,331 33,275,000	1,176 29,400,000	— —	4.64%
9	滋賀銀行 日本	株式 銀行業	37,000	767 28,402,581	791 29,267,000	— —	4.62%
10	堀場製作所 日本	株式 電気機器	6,000	4,463 26,780,967	4,830 28,980,000	— —	4.58%
11	ワコールホールディングス 日本	株式 繊維製品	20,000	1,535 30,700,000	1,411 28,220,000	— —	4.46%
12	京 セ ラ 日本	株式 電気機器	2,600	10,720 27,872,000	10,770 28,002,000	— —	4.42%
13	大日本スクリーン 日本	株式 電気機器	36,000	843 30,370,940	692 24,912,000	— —	3.93%
14	日本写真印刷 日本	株式 その他製品	6,300	3,203 20,183,186	3,340 21,042,000	— —	3.32%
15	宝ホールディングス 日本	株式 食料品	31,000	714 22,152,788	675 20,925,000	— —	3.30%
16	グ ン ゼ 日本	株式 繊維製品	32,000	599 19,192,176	566 18,112,000	— —	2.86%
17	ニチコン 日本	株式 電気機器	10,900	1,599 17,439,974	1,458 15,892,200	— —	2.51%
18	平 和 堂 日本	株式 小売業	8,200	1,913 15,687,487	1,831 15,014,200	— —	2.37%
19	三洋化成 日本	株式 化学	16,000	743 11,888,000	715 11,440,000	— —	1.81%
20	日本新薬 日本	株式 医薬品	10,000	1,072 10,724,104	1,011 10,110,000	— —	1.60%
21	フジテック 日本	株式 機械	13,000	705 9,165,000	758 9,854,000	— —	1.56%

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
22	日新電機 日本	株式 電気機器	15,000	473 7,105,071	530 7,950,000	— —	1.26%
23	オブテックス 日本	株式 電気機器	2,400	2,492 5,982,511	2,565 6,156,000	— —	0.97%
24	ニッセンHD 日本	株式 小売業	8,900	681 6,065,562	659 5,865,100	— —	0.93%
25	日東精工 日本	株式 金属製品	6,000	926 5,556,000	967 5,802,000	— —	0.92%
26	ユーシン精機 日本	株式 機械	2,300	2,041 4,696,459	2,175 5,002,500	— —	0.79%
27	王将フードサービス 日本	株式 小売業	3,300	1,460 4,819,214	1,440 4,752,000	— —	0.75%
28	第一精工 日本	株式 電気機器	2,100	2,080 4,368,000	2,110 4,431,000	— —	0.70%
29	松 風 日本	株式 精密機器	2,200	1,621 3,566,200	1,601 3,522,200	— —	0.56%
30	キヤノンマシナリー 日本	株式 機械	1,100	3,460 3,806,000	3,140 3,454,000	— —	0.55%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.27%
合計	97.27%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	0.28%
食料品	3.30%
繊維製品	8.10%
化学	2.48%
医薬品	1.60%
ガラス・土石製品	4.97%
鉄鋼	0.11%
金属製品	1.49%
機械	3.25%
電気機器	39.87%
輸送用機器	0.48%
精密機器	5.20%
その他製品	10.02%
倉庫・運輸関連業	0.36%
情報・通信業	0.58%
卸売業	0.43%
小売業	4.14%
銀行業	9.96%
サービス業	0.65%
合計	97.27%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(3) 運用実績

① 純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
設定時 (平成18年9月27日)	1,732,622,055	—	1.0000	—
平成18年9月末日	1,755,903,470	—	1.0111	—
10月末日	1,934,658,061	—	1.0157	—
11月末日	2,033,868,703	—	1.0261	—
12月末日	2,186,766,057	—	1.0288	—
平成19年1月末日	2,362,540,155	—	1.0278	—
第1特定期間末 (平成19年2月13日)	2,360,776,220	2,411,921,430	1.0107	1.0326
2月末日	2,411,853,423	—	0.9912	—
3月末日	2,450,951,394	—	0.9827	—
4月末日	2,548,057,316	—	1.0084	—
5月末日	2,549,665,501	—	1.0115	—
6月末日	2,222,484,060	—	1.0161	—
7月末日	2,009,945,781	—	0.9594	—
第2特定期間末 (平成19年8月13日)	1,973,430,580	1,977,620,285	0.9420	0.9440
8月末日	1,945,660,112	—	0.9283	—
9月末日	1,956,924,201	—	0.9419	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0760
第2特定期間	0.0220

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

③ 収益率の推移

	収益率(%)
第1特定期間	8.7
第2特定期間	△4.6

りそな・大阪応援・資産分散ファンド

(1) 投資状況 (平成19年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	11,240,258,784	98.64
内 日本	11,240,258,784	98.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	155,495,135	1.36
純資産総額	11,395,753,919	100.00

(参考) 大阪応援マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	3,748,911,300	98.48
内 日本	3,748,911,300	98.48
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	57,682,514	1.52
純資産総額	3,806,593,814	100.00

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(2) 投資資産(平成19年9月28日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位:円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	大阪応援マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	3,712,617,735	0.96120 3,568,568,166	1.0253 3,806,546,963	— —	33.40%
2	世界REITマザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	2,880,071,452	1.23019 3,543,063,900	1.2955 3,731,132,566	— —	32.74%
3	ハイグレード・ソブリン・マザー ファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	3,222,436,254	1.13310 3,651,342,521	1.1490 3,702,579,255	— —	32.49%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.64%
合計	98.64%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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) 大阪応援マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	武田薬品 日本	株式 医薬品	24,900	7,900 196,710,000	8,080 201,192,000	— —	5.29%
2	商船三井 日本	株式 海運業	100,000	1,623 162,300,000	1,861 186,100,000	— —	4.89%
3	住友金属工業 日本	株式 鉄鋼	272,000	621 168,912,000	670 182,240,000	— —	4.79%
4	シャープ 日本	株式 電気機器	87,000	2,095 182,265,000	2,085 181,395,000	— —	4.77%
5	松下電器産業 日本	株式 電気機器	84,000	2,120 178,080,000	2,155 181,020,000	— —	4.76%
6	伊藤忠 日本	株式 卸売業	127,000	1,238 157,226,000	1,395 177,165,000	— —	4.65%
7	関西電力 日本	株式 電気・ガス業	59,900	2,900 173,710,000	2,625 157,237,500	— —	4.13%
8	ダイキン工業 日本	株式 機械	22,200	4,950 109,890,000	5,530 122,766,000	— —	3.23%
9	住友信託 日本	株式 銀行業	135,000	951 128,385,000	869 117,315,000	— —	3.08%
10	住友電工 日本	株式 非鉄金属	63,700	1,795 114,341,500	1,830 116,571,000	— —	3.06%
11	旭化成 日本	株式 化学	115,000	834 95,910,000	928 106,720,000	— —	2.80%
12	キーエンス 日本	株式 電気機器	4,100	25,560 104,796,000	25,500 104,550,000	— —	2.75%
13	クボタ 日本	株式 機械	106,000	980 103,880,000	946 100,276,000	— —	2.63%
14	りそなホールディングス 日本	株式 銀行業	451	239,000 107,789,000	197,000 88,847,000	— —	2.33%
15	西日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	162	517,000 83,754,000	548,000 88,776,000	— —	2.33%
16	松下電工 日本	株式 電気機器	62,000	1,393 86,366,000	1,385 85,870,000	— —	2.26%
17	積水ハウス 日本	株式 建設業	55,000	1,545 84,975,000	1,446 79,530,000	— —	2.09%
18	大阪瓦斯 日本	株式 電気・ガス業	182,000	428 77,896,000	403 73,346,000	— —	1.93%
19	日東電工 日本	株式 化学	13,700	5,700 78,090,000	5,340 73,158,000	— —	1.92%
20	大和ハウス 日本	株式 建設業	47,000	1,650 77,550,000	1,499 70,453,000	— —	1.85%
21	小野薬品 日本	株式 医薬品	9,800	6,400 62,720,000	6,160 60,368,000	— —	1.59%

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
22	阪急阪神HLDGS 日本	株式 陸運業	102,000	618 63,036,000	587 59,874,000	— —	1.57%
23	ジェイテクト 日本	株式 機械	25,400	1,922 48,818,800	2,025 51,435,000	— —	1.35%
24	近畿鉄道 日本	株式 陸運業	140,000	374 52,360,000	357 49,980,000	— —	1.31%
25	塩野義製薬 日本	株式 医薬品	28,000	1,772 49,616,000	1,771 49,588,000	— —	1.30%
26	ダイハツ 日本	株式 輸送用機器	36,000	1,120 40,320,000	1,193 42,948,000	— —	1.13%
27	帝人 日本	株式 繊維製品	76,000	634 48,184,000	561 42,636,000	— —	1.12%
28	日清食品 日本	株式 食料品	10,200	3,530 36,006,000	4,100 41,820,000	— —	1.10%
29	N T N 日本	株式 機械	37,000	968 35,816,000	1,025 37,925,000	— —	1.00%
30	積水化学 日本	株式 化学	43,000	830 35,690,000	843 36,249,000	— —	0.95%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.48%
合計	98.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	5.33%
食料品	2.58%
繊維製品	1.81%
パルプ・紙	0.43%
化学	9.27%
医薬品	10.41%
ガラス・土石製品	0.55%
鉄鋼	5.38%
非鉄金属	3.06%
機械	8.53%
電気機器	15.15%
輸送用機器	2.35%
その他製品	0.35%
電気・ガス業	6.06%
陸運業	6.19%
海運業	4.89%
倉庫・運輸関連業	0.33%
卸売業	5.05%
小売業	3.23%
銀行業	5.81%
保険業	1.03%

業種	投資比率
その他金融業	0.32%
不動産業	0.38%
合計	98.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(3) 運用実績

① 純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
設定時 (平成18年9月27日)	7,502,409,332	—	1.0000	—
平成18年9月末日	7,701,134,206	—	1.0105	—
10月末日	8,896,090,212	—	1.0228	—
11月末日	9,658,488,773	—	1.0379	—
12月末日	10,447,446,395	—	1.0311	—
平成19年1月末日	11,370,411,941	—	1.0284	—
第1特定期間末 (平成19年2月13日)	11,389,760,687	11,749,521,764	1.0102	1.0421
2月末日	12,011,661,451	—	0.9961	—
3月末日	12,803,411,920	—	0.9817	—
4月末日	13,147,977,536	—	0.9981	—
5月末日	13,180,804,160	—	1.0035	—
6月末日	12,774,680,110	—	0.9979	—
7月末日	11,650,185,271	—	0.9433	—
第2特定期間末 (平成19年8月13日)	11,390,960,365	11,415,462,631	0.9298	0.9318
8月末日	11,214,152,042	—	0.9194	—
9月末日	11,395,753,919	—	0.9422	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0940
第2特定期間	0.0120

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

③ 収益率の推移

	収益率(%)
第1特定期間	10.4
第2特定期間	△6.8

りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド

(1) 投資状況 (平成19年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,738,902,821	97.35
内 日本	1,738,902,821	97.35
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	47,426,687	2.65
純資産総額	1,786,329,508	100.00

(参考) 兵庫応援マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	573,878,300	96.60
内 日本	573,878,300	96.60
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	20,210,013	3.40
純資産総額	594,088,313	100.00

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(2) 投資資産(平成19年9月28日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位:円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	兵庫応援マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	531,117,619	1.04350 554,221,235	1.1186 594,108,168	— —	33.26%
2	世界REITマザーファンド 日本	親投資信託 受益証券 —	444,954,444	1.23019 547,382,957	1.2955 576,438,482	— —	32.27%
3	ハイグレード・ソブリン・マザーフ ァンド 日本	親投資信託 受益証券 —	494,652,891	1.13310 560,491,192	1.1490 568,356,171	— —	31.82%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.35%
合計	97.35%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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) 兵庫応援マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	アシックス 日本	株式 その他製品	19,000	1,736 32,984,000	1,778 33,782,000	— —	5.69%
2	川崎汽船 日本	株式 海運業	20,000	1,485 29,700,000	1,687 33,740,000	— —	5.68%
3	大和工業 日本	株式 鉄鋼	6,000	4,760 28,560,000	5,520 33,120,000	— —	5.57%
4	住友ゴム 日本	株式 ゴム製品	21,400	1,277 27,327,800	1,444 30,901,600	— —	5.20%
5	神戸製鋼所 日本	株式 鉄鋼	66,000	434 28,644,000	429 28,314,000	— —	4.77%
6	上組 日本	株式 倉庫・運輸関 連業	29,000	968 28,072,000	965 27,985,000	— —	4.71%
7	川崎重工業 日本	株式 輸送用機器	59,000	504 29,736,000	450 26,550,000	— —	4.47%
8	関西ペイント 日本	株式 化学	29,000	916 26,564,000	881 25,549,000	— —	4.30%
9	グローリー 日本	株式 機械	6,800	3,310 22,508,000	3,650 24,820,000	— —	4.18%
10	住友チタニウム 日本	株式 非鉄金属	2,400	10,220 24,528,000	10,010 24,024,000	— —	4.04%
11	シスメックス 日本	株式 電気機器	5,400	4,540 24,516,000	4,430 23,922,000	— —	4.03%
12	山陽特殊鋼 日本	株式 鉄鋼	18,000	885 15,930,000	958 17,244,000	— —	2.90%
13	アサヒブリテック 日本	株式 非鉄金属	3,400	3,480 11,832,000	3,750 12,750,000	— —	2.15%
14	伊藤ハム 日本	株式 食料品	24,000	491 11,784,000	468 11,232,000	— —	1.89%
15	西松屋チェーン 日本	株式 小売業	7,600	1,704 12,950,400	1,457 11,073,200	— —	1.86%
16	みなと銀行 日本	株式 銀行業	45,000	255 11,475,000	241 10,845,000	— —	1.83%
17	日本毛織 日本	株式 繊維製品	10,000	937 9,370,000	928 9,280,000	— —	1.56%
18	ノーリツ 日本	株式 金属製品	5,700	1,783 10,163,100	1,606 9,154,200	— —	1.54%
19	ハイレックスコーポレーション 日本	株式 輸送用機器	4,600	1,700 7,820,000	1,768 8,132,800	— —	1.37%
20	ユニチカ 日本	株式 繊維製品	57,000	157 8,949,000	137 7,809,000	— —	1.31%
21	日本管財 日本	株式 サービス業	2,400	3,360 8,064,000	3,220 7,728,000	— —	1.30%

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
22	新明和工業 日本	株式 輸送用機器	14,000	544 7,616,000	549 7,686,000	— —	1.29%
23	タクマ 日本	株式 機械	11,000	699 7,689,000	659 7,249,000	— —	1.22%
24	SECカーボン 日本	株式 ガラス・土石 製品	4,000	2,090 8,360,000	1,810 7,240,000	— —	1.22%
25	加藤産業 日本	株式 卸売業	4,300	1,498 6,441,400	1,509 6,488,700	— —	1.09%
26	三ツ星ベルト 日本	株式 ゴム製品	10,000	674 6,740,000	603 6,030,000	— —	1.02%
27	バンドー化学 日本	株式 ゴム製品	9,000	741 6,669,000	669 6,021,000	— —	1.01%
28	ノエビア 日本	株式 化学	4,200	1,345 5,649,000	1,300 5,460,000	— —	0.92%
29	SRIスポーツ 日本	株式 その他製品	35	137,000 4,795,000	148,000 5,180,000	— —	0.87%
30	フジッコ 日本	株式 食料品	4,000	1,230 4,920,000	1,264 5,056,000	— —	0.85%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.60%
合計	96.60%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
食料品	4.17%
繊維製品	2.88%
化学	7.86%
医薬品	0.77%
ゴム製品	7.23%
ガラス・土石製品	1.83%
鉄鋼	13.72%
非鉄金属	6.19%
金属製品	2.23%
機械	7.43%
電気機器	6.82%
輸送用機器	7.76%
その他製品	6.56%
陸運業	1.03%
海運業	5.98%
倉庫・運輸関連業	4.71%
卸売業	2.32%
小売業	3.80%
銀行業	1.83%
不動産業	0.18%
サービス業	1.30%

業種	投資比率
合計	96.60%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(3) 運用実績

① 純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
設定時 (平成18年9月27日)	1,441,754,810	—	1.0000	—
平成18年9月末日	1,460,535,076	—	1.0117	—
10月末日	1,532,866,389	—	1.0230	—
11月末日	1,558,839,002	—	1.0351	—
12月末日	1,617,991,029	—	1.0283	—
平成19年1月末日	1,671,334,306	—	1.0363	—
第1特定期間末 (平成19年2月13日)	1,637,357,492	1,698,754,242	1.0104	1.0483
2月末日	1,767,441,710	—	0.9997	—
3月末日	1,986,634,182	—	0.9840	—
4月末日	2,049,703,334	—	1.0060	—
5月末日	2,051,941,288	—	1.0080	—
6月末日	2,020,435,382	—	1.0168	—
7月末日	1,864,488,821	—	0.9664	—
第2特定期間末 (平成19年8月13日)	1,834,103,496	1,837,985,246	0.9450	0.9470
8月末日	1,770,292,813	—	0.9318	—
9月末日	1,786,329,508	—	0.9553	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0950
第2特定期間	0.0260

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

③ 収益率の推移

	収益率(%)
第1特定期間	10.5
第2特定期間	△3.9

6 手続等の概要

(1) 申込（販売）手続等

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所、ロンドン国際金融先物取引所（L I F F E）またはオーストラリア証券取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行ないません。

お買付価額（1万口当り）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時（年末年始など半休日においては午前11時）までに受け付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。

(2) 換金（解約）手続等

委託会社の各営業日の午後3時（年末年始など半休日においては午前11時）までに受け付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

<一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所、ロンドン国際金融先物取引所（L I F F E）またはオーストラリア証券取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行ないません。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせるにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

1万口当りの手取額は、次のとおりとします。

＜個人の受益者の場合＞

解約価額から所得税および地方税（解約価額が個別元本を上回っている場合その超過額の10%。なお、平成21年4月1日からは20%。）を差引いた額とします。

＜法人の受益者の場合＞

解約価額から所得税（解約価額が個別元本を上回っている場合その超過額の7%。なお、平成21年4月1日からは15%。）を差引いた額とします。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

7 管理及び運営の概要

(1) 資産の評価

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当りの価額をいいます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として、当該取引所における計算日の最終相場（ジャスダック証券取引所については、同所が発表する基準値段）で評価します。
- ・公社債等：原則として、次のいずれかの価額で評価します。
 1. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、2. 価格情報会社の提供する価額
- ・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として、当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における

計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）
- ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 保管

該当事項はありません。

(3) 信託期間

平成18年9月27日から平成28年10月13日までとします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 計算期間

毎月14日から翌月13日までとします。ただし、第1計算期間は、平成18年9月27日から平成18年10月13日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日には適用しません。

(5) その他

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を

行なうことが困難な場合には適用しません。

7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

④ 運用報告書

委託会社は、毎年2月および8月の計算期末に、期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。

⑤ 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、平成20年6月30日までは日本経済新聞に掲載し、平成20年7月1日以降は電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。
<http://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 平成20年7月1日以降において、前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥ 関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら

意思表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

(6) 受益者の権利等

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

① 収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日までに、受益者に支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が販売会社に支払われます。

償還金は、原則として信託終了日から起算して5営業日までに、受益者に支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとし、

② 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「6 手続等の概要」をご参照下さい。

第2 財務ハイライト情報

本項の記載事項は、「ファンドの詳細情報」に記載の「財務諸表」（当該「財務諸表」については、あずさ監査法人により監査証明を受けており、当該監査証明にかかる監査報告書は、当該「財務諸表」の箇所に添付しております。）から抜粋して記載したものです。

りそな・東京応援・資産分散ファンド

1 貸借対照表

区 分	前 期	当 期
	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	853,827,000	551,962,553
親投資信託受益証券	13,858,462,054	17,970,578,319
流動資産合計	14,712,289,054	18,522,540,872
資産合計	14,712,289,054	18,522,540,872
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	449,141,979	39,670,648
未払解約金	10,873,097	22,596,083
未払受託者報酬	540,132	861,707
未払委託者報酬	12,963,445	20,681,183
その他未払費用	292,629	780,268
流動負債合計	473,811,282	84,589,889
負債合計	473,811,282	84,589,889
純資産の部		
元本等		
元本	14,086,024,329	19,835,324,361
剰余金		
期末剰余金	152,453,443	—
期末欠損金	—	1,397,373,378
(うち分配準備積立金)	(—)	(108,130,525)
剰余金合計	152,453,443	△1,397,373,378
元本等合計	14,238,477,772	18,437,950,983
純資産合計	14,238,477,772	18,437,950,983
負債・純資産合計	14,712,289,054	18,522,540,872

2 損益及び剰余金計算書

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	407,505	1,551,904
有価証券売買等損益	1,123,462,054	△1,112,883,735
営業収益合計	1,123,869,559	△1,111,331,831
営業費用		
受託者報酬	1,951,222	5,202,361
委託者報酬	46,830,200	124,857,818
その他費用	292,629	866,258
営業費用合計	49,074,051	130,926,437
営業利益金額	1,074,795,508	—
営業損失金額	—	1,242,258,268
経常利益金額	1,074,795,508	—
経常損失金額	—	1,242,258,268
当期純利益金額	1,074,795,508	—
当期純損失金額	—	1,242,258,268
一部解約に伴う当期純利益金額分配額	2,760,042	157,923
期首剰余金	—	152,453,443
剰余金増加額	191,750,972	11,596,636
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)	(191,750,972)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)	(—)	(11,596,636)
剰余金減少額	2,994,184	76,181,486
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)	(2,994,184)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)	(—)	(76,181,486)
分配金	1,108,338,811	242,825,780
期末剰余金	152,453,443	—
期末欠損金	—	1,397,373,378

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

1 貸借対照表

区 分	前 期	当 期
	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	352,493,594	200,525,999
親投資信託受益証券	8,466,976,415	8,192,862,497
流動資産合計	8,819,470,009	8,393,388,496
資産合計	8,819,470,009	8,393,388,496
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	102,408,108	17,863,188
未払解約金	—	10,478,916
未払受託者報酬	338,689	391,005
未払委託者報酬	8,128,706	9,384,237
その他未払費用	182,780	362,120
流動負債合計	111,058,283	38,479,466
負債合計	111,058,283	38,479,466
純資産の部		
元本等		
元本	8,614,522,613	8,931,594,038
剰余金		
期末剰余金	93,889,113	—
期末欠損金	—	576,685,008
(うち分配準備積立金)	(4,899,145)	(74,611,705)
剰余金合計	93,889,113	△576,685,008
元本等合計	8,708,411,726	8,354,909,030
純資産合計	8,708,411,726	8,354,909,030
負債・純資産合計	8,819,470,009	8,393,388,496

2 損益及び剰余金計算書

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	174,919	649,002
有価証券売買等損益	506,976,415	△494,113,918
営業収益合計	507,151,334	△493,464,916
営業費用		
受託者報酬	1,218,915	2,414,724
委託者報酬	29,254,928	57,954,565
その他費用	182,780	386,120
営業費用合計	30,656,623	60,755,409
営業利益金額	476,494,711	—
営業損失金額	—	554,220,325
経常利益金額	476,494,711	—
経常損失金額	—	554,220,325
当期純利益金額	476,494,711	—
当期純損失金額	—	554,220,325
一部解約に伴う当期純利益金額分配額	265,553	4,310,539
期首剰余金	—	93,889,113
剰余金増加額	89,199,437	2,459,526
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)	(89,199,437)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)	(—)	(2,459,526)
剰余金減少額	308,446	4,124,868
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)	(308,446)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)	(—)	(4,124,868)
分配金	471,231,036	110,377,915
期末剰余金	93,889,113	—
期末欠損金	—	576,685,008

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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。

1 貸借対照表

区 分	前 期	当 期
	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	107,032,779	100,020,059
親投資信託受益証券	3,289,473,554	2,648,593,624
流動資産合計	3,396,506,333	2,748,613,683
資産合計	3,396,506,333	2,748,613,683
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	81,235,204	5,839,288
未払解約金	10,721,854	3,774,000
未払受託者報酬	140,072	127,252
未払委託者報酬	3,361,874	3,054,266
その他未払費用	103,243	123,891
流動負債合計	95,562,247	12,918,697
負債合計	95,562,247	12,918,697
純資産の部		
元本等		
元本	3,265,510,430	2,919,644,453
剰余金		
期末剰余金	35,433,656	—
期末欠損金	—	183,949,467
(うち分配準備積立金)	(31,198,060)	(36,962,552)
剰余金合計	35,433,656	△183,949,467
元本等合計	3,300,944,086	2,735,694,986
純資産合計	3,300,944,086	2,735,694,986
負債・純資産合計	3,396,506,333	2,748,613,683

2 損益及び剰余金計算書

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	108,720	225,980
有価証券売買等損益	306,473,554	△162,879,930
営業収益合計	306,582,274	△162,653,950
営業費用		
受託者報酬	688,644	826,481
委託者報酬	16,528,189	19,836,567
その他費用	103,243	126,374
営業費用合計	17,320,076	20,789,422
営業利益金額	289,262,198	—
営業損失金額	—	183,443,372
経常利益金額	289,262,198	—
経常損失金額	—	183,443,372
当期純利益金額	289,262,198	—
当期純損失金額	—	183,443,372
一部解約に伴う当期純利益金額分配額	4,880,074	1,970,540
期首剰余金	—	35,433,656
剰余金増加額	4,485,554	5,427,486
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)	(4,485,554)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)	(—)	(5,427,486)
剰余金減少額	2,786,486	2,015,387
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)	(2,786,486)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)	(—)	(2,015,387)
分配金	250,647,536	37,381,310
期末剰余金	35,433,656	—
期末欠損金	—	183,949,467

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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。

1 貸借対照表

区 分	前 期	当 期
	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	96,643,163	29,170,943
親投資信託受益証券	2,222,413,668	1,788,032,831
流動資産合計	2,319,056,831	1,817,203,774
資産合計	2,319,056,831	1,817,203,774
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	49,112,699	3,903,724
未払解約金	823,709	2,731,734
未払受託者報酬	95,349	85,045
未払委託者報酬	2,288,558	2,041,261
その他未払費用	69,711	81,387
流動負債合計	52,390,026	8,843,151
負債合計	52,390,026	8,843,151
純資産の部		
元本等		
元本	2,243,421,719	1,951,862,376
剰余金		
期末剰余金	23,245,086	—
期末欠損金	—	143,501,753
(うち分配準備積立金)	(18,197,089)	(22,877,408)
剰余金合計	23,245,086	△143,501,753
元本等合計	2,266,666,805	1,808,360,623
純資産合計	2,266,666,805	1,808,360,623
負債・純資産合計	2,319,056,831	1,817,203,774

2 損益及び剰余金計算書

区 分	前 期	当 期
	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	85,777	173,526
有価証券売買等損益	191,413,668	△130,380,837
営業収益合計	191,499,445	△130,207,311
営業費用		
受託者報酬	465,201	543,120
委託者報酬	11,165,498	13,035,845
その他費用	69,711	85,003
営業費用合計	11,700,410	13,663,968
営業利益金額	179,799,035	—
営業損失金額	—	143,871,279
経常利益金額	179,799,035	—
経常損失金額	—	143,871,279
当期純利益金額	179,799,035	—
当期純損失金額	—	143,871,279
一部解約に伴う当期純利益金額分配額	3,673,888	—
一部解約に伴う当期純損失金額分配額	—	172,347
期首剰余金	—	23,245,086
剰余金増加額	5,387,298	2,231,333
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)	(5,387,298)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)	(—)	(2,231,333)
剰余金減少額	1,749,727	389,492
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)	(1,749,727)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)	(—)	(389,492)
分配金	156,517,632	24,889,748
期末剰余金	23,245,086	—
期末欠損金	—	143,501,753

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

1 貸借対照表

区 分	前 期	当 期
	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	303,990,398	121,700,346
親投資信託受益証券	6,294,627,870	8,482,565,411
未収入金	—	80,000,000
流動資産合計	6,598,618,268	8,684,265,757
資産合計	6,598,618,268	8,684,265,757
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	214,083,034	18,151,482
未払解約金	—	8,676,308
未払受託者報酬	247,974	403,873
未払委託者報酬	5,951,580	9,693,215
その他未払費用	116,770	365,786
流動負債合計	220,399,358	37,290,664
負債合計	220,399,358	37,290,664
純資産の部		
元本等		
元本	6,313,614,229	9,094,895,933
剰余金		
期末剰余金	64,604,681	—
期末欠損金	—	447,920,840
(うち分配準備積立金)	(—)	(92,772,552)
剰余金合計	64,604,681	△447,920,840
元本等合計	6,378,218,910	8,646,975,093
純資産合計	6,378,218,910	8,646,975,093
負債・純資産合計	6,598,618,268	8,684,265,757

2 損益及び剰余金計算書

区 分	前 期	当 期
	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	94,414	355,090
有価証券売買等損益	454,627,870	△302,062,459
営業収益合計	454,722,284	△301,707,369
営業費用		
受託者報酬	778,914	2,439,156
委託者報酬	18,694,784	58,540,836
その他費用	116,770	416,175
営業費用合計	19,590,468	61,396,167
営業利益金額	435,131,816	—
営業損失金額	—	363,103,536
経常利益金額	435,131,816	—
経常損失金額	—	363,103,536
当期純利益金額	435,131,816	—
当期純損失金額	—	363,103,536
一部解約に伴う当期純利益金額分配額	21,386	5,717,810
期首剰余金	—	64,604,681
剰余金増加額	99,899,327	5,110,036
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)	(99,899,327)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)	(—)	(5,110,036)
剰余金減少額	19,379	35,034,370
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)	(19,379)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)	(—)	(35,034,370)
分配金	470,385,697	113,779,841
期末剰余金	64,604,681	—
期末欠損金	—	447,920,840

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

1 貸借対照表

区 分	前 期	当 期
	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	104,774,510	53,466,912
親投資信託受益証券	2,309,628,465	1,926,547,747
流動資産合計	2,414,402,975	1,980,014,659
資産合計	2,414,402,975	1,980,014,659
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	51,145,210	4,189,705
未払受託者報酬	96,791	92,074
未払委託者報酬	2,323,049	2,209,922
その他未払費用	61,705	92,378
流動負債合計	53,626,755	6,584,079
負債合計	53,626,755	6,584,079
純資産の部		
元本等		
元本	2,335,869,799	2,094,852,551
剰余金		
期末剰余金	24,906,421	—
期末欠損金	—	121,421,971
(うち分配準備積立金)	(12,502,034)	(20,689,043)
剰余金合計	24,906,421	△121,421,971
元本等合計	2,360,776,220	1,973,430,580
純資産合計	2,360,776,220	1,973,430,580
負債・純資産合計	2,414,402,975	1,980,014,659

2 損益及び剰余金計算書

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	72,271	210,653
有価証券売買等損益	185,628,465	△80,580,718
営業収益合計	185,700,736	△80,370,065
営業費用		
受託者報酬	411,830	616,365
委託者報酬	9,884,729	14,793,737
その他費用	61,705	95,005
営業費用合計	10,358,264	15,505,107
営業利益金額	175,342,472	—
営業損失金額	—	95,875,172
経常利益金額	175,342,472	—
経常損失金額	—	95,875,172
当期純利益金額	175,342,472	—
当期純損失金額	—	95,875,172
一部解約に伴う当期純利益金額分配額	54,146	—
一部解約に伴う当期純損失金額分配額	—	2,510,805
期首剰余金	—	24,906,421
剰余金増加額	12,427,307	—
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)	(12,427,307)	(—)
剰余金減少額	78,158	4,101,042
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)	(78,158)	(3,519,612)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)	(—)	(581,430)
分配金	162,731,054	48,862,983
期末剰余金	24,906,421	—
期末欠損金	—	121,421,971

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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。

1 貸借対照表

区 分	前 期	当 期
	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	611,365,203	218,920,280
親投資信託受益証券	11,162,396,094	11,210,370,890
流動資産合計	11,773,761,297	11,429,291,170
資産合計	11,773,761,297	11,429,291,170
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	359,761,077	24,502,266
未払解約金	12,254,298	—
未払受託者報酬	467,747	533,403
未払委託者報酬	11,226,083	12,801,905
その他未払費用	291,405	493,231
流動負債合計	384,000,610	38,330,805
負債合計	384,000,610	38,330,805
純資産の部		
元本等		
元本	11,274,968,138	12,251,135,456
剰余金		
期末剰余金	114,792,549	—
期末欠損金	—	860,175,091
(うち分配準備積立金)	(33,046,490)	(78,695,753)
剰余金合計	114,792,549	△860,175,091
元本等合計	11,389,760,687	11,390,960,365
純資産合計	11,389,760,687	11,390,960,365
負債・純資産合計	11,773,761,297	11,429,291,170

2 損益及び剰余金計算書

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	350,377	811,447
有価証券売買等損益	1,044,396,094	△742,025,204
営業収益合計	1,044,746,471	△741,213,757
営業費用		
受託者報酬	1,943,103	3,288,745
委託者報酬	46,635,292	78,930,739
その他費用	291,405	523,430
営業費用合計	48,869,800	82,742,914
営業利益金額	995,876,671	—
営業損失金額	—	823,956,671
経常利益金額	995,876,671	—
経常損失金額	—	823,956,671
当期純利益金額	995,876,671	—
当期純損失金額	—	823,956,671
一部解約に伴う当期純利益金額分配額	1,115,469	—
一部解約に伴う当期純損失金額分配額	—	5,742,031
期首剰余金	—	114,792,549
剰余金増加額	82,227,023	6,893,490
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)	(82,227,023)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)	(—)	(6,893,490)
剰余金減少額	907,806	12,065,390
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)	(907,806)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)	(—)	(12,065,390)
分配金	961,287,870	151,581,100
期末剰余金	114,792,549	—
期末欠損金	—	860,175,091

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

1 貸借対照表

区 分	前 期	当 期
	平成 19 年 2 月 13 日現在	平成 19 年 8 月 13 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	75,842,533	56,672,372
親投資信託受益証券	1,611,692,232	1,773,512,027
未収入金	13,000,000	10,000,000
流動資産合計	1,700,534,765	1,840,184,399
資産合計	1,700,534,765	1,840,184,399
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	61,396,750	3,881,750
未払受託者報酬	69,332	84,896
未払委託者報酬	1,664,205	2,037,761
その他未払費用	46,986	76,496
流動負債合計	63,177,273	6,080,903
負債合計	63,177,273	6,080,903
純資産の部		
元本等		
元本	1,620,483,009	1,940,875,388
剰余金		
期末剰余金	16,874,483	—
期末欠損金	—	106,771,892
(うち分配準備積立金)	(11,511,719)	(22,796,375)
剰余金合計	16,874,483	△106,771,892
元本等合計	1,637,357,492	1,834,103,496
純資産合計	1,637,357,492	1,834,103,496
負債・純資産合計	1,700,534,765	1,840,184,399

2 損益及び剰余金計算書

区 分	前 期	当 期
	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	59,594	161,524
有価証券売買等損益	169,692,232	△55,180,205
営業収益合計	169,751,826	△55,018,681
営業費用		
受託者報酬	313,652	510,494
委託者報酬	7,528,368	12,252,736
その他費用	46,986	82,259
営業費用合計	7,889,006	12,845,489
営業利益金額	161,862,820	—
営業損失金額	—	67,864,170
経常利益金額	161,862,820	—
経常損失金額	—	67,864,170
当期純利益金額	161,862,820	—
当期純損失金額	—	67,864,170
一部解約に伴う当期純利益金額分配額	863,684	2,117,834
期首剰余金	—	16,874,483
剰余金増加額	5,540,835	286,369
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)	(5,540,835)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)	(—)	(286,369)
剰余金減少額	959,687	3,341,715
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)	(959,687)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)	(—)	(3,341,715)
分配金	148,705,801	50,609,025
期末剰余金	16,874,483	—
期末欠損金	—	106,771,892

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

第3 内国投資信託受益証券事務の概要

- (1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。
- (2) 受益者に対する特典
ありません。
- (3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。
- (4) 受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
- (5) 受益権の譲渡
 - ① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
 - ② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
 - ③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
- (6) 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
- (7) 受益権の再分割
委託会社は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託会社と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
- (8) 償還金
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。
- (9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第4 ファンドの詳細情報の項目

- 第1 ファンドの沿革
- 第2 手続等
 - 1 申込（販売）手続等
 - 2 換金（解約）手続等
- 第3 管理及び運営
 - 1 資産管理等の概要
 - (1) 資産の評価
 - (2) 保管
 - (3) 信託期間
 - (4) 計算期間
 - (5) その他
 - 2 受益者の権利等
- 第4 ファンドの経理状況
 - 1 財務諸表
 - (1) 貸借対照表
 - (2) 損益及び剰余金計算書
 - (3) 注記表
 - (4) 附属明細表
 - 2 ファンドの現況
 - 純資産額計算書 平成 年 月 日
 - I 資産総額
 - II 負債総額
 - III 純資産総額（I－II）
 - IV 発行済数量
 - V 1単位当たり純資産額（III／IV）
- 第5 設定及び解約の実績

追加型証券投資信託

- (りそな・東京応援・資産分散ファンド)
- (りそな・埼玉応援・資産分散ファンド)
- (りそな・多摩応援・資産分散ファンド)
- (りそな・神奈川応援・資産分散ファンド)
- (りそな・中部応援・資産分散ファンド)
- (りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド)
- (りそな・大阪応援・資産分散ファンド)
- (りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド)

約 款

大和証券投資信託委託株式会社

運用の基本方針

約款第22条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得により、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

下記の各マザーファンド（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

1. (※) 応援マザーファンドの受益証券
2. ハイグレード・ソブリン・マザーファンドの受益証券
3. 世界REITマザーファンドの受益証券

(2) 投資態度

- ① 主として、各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得により、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
- ② 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。
(※) 応援マザーファンドの受益証券 …………… 信託財産の純資産総額の3分の1
ハイグレード・ソブリン・マザーファンドの受益証券 …… 信託財産の純資産総額の3分の1
世界REITマザーファンドの受益証券 …………… 信託財産の純資産総額の3分の1
- ③ 保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ④ 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(3) 投資制限

- ① 株式への投資制限
株式への直接投資は、行ないません。
- ② 外貨建資産への投資制限
外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

3. 収益分配方針

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。また、第1および第2計算期末には、収益の分配は行ないません。
- ③ 留保益は、上記「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

(注) 上記「2. 運用方法」の「(1) 投資対象」の1.および「(2) 投資態度」の②にある(※)は、以下の各々の場合において、次のように読み替えるものとします。

「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の場合	東京
「りそな・埼玉応援・資産分散ファンド」の場合	埼玉
「りそな・多摩応援・資産分散ファンド」の場合	多摩
「りそな・神奈川応援・資産分散ファンド」の場合	神奈川
「りそな・中部応援・資産分散ファンド」の場合	中部
「りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド」の場合	京都滋賀
「りそな・大阪応援・資産分散ファンド」の場合	大阪
「りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド」の場合	兵庫

追加型証券投資信託

- (りそな・東京応援・資産分散ファンド)
 - (りそな・埼玉応援・資産分散ファンド)
 - (りそな・多摩応援・資産分散ファンド)
 - (りそな・神奈川応援・資産分散ファンド)
 - (りそな・中部応援・資産分散ファンド)
 - (りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド)
 - (りそな・大阪応援・資産分散ファンド)
 - (りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド)
- 約 款

(注) 本約款の第2条、第3条第1項および第7条第1項にある(※)は、以下の各々の場合において、次のように読み替えるものとします。

	第2条	第3条第1項	第7条第1項
「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の場合	500	3,000	500
「りそな・埼玉応援・資産分散ファンド」の場合	500	1,500	500
「りそな・多摩応援・資産分散ファンド」の場合	300	600	300
「りそな・神奈川応援・資産分散ファンド」の場合	500	3,000	500
「りそな・中部応援・資産分散ファンド」の場合	500	3,000	500
「りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド」の場合	500	1,500	500
「りそな・大阪応援・資産分散ファンド」の場合	500	3,000	500
「りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド」の場合	500	1,200	500

(注) 本約款の第20条第1号にある(※)は、以下の各々の場合において、次のように読み替えるものとします。

「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の場合	東京
「りそな・埼玉応援・資産分散ファンド」の場合	埼玉
「りそな・多摩応援・資産分散ファンド」の場合	多摩
「りそな・神奈川応援・資産分散ファンド」の場合	神奈川
「りそな・中部応援・資産分散ファンド」の場合	中部
「りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド」の場合	京都滋賀
「りそな・大阪応援・資産分散ファンド」の場合	大阪
「りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド」の場合	兵庫

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、りそな信託銀行株式会社を受託者としてします。

- ② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法(大正11年法律第62号)の適用を受けます。
- ③ 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関(受託者の利害関係人(金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。)を含みます。)と信託契約を締結し、これを委託することができます。
- ④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行なうものとします。

(信託の目的および金額)

第2条 委託者は、金(※)億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、(※)億円を限度として信託金を追加することができます。

- ② 追加信託が行なわれたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。
- ③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から平成28年10月13日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

第5条 この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

(当初の受益者)

第6条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第7条 委託者は、第2条の規定による受益権については(※)億円を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- ② 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第8条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

- ② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産を法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(以下「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。
- ③ 外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ④ 第24条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律(政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。)の規定の適用を受け、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関(社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。)および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
- ③ 委託者は、第7条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行いません。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在のすべての受益権(受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。)を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預りではない受益証券にかかる受益権

については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下「指定販売会社」といいます。）に当該申請の手續を委任することができます。

（受益権の設定にかかる受託者の通知）

第11条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

（受益権の申込単位および価額）

第12条 指定販売会社は、第7条第1項の規定により分割される受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として指定販売会社が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。ただし、指定販売会社と別に定める積立投資約款に従い積立投資契約を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応じることができるものとします。

② 前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。

③ 第1項の規定にかかわらず、指定販売会社は、別に定める取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込の受付を行ないません。

④ 第1項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、指定販売会社が別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益証券の価額は、1口につき1円に、指定販売会社が別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

⑤ 前項の規定にかかわらず、受益者が積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第34条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

（受益権の譲渡にかかる記載または記録）

第13条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

第15条 (削 除)

第16条 (削 除)

第17条 (削 除)

第18条 (削 除)

（投資の対象とする資産の種類）

第19条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ. 有価証券

ロ. 約束手形

ハ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

（有価証券および金融商品の指図範囲等）

第20条 委託者は、信託金を、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、りそな信託銀行株式会社を受託者として締結された次の第1号から第3号までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の第4号から第7号までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. (※) 応援マザーファンドの受益証券
2. ハイグレード・ソブリン・マザーファンドの受益証券
3. 世界REITマザーファンドの受益証券
4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
5. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
7. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）

② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第21条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第25条において同じ。）、第25条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第19条および第20条に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行なうことができます。

② 前項の取扱いは、第24条、第29条および第30条における委託者の指図による取引についても同様とします。

（運用の基本方針）

第22条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行ないます。

（特別の場合の外貨建有価証券への投資制限）

第23条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

（外国為替予約取引の指図）

第24条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

（信託業務の委託等）

第25条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第26条（削 除）
（混蔵寄託）

第27条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマース・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第28条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（一部解約の請求および有価証券売却等の指図）

第29条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第30条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第31条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

② 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

③ 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

- ④ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。
（損益の帰属）

第32条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金の立替え）

第33条 信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第34条 この信託の計算期間は、毎月14日から翌月13日までとします。ただし、第1計算期間は、平成18年9月27日から平成18年10月13日までとします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項の規定により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日には適用しません。

（信託財産に関する報告）

第35条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

（信託事務の諸費用および監査報酬）

第36条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

（信託報酬等の額および支弁の方法）

第37条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第34条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の125の率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

- ④ 委託者は、この信託において主要投資対象とする世界REITマザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬を支払うものとし、その額は当該マザーファンドの日々の純資産総額に年10,000分の57以内の率を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月9日および9月9日または信託終了のときに行なうものとします。

（収益の分配方式）

第38条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。ただし、第1および第2計算期末には、収益の分配は行ないません。

1. 配当金、利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第39条 収益分配金は、第1および第2計算期間を除く毎計算期間終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益者にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者となります。）に支払います。なお、平成19年1月4日以降においても、第41条に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとし、当該取得申込により増加した受益権は、第10条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者となります。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

④ 一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、5営業日目から受益者に支払います。

⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行なうものとし、

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第40条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については前条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金および償還金の時効）

第41条 受益者が、収益分配金については第39条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については第39条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第42条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、最低単位を1口単位として指定販売会社が定める単位（積立投資契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託者に一部解約請求をすることができます。

② 委託者は、前項の一部解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。ただし、委託者は、別に定める取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約請求の受付を行いません。なお、前項の一部解約請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

③ 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

④ 平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約にかかる一部解約の実行の請求を受益者がすると

きは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとし、

ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約請求で、平成19年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとし、

⑤ 委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。）等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約請求の受付を中止することができます。

⑥ 前項により一部解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

（質権口記載または記録の受益権の取扱い）

第42条の2 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

（信託契約の解約）

第43条 委託者は、信託期間中において、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。

⑤ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑥ 第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第44条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第48条の規定に従います。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第45条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第48条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

（委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い）

第46条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

（受託者の辞任および解任に伴う取扱い）

第47条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を

請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第48条の規定に従い、新受託者を選任します。

② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第48条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第49条 第43条の規定に従い信託契約の解約を行なう場合または前条の規定に従い信託約款の変更を行なう場合において、第43条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(信託期間の延長)

第50条 委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託者と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(公告)

第51条 委託者が受益者に対してする公告は、平成20年6月30日までは日本経済新聞に掲載し、平成20年7月1日以降は電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

② 平成20年7月1日以降において、前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第52条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(付 則)

第 1条 この約款において「積立投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「積立投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「積立投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2条 第39条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第 3条 平成18年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条（受益証券の記名式、無記名式への変更ならびに名義書換手続）から第18条（受益証券の再交付の費用）の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

委託者 大和証券投資信託委託株式会社

受託者 りそな信託銀行株式会社

I 別に定める取引所

約款第12条および第42条の「別に定める取引所」とは、次のものをいいます。

ニューヨーク証券取引所
ロンドン国際金融先物取引所（L I F F E）
オーストラリア証券取引所

りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ

投資信託説明書(請求目論見書)

平成19年11月7日

本文書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書(請求目論見書)です。

本文書にかかる「りそな・地域応援・資産分散ファンド・シリーズ」の受益証券の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を平成19年11月6日に関東財務局長に提出しており、平成19年11月7日にその届出の効力が生じております。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

第三部 ファンドの詳細情報

第1 ファンドの沿革

平成18年9月27日 信託契約締結、当初設定、運用開始

第2 手続等

1 申込（販売）手続等

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所、ロンドン国際金融先物取引所（LIFFE）またはオーストラリア証券取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行ないません。

お買付価額（1万口当り）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時（年末年始など半休日においては午前11時）までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないません。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないません。

2 換金（解約）手続等

委託会社の各営業日の午後3時（年末年始など半休日においては午前11時）までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

<一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

委託会社は、一部解約の実行の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所、ロンドン国際金融先物取引所(LIFFE)またはオーストラリア証券取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行いません。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額(基準価額)は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)
電話番号(コールセンター) 0120-106212
(営業日の9:00~17:00、半休日は9:00~12:00)
- ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

1万口当りの手取額は、次のとおりとします。

<個人の受益者の場合>

解約価額から所得税および地方税(解約価額が個別元本を上回っている場合その超過額の10%。なお、平成21年4月1日からは20%)を差引いた額とします。

<法人の受益者の場合>

解約価額から所得税(解約価額が個別元本を上回っている場合その超過額の7%。なお、平成21年4月1日からは15%)を差引いた額とします。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

委託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。委託会社は、委託会社の指定する預金口座等の一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

第3 管理及び運営

1 資産管理等の概要

(1) 資産の評価

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当りの価額をいいます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価(注1、注2)により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として、当該取引所における計算日の最終相場(ジャスダック証券取引所については、同所が発表する基準値段)で評価します。
- ・公社債等：原則として、次のいずれかの価額で評価します。
 1. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く。)
 2. 価格情報会社の提供する価額
- ・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として、当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。

なお、外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるとともに、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問い合わせ先(委託会社)
電話番号(コールセンター) 0120-106212
(営業日の9:00~17:00、半休日は9:00~12:00)
- ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 保管

該当事項はありません。

(3) 信託期間

平成18年9月27日から平成28年10月13日までとします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、委託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 計算期間

毎月14日から翌月13日までとします。ただし、第1計算期間は、平成18年9月27日から平成18年10月13日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日には適用しません。

(5) その他

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が 30 億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前 1. の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前 2. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前 3. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の 2 分の 1 を超えるときは、前 1. の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前 3. から前 5. までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前 3. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の 4. に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前 1. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前 2. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前 3. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の 2 分の 1 を超えるときは、前 1. の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交

付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前5. までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

前①の 1. から 6. までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の 3. または前②の 3. の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

④ 運用報告書

委託会社は、毎年2月および8月の計算期末に、期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。

⑤ 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、平成20年6月30日までは日本経済新聞に掲載し、平成20年7月1日以降は電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

2. 平成20年7月1日以降において、前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥ 関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

2 受益者の権利等

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

① 収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、第1および第2計算期間を除く毎計算期間終了日後1か月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が販売会社に支払われます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込みに応じるものとします。当該取得申込みにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日後1か月以内の委託会社の指定する日（原則として信託終了日から

起算して5営業日まで)から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社が当ファンドの償還をするのと引換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

受託会社は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に収益分配金および償還金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

② 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「第2 手続等」の「2 換金(解約)手続等」をご参照下さい。

第4 ファンドの経理状況

りそな・東京応援・資産分散ファンド

(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)並びに同規則第2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、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か月未満であるため、財務諸表は6か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、前特定期間(平成18年9月27日から平成19年2月13日まで)及び当特定期間(平成19年2月14日から平成19年8月13日まで)の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 3 月 30 日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員

公認会計士

三浦邦仁



指定社員
業務執行社員

公認会計士

久野佳樹



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・東京応援・資産分散ファンドの平成 18 年 9 月 27 日から平成 19 年 2 月 13 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、注記表並びに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・東京応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 13 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。

大和証券投資信託委託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

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 9 月 28 日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員 公認会計士

山元 太志



指定社員
業務執行社員 公認会計士

久野 佳樹



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・東京応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 14 日から平成 19 年 8 月 13 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、注記表並びに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・東京応援・資産分散ファンドの平成 19 年 8 月 13 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。

大和証券投資信託委託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・東京応援・資産分散ファンド

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		平成19年2月13日現在 金 額 (円)	平成19年8月13日現在 金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		853,827,000	551,962,553
親投資信託受益証券		13,858,462,054	17,970,578,319
流動資産合計		14,712,289,054	18,522,540,872
資産合計		14,712,289,054	18,522,540,872
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		449,141,979	39,670,648
未払解約金		10,873,097	22,596,083
未払受託者報酬		540,132	861,707
未払委託者報酬		12,963,445	20,681,183
その他未払費用		292,629	780,268
流動負債合計		473,811,282	84,589,889
負債合計		473,811,282	84,589,889
純資産の部			
元本等			
元本	※1	14,086,024,329	19,835,324,361
剰余金			
期末剰余金		152,453,443	—
期末欠損金		—	1,397,373,378
(うち分配準備積立金)		(—)	(108,130,525)
剰余金合計	※2	152,453,443	△1,397,373,378
元本等合計		14,238,477,772	18,437,950,983
純資産合計		14,238,477,772	18,437,950,983
負債・純資産合計		14,712,289,054	18,522,540,872

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
		金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益			
受取利息		407,505	1,551,904
有価証券売買等損益		1,123,462,054	△1,112,883,735
営業収益合計		1,123,869,559	△1,111,331,831
営業費用			
受託者報酬		1,951,222	5,202,361
委託者報酬	※1	46,830,200	124,857,818
その他費用		292,629	866,258
営業費用合計		49,074,051	130,926,437
営業利益金額		1,074,795,508	—
営業損失金額		—	1,242,258,268
経常利益金額		1,074,795,508	—
経常損失金額		—	1,242,258,268
当期純利益金額		1,074,795,508	—
当期純損失金額		—	1,242,258,268
一部解約に伴う当期純利益金額分配額		2,760,042	157,923
期首剰余金		—	152,453,443
剰余金増加額		191,750,972	11,596,636
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)		(191,750,972)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)		(—)	(11,596,636)
剰余金減少額		2,994,184	76,181,486
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)		(2,994,184)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)		(—)	(76,181,486)
分配金	※2	1,108,338,811	242,825,780
期末剰余金		152,453,443	—
期末欠損金		—	1,397,373,378

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1. ※1 期首元本額	6,521,117,018 円	14,086,024,329 円
期中追加設定元本額	7,803,751,633 円	7,950,563,086 円
期中一部解約元本額	238,844,322 円	2,201,263,054 円
2. 特定期間末日における受益権 の総数	14,086,024,329 口	19,835,324,361 口
3. ※2 元本の欠損	—————	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1,397,373,378 円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	5,650,961 円	14,430,928 円
2. ※2 分配金の計算過程	<p>(自平成 18 年 9 月 27 日 至平成 18 年 10 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (20,114,256 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (170,141,835 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (13,893,500 円) 及び分配準備積立金 (0 円) より分配対象額は 204,149,591 円 (1 万口当たり 279.47 円) がありますが、分配を行っておりません。</p> <p>(自平成 18 年 10 月 14 日 至平成 18 年 11 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (10,036,050 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (40,086,286 円) 及び分配準備積立金 (190,029,869 円) より分配対象額は 240,152,205 円 (1 万口当たり 274.73 円) がありますが、分配を行っておりません。</p> <p>(自平成 18 年 11 月 14 日 至平成 18 年 12 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (17,048,902 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券</p>	<p>(自平成 19 年 2 月 14 日 至平成 19 年 3 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (9,894,149 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (82,812,935 円) 及び分配準備積立金 (0 円) より分配対象額は 92,707,084 円 (1 万口当たり 47.30 円) であり、うち 38,941,562 円 (1 万口当たり 19.87 円) を分配金額としております。</p> <p>(自平成 19 年 3 月 14 日 至平成 19 年 4 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (90,924,039 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (62,734,677 円) 及び分配準備積立金 (0 円) より分配対象額は 153,658,716 円 (1 万口当たり 72.47 円) であり、うち 42,213,255 円 (1 万口当たり 19.91 円) を分配金額としております。</p> <p>(自平成 19 年 4 月 14 日 至平成 19 年 5 月 14 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (65,778,005 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券</p>

<p> 売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(154,852,841円)、投資信託約款に規定される収益調整金(69,181,806円)及び分配準備積立金(199,354,558円)より分配対象額は440,438,107円(1万口当たり483.92円)であり、うち344,040,075円(1万口当たり378円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成18年12月14日 至平成19年1月15日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(40,481,906円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(249,561,312円)、投資信託約款に規定される収益調整金(103,852,832円)及び分配準備積立金(26,780,740円)より分配対象額は420,676,790円(1万口当たり400.07円)であり、うち315,156,757円(1万口当たり299.72円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年1月16日 至平成19年2月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(29,890,747円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(380,295,131円)、投資信託約款に規定される収益調整金(189,748,234円)及び分配準備積立金(1,661,310円)より分配対象額は601,595,422円(1万口当たり427.09円)であり、うち449,141,979円(1万口当たり318.86円)を分配金額としております。 </p>	<p> 売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(14,848,224円)、投資信託約款に規定される収益調整金(64,736,252円)及び分配準備積立金(48,337,030円)より分配対象額は193,699,511円(1万口当たり90.44円)であり、うち40,914,872円(1万口当たり19.10円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年5月15日 至平成19年6月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(22,172,337円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(64,709,884円)及び分配準備積立金(86,549,361円)より分配対象額は173,431,582円(1万口当たり81.86円)であり、うち41,748,444円(1万口当たり19.71円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年6月14日 至平成19年7月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(96,730,314円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(62,801,211円)及び分配準備積立金(63,991,936円)より分配対象額は223,523,461円(1万口当たり109.85円)であり、うち39,336,999円(1万口当たり19.33円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年7月14日 至平成19年8月13日) </p>	
--	--	--

		<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(29,762,049円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(61,567,842円)及び分配準備積立金(118,039,124円)より分配対象額は209,369,015円(1万口当たり105.55円)であり、うち39,670,648円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
--	--	--

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成19年2月13日現在		当 期 平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託 受益証券	13,858,462,054	424,399,372	17,970,578,319	△ 1,365,124,054
合 計	13,858,462,054	424,399,372	17,970,578,319	△ 1,365,124,054

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

前 期 自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日	当 期 自 平成19年2月14日 至 平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
該当事項はありません。	市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、 一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行 なわれていないため、該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1. 0108 円 (10, 108 円)	0. 9296 円 (9, 296 円)

(4) 附属明細表

第 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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託 受益証券	東京応援マザーファンド	5, 776, 183, 918	5, 970, 841, 316	
	ハイグレード・ソブリン・ マザーファンド	5, 322, 225, 972	6, 058, 822, 046	
	世界REITマザーファンド	4, 733, 042, 509	5, 940, 914, 957	
合計		15, 831, 452, 399	17, 970, 578, 319	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第 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。

(参考)

当ファンドは「東京応援マザーファンド」受益証券、「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」受益証券及び「世界REITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

「東京応援マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

区 分	注記 番号	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
		金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		292,223,306	113,534,767
株式		4,529,991,200	5,852,168,350
未収配当金		2,417,310	5,331,105
流動資産合計		4,824,631,816	5,971,034,222
資産合計		4,824,631,816	5,971,034,222
負債の部			
流動負債			
未払金		147,535,650	—
流動負債合計		147,535,650	—
負債合計		147,535,650	—
純資産の部			
元本等			
元本	※1	4,158,164,073	5,776,183,918
剰余金			
期末剰余金		518,932,093	194,850,304
剰余金合計		518,932,093	194,850,304
元本等合計		4,677,096,166	5,971,034,222
純資産合計		4,677,096,166	5,971,034,222
負債・純資産合計		4,824,631,816	5,971,034,222

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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段、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。</p>	<p>株式 同左</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>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、未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。</p>	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。ただし、平成 19 年 6 月 30 日以前に計上した受取配当金については、その金額が確定している場合には当該金額、未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。 (会計方針の変更) 従来、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、未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いましたが、「投資信託に関する会計規則に関する細則」の改正により、平成 19 年 7 月 1 日以降計上する受取配当金については、原則として、株式の配当落ち日において、予想配当金額についてもその全額を計上する方法に変更しました。 この変更による損益への影響はありません。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成 19 年 2 月 13 日現在	平成 19 年 8 月 13 日現在
1. ※1 本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	2,198,000,000 円	4,158,164,073 円
同期中における追加設定元本額	1,960,164,073 円	2,082,062,242 円
同期中における一部解約元本額	－円	464,042,397 円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
りそな・東京応援・資産分散ファンド	4,158,164,073 円	5,776,183,918 円
計	4,158,164,073 円	5,776,183,918 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	4,158,164,073 口	5,776,183,918 口

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成 19 年 2 月 13 日現在		平成 19 年 8 月 13 日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	4,529,991,200	381,435,678	5,852,168,350	△ 539,138,173
合 計	4,529,991,200	381,435,678	5,852,168,350	△ 539,138,173

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成 18 年 9 月 27 日から平成 19 年 2 月 13 日まで、及び平成 19 年 2 月 14 日から平成 19 年 8 月 13 日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日		
関連当事者の名称 (当ファンドと当該関連当事者との関係)	取引の内容	取引の種類別の取引金額	取引により発生した債権又は債務に係る主な項目別の当該計算期間の末日における残高
大和証券 (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 2,850,923円	委託手数料の未受渡金額 未払金 309,150円
大和証券SMBC (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 1,377,528円	委託手数料の未受渡金額 未払金 ー円

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針

社内規定により取引業者の選定を行っております。また、各資産の売買においては、社内基準に基づき最良執行を行っており、個々の取引条件はその結果として決定されております。なお、ビット（オファー）やベークスを引合い条件に用いる取引については、相見積もりをとっており、一般の取引と条件が同様と判断しております。当該取引の売買手数料相当額については、取引慣行上、取引総額に含まれますため金額を記載しておりません。

2. 取引条件の変更及び当該変更が計算書類に与えている影響
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1248円 (11,248円)	1.0337円 (10,337円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
国際石油開発帝石	244	1,060,000	258,640,000	
日本電設工業	8,000	784	6,272,000	
ジェイ・エー・エー	12	156,000	1,872,000	
アサヒビール	60,400	1,705	102,982,000	
エスビー食品	4,500	943	4,243,500	
日本フェルト	2,900	766	2,221,400	
ADEKA	12,900	1,165	15,028,500	
ミヨシ油脂	10,000	200	2,000,000	
アステラス製薬	57,800	5,010	289,578,000	
エーザイ	37,000	5,110	189,070,000	
大正製薬	40,000	2,355	94,200,000	
太陽インキ製造	3,600	3,480	12,528,000	
東急コミュニティー	1,800	3,140	5,652,000	
シチエ	1,300	1,102	1,432,600	
東映アニメーション	1,800	2,735	4,923,000	
インデックス HLDGS	273	40,350	11,015,550	
ライオン	37,000	655	24,235,000	
新日本製鐵	326,000	824	268,624,000	
フジクラ	47,000	670	31,490,000	
牧野フライス	15,000	1,282	19,230,000	
ディスコ	4,200	6,870	28,854,000	
住友重機械	76,000	1,495	113,620,000	
日立建機	24,500	4,180	102,410,000	
岩崎通信機	13,000	164	2,132,000	
ソニー	47,300	5,730	271,029,000	
タムラ製作所	9,000	569	5,121,000	
ヨコオ	2,600	1,105	2,873,000	
スタンレー電気	23,500	2,620	61,570,000	
太陽誘電	15,000	2,390	35,850,000	
I H I	183,000	461	84,363,000	
いすゞ自動車	212,000	601	127,412,000	
カルソニックカンセイ	34,000	442	15,028,000	
本田技研	69,000	4,000	276,000,000	
シモジマ	3,000	1,207	3,621,000	
星医療酸器	500	1,740	870,000	
トプコン	11,600	2,030	23,548,000	
HOYA	54,300	3,920	212,856,000	
キヤノン	43,400	6,180	268,212,000	
タカラトミー	12,000	747	8,964,000	
ニッピ	1,000	510	510,000	

クリナップ	6,100	820	5,002,000	
天馬	3,900	1,946	7,589,400	
リンテック	9,600	2,300	22,080,000	
ファミリーマート	12,200	3,010	36,722,000	
東邦薬品	7,400	1,815	13,431,000	
チョダ	5,200	2,080	10,816,000	
光製作所	2,000	705	1,410,000	
丸井	46,000	1,374	63,204,000	
クレディセゾン	22,600	2,840	64,184,000	
三菱UFJフィナンシャルG	232	1,160,000	269,120,000	
野村ホールディングス	130,000	2,065	268,450,000	
損害保険ジャパン	123,000	1,350	166,050,000	
三井不動産	90,000	3,110	279,900,000	
住友不動産	59,000	3,880	228,920,000	
レオパレス21	19,900	3,680	73,232,000	
ジョイント・コーポレーション	5,500	3,090	16,995,000	
創建ホームズ	17	90,700	1,541,900	
東武鉄道	107,000	535	57,245,000	
東日本旅客鉄道	328	865,000	283,720,000	
日本航空	341,000	248	84,568,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1,510	166,000	250,660,000	
NTTデータ	350	511,000	178,850,000	
東京ドーム	24,000	547	13,128,000	
日本空港ビルデング	12,500	2,335	29,187,500	
セコム	29,100	5,260	153,066,000	
ソフトバンク	110,900	2,540	281,686,000	
東京デリカ	2,500	532	1,330,000	
合計	2,678,266		5,852,168,350	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第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。

「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

区 分	注記 番号	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
		金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		2,175,357,241	512,038,975
コール・ローン		3,874,843,111	218,080,536
国債証券		150,210,018,102	236,569,316,805
派生商品評価勘定		6,245,982	—
未収入金		—	79,267,518,916
未収利息		2,051,147,209	3,723,179,988
前払費用		1,388,407,240	985,178,802
流動資産合計		159,706,018,885	321,275,314,022
資産合計		159,706,018,885	321,275,314,022
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		10,351,434	—
未払金		932,837,575	80,135,313,077
未払解約金		—	50,000,000
流動負債合計		943,189,009	80,185,313,077
負債合計		943,189,009	80,185,313,077
純資産の部			
元本等			
元本	※1	143,257,058,815	211,774,879,720
剰余金			
期末剰余金		15,505,771,061	29,315,121,225
剰余金合計		15,505,771,061	29,315,121,225
元本等合計		158,762,829,876	241,090,000,945
純資産合計		158,762,829,876	241,090,000,945
負債・純資産合計		159,706,018,885	321,275,314,022

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、証券会社、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>	<p>国債証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>	<p>為替予約取引 同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
1. ※1 本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	65,852,173,711円	143,257,058,815円
同期中における追加設定元本額	83,058,873,925円	82,197,207,052円
同期中における一部解約元本額	5,653,988,821円	13,679,386,147円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
りそな・世界資産分散ファンド	128,589,749,129円	195,644,403,960円
ダイワ・ハイグレード・ソブリン・ファンド (毎月分配型)	986,774円	958,070円
りそな・東京応援・資産分散ファンド	4,147,547,337円	5,322,225,972円
りそな・埼玉応援・資産分散ファンド	2,537,606,940円	2,477,575,266円
りそな・多摩応援・資産分散ファンド	970,460,894円	800,442,742円
りそな・神奈川応援・資産分散ファンド	642,801,626円	548,795,689円
りそな・中部応援・資産分散ファンド	1,854,720,154円	2,546,118,122円
りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド	693,806,569円	580,631,102円
りそな・大阪応援・資産分散ファンド	3,344,814,790円	3,328,346,644円
りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド	474,564,602円	525,382,153円
計	143,257,058,815円	211,774,879,720円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	143,257,058,815口	211,774,879,720口

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成19年2月13日現在		平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含 まれた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含 まれた評価差額 (円)
国債証券	150,210,018,102	△ 2,776,862,954	236,569,316,805	△ 6,336,516,911
合 計	150,210,018,102	△ 2,776,862,954	236,569,316,805	△ 6,336,516,911

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成18年9月12日から平成19年2月13日まで、及び平成19年3月10日から平成19年8月13日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

I 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日	自 平成19年2月14日 至 平成19年8月13日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	外貨建有価証券等の買付代金の支払い及び保有する外貨建有価証券等の売却代金、償還金、利金等の受取りのため、外国為替予約を行っております。	外貨建資産の売買代金、利金、償還金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び、取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

II 取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	平成19年2月13日現在				平成19年8月13日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時 価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時 価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	3,519,177,412	—	3,515,071,960	△4,105,452	—	—	—	—
米ドル	880,008,378	—	882,247,260	2,238,882	—	—	—	—
カナダドル	438,106,303	—	441,883,760	3,777,457	—	—	—	—
豪ドル	444,060,679	—	439,982,070	△4,078,609	—	—	—	—
英ポンド	656,761,039	—	654,727,750	△2,033,289	—	—	—	—
ノルウェー クローネ	106,034,621	—	105,555,150	△479,471	—	—	—	—
スウェーデン クローナ	114,104,226	—	113,104,780	△999,446	—	—	—	—
ユーロ	880,102,166	—	877,571,190	△2,530,976	—	—	—	—
合 計	3,519,177,412	—	3,515,071,960	△4,105,452	—	—	—	—

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

- ① 特定期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 特定期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 特定期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 特定期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1082円 (11,082円)	1,1384円 (11,384円)

附属明細表

第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

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル		米ドル	米ドル	
		6.125% U.S. TREASURY NOTE 20070815	1,400,000.000	1,400,098.000	
		6.125% U.S. TREASURY NOTE 20070815	4,900,000.000	4,900,343.000	
		6.125% U.S. TREASURY NOTE 20070815	4,800,000.000	4,800,336.000	
		6.125% U.S. TREASURY NOTE 20070815	2,000,000.000	2,000,140.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	2,700,000.000	2,628,693.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	800,000.000	778,872.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	1,000,000.000	973,590.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	800,000.000	778,872.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	3,000,000.000	2,920,770.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	3,700,000.000	3,602,283.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	2,500,000.000	2,433,975.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	1,500,000.000	1,460,385.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	3,000,000.000	2,920,770.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	2,500,000.000	2,433,975.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	3,000,000.000	2,920,770.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	1,800,000.000	1,752,462.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	1,200,000.000	1,168,308.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	1,400,000.000	1,363,026.000	
		4.375% U.S. TREASURY NOTE 20081115	1,000,000.000	997,030.000	
		4.375% U.S. TREASURY NOTE 20081115	1,000,000.000	997,030.000	
		4.375% U.S. TREASURY NOTE 20080131	3,200,000.000	3,194,976.000	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20081031	34,800,000.000	34,905,792.000	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20081031	400,000.000	401,216.000	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20081031	500,000.000	501,520.000	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20081031	1,000,000.000	1,003,040.000	
		11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	1,800,000.000	2,528,154.000	
		9% U.S. TREASURY BOND 20181115	100,000.000	134,828.000	
		9% U.S. TREASURY BOND 20181115	100,000.000	134,828.000	
		9% U.S. TREASURY BOND 20181115	1,000,000.000	1,348,280.000	
		9% U.S. TREASURY BOND 20181115	1,000,000.000	1,348,280.000	
		9% U.S. TREASURY BOND 20181115	1,600,000.000	2,157,248.000	
9% U.S. TREASURY BOND 20181115	2,200,000.000	2,966,216.000			
9% U.S. TREASURY BOND 20181115	300,000.000	404,484.000			
9% U.S. TREASURY BOND 20181115	700,000.000	943,796.000			
9% U.S. TREASURY BOND 20181115	800,000.000	1,078,624.000			
9% U.S. TREASURY BOND 20181115	1,000,000.000	1,348,280.000			
9% U.S. TREASURY BOND 20181115	1,000,000.000	1,348,280.000			
9% U.S. TREASURY BOND 20181115	400,000.000	539,312.000			

9% U. S. TREASURY BOND 20181115	200,000.000	269,656.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	1,200,000.000	1,617,936.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	1,500,000.000	2,022,420.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	2,000,000.000	2,696,560.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	1,000,000.000	1,348,280.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	2,400,000.000	3,235,872.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	3,900,000.000	5,258,292.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	2,500,000.000	3,370,700.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	400,000.000	539,312.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	3,900,000.000	5,258,292.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	5,000,000.000	6,741,400.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	1,800,000.000	2,426,904.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	2,600,000.000	3,505,528.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	300,000.000	404,484.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	800,000.000	1,078,624.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	1,200,000.000	1,617,936.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	700,000.000	943,796.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	700,000.000	943,796.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	600,000.000	808,968.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	2,700,000.000	3,640,356.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	3,200,000.000	4,314,496.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	2,900,000.000	3,910,012.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	3,800,000.000	5,123,464.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	1,200,000.000	1,617,936.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	1,300,000.000	1,752,764.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	1,000,000.000	1,348,280.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	500,000.000	674,140.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	2,400,000.000	3,235,872.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	3,000,000.000	4,044,840.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	800,000.000	1,078,624.000	
9% U. S. TREASURY BOND 20181115	3,200,000.000	4,314,496.000	
8.75% U. S. TREASURY BOND 20200515	1,100,000.000	1,484,648.000	
7.875% U. S. TREASURY BOND 20210215	800,000.000	1,020,120.000	
7.875% U. S. TREASURY BOND 20210215	900,000.000	1,147,635.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	1,500,000.000	1,953,510.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	700,000.000	911,638.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	800,000.000	1,041,872.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	300,000.000	390,702.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	300,000.000	390,702.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	12,000,000.000	15,628,080.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	300,000.000	390,702.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	200,000.000	260,468.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	400,000.000	520,936.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	6,000,000.000	7,814,040.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	6,000,000.000	7,814,040.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	3,000,000.000	3,907,020.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	1,000,000.000	1,302,340.000	
8.125% U. S. TREASURY BOND 20210515	7,000,000.000	9,116,380.000	

8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	13,000,000.000	16,930,420.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	12,000,000.000	15,628,080.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	9,100,000.000	11,851,294.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	1,200,000.000	1,562,808.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	2,000,000.000	2,604,680.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	3,000,000.000	3,907,020.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	4,900,000.000	6,381,466.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	4,800,000.000	6,251,232.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	3,700,000.000	4,818,658.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	4,500,000.000	5,860,530.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	800,000.000	1,041,872.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	3,000,000.000	3,907,020.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	4,500,000.000	5,860,530.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	3,700,000.000	4,818,658.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	4,500,000.000	5,860,530.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	1,500,000.000	1,953,510.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	3,000,000.000	3,907,020.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	6,000,000.000	7,814,040.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	5,500,000.000	7,162,870.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	2,200,000.000	2,865,148.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	3,300,000.000	4,297,722.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	2,000,000.000	2,604,680.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	3,000,000.000	3,907,020.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	4,000,000.000	5,209,360.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	2,500,000.000	3,255,850.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	1,800,000.000	2,344,212.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	1,200,000.000	1,562,808.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	7,000,000.000	9,116,380.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	1,400,000.000	1,823,276.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210515	1,100,000.000	1,432,574.000	
8. 125% U. S. TREASURY BOND 20210815	30,500,000.000	39,811,955.000	
7. 625% U. S. TREASURY BOND 20221115	1,000,000.000	1,268,900.000	
7. 125% U. S. TREASURY BOND 20230215	1,200,000.000	1,460,616.000	
7. 5% U. S. TREASURY BOND 20241115	2,600,000.000	3,312,946.000	
7. 5% U. S. TREASURY BOND 20241115	1,100,000.000	1,401,631.000	
7. 625% U. S. TREASURY BOND 20250215	6,000,000.000	7,740,900.000	
7. 625% U. S. TREASURY BOND 20250215	11,000,000.000	14,191,650.000	
7. 625% U. S. TREASURY BOND 20250215	5,800,000.000	7,482,870.000	
7. 625% U. S. TREASURY BOND 20250215	3,500,000.000	4,515,525.000	
7. 625% U. S. TREASURY BOND 20250215	1,200,000.000	1,548,180.000	
7. 625% U. S. TREASURY BOND 20250215	1,700,000.000	2,193,255.000	
7. 625% U. S. TREASURY BOND 20250215	1,000,000.000	1,290,150.000	
7. 625% U. S. TREASURY BOND 20250215	500,000.000	645,075.000	
6. 875% U. S. TREASURY BOND 20250815	700,000.000	845,250.000	
6. 75% U. S. TREASURY BOND 20260815	900,000.000	1,079,154.000	
6. 5% U. S. TREASURY BOND 20261115	3,100,000.000	3,629,883.000	
6. 5% U. S. TREASURY BOND 20261115	300,000.000	351,279.000	
6. 625% U. S. TREASURY BOND 20270215	900,000.000	1,068,462.000	

	6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	2,400,000.000	2,782,488.000
	5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	1,000,000.000	1,042,650.000
米ドル	小計	米ドル 393,500,000.000 (46,543,180,000)	米ドル 487,961,838.000 (57,716,126,198)
カナダドル		カナダドル	カナダドル
	9.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20100601	400,000.000	451,484.000
	9.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20100601	1,000,000.000	1,128,710.000
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	3,200,000.000	4,430,816.000
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	3,800,000.000	5,261,594.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	600,000.000	922,608.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	6,300,000.000	9,687,384.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	4,500,000.000	6,919,560.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	5,000,000.000	7,688,400.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	700,000.000	1,076,376.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,300,000.000	1,998,984.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,700,000.000	2,614,056.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,500,000.000	3,844,200.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,500,000.000	3,844,200.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,000,000.000	3,075,360.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,300,000.000	3,536,664.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	400,000.000	615,072.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,600,000.000	2,460,288.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,200,000.000	3,382,896.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,000,000.000	3,075,360.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,000,000.000	3,075,360.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,000,000.000	1,537,680.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,200,000.000	1,845,216.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,400,000.000	3,690,432.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,000,000.000	3,075,360.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,100,000.000	1,691,448.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,200,000.000	1,845,216.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,000,000.000	1,537,680.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,400,000.000	2,152,752.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,600,000.000	2,460,288.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,300,000.000	1,998,984.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	800,000.000	1,230,144.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	800,000.000	1,230,144.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,000,000.000	3,075,360.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	700,000.000	1,076,376.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,100,000.000	1,691,448.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,600,000.000	2,460,288.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	100,000.000	153,768.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	100,000.000	153,768.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	500,000.000	768,840.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	400,000.000	615,072.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	100,000.000	153,768.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	400,000.000	615,072.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	400,000.000	615,072.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	500,000.000	768,840.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	600,000.000	922,608.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	300,000.000	461,304.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	200,000.000	307,536.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	300,000.000	461,304.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,500,000.000	2,306,520.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,000,000.000	1,537,680.000
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	200,000.000	307,536.000

9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,900,000.000	2,921,592.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,500,000.000	3,844,200.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,700,000.000	2,614,056.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	500,000.000	768,840.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,000,000.000	1,537,680.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,400,000.000	2,152,752.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	800,000.000	1,230,144.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	400,000.000	615,072.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	500,000.000	768,840.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,400,000.000	2,152,752.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,100,000.000	1,691,448.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,400,000.000	2,152,752.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,500,000.000	2,306,520.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	700,000.000	1,076,376.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	200,000.000	307,536.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,000,000.000	3,075,360.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	400,000.000	615,072.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	500,000.000	768,840.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,600,000.000	2,460,288.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	800,000.000	1,230,144.000
9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,400,000.000	3,690,432.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	11,000,000.000	15,924,370.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	700,000.000	1,013,369.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	400,000.000	579,068.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	400,000.000	579,068.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	200,000.000	289,534.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	100,000.000	144,767.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	2,000,000.000	2,895,340.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	200,000.000	289,534.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	200,000.000	289,534.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	4,000,000.000	5,790,680.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,500,000.000	2,171,505.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,000,000.000	1,447,670.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	700,000.000	1,013,369.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	8,000,000.000	11,581,360.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,000,000.000	1,447,670.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,700,000.000	2,461,039.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	3,800,000.000	5,501,146.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	2,000,000.000	2,895,340.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	2,000,000.000	2,895,340.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	3,000,000.000	4,343,010.000
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,200,000.000	1,737,204.000
4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20090901	6,900,000.000	6,858,393.000
4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20090901	600,000.000	596,382.000
4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20090901	1,000,000.000	993,970.000
4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20090901	500,000.000	496,985.000
4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20090901	700,000.000	695,779.000
5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	2,000,000.000	2,182,560.000
5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	2,000,000.000	2,182,560.000
5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	400,000.000	436,512.000
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	1,100,000.000	1,058,948.000
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	2,000,000.000	1,942,820.000
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1,500,000.000	1,457,115.000
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	5,000,000.000	4,857,050.000
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	2,000,000.000	1,942,820.000
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	2,300,000.000	2,234,243.000
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	400,000.000	388,564.000
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1,600,000.000	1,554,256.000

	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	2, 200, 000. 000	2, 137, 102. 000
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	2, 000, 000. 000	1, 942, 820. 000
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1, 000, 000. 000	971, 410. 000
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1, 000, 000. 000	971, 410. 000
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	2, 400, 000. 000	2, 331, 384. 000
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	2, 000, 000. 000	1, 942, 820. 000
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1, 200, 000. 000	1, 165, 692. 000
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1, 500, 000. 000	1, 457, 115. 000
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1, 600, 000. 000	1, 554, 256. 000
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	800, 000. 000	777, 128. 000
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	800, 000. 000	777, 128. 000
	3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	6, 000, 000. 000	5, 828, 460. 000
カナダドル	小計	カナダドル 196, 100, 000. 000 (22, 010, 264, 000)	カナダドル 266, 843, 171. 000 (29, 950, 477, 513)
豪ドル		豪ドル	豪ドル
	6. 5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20130515	480, 000. 000	489, 849. 600
	6. 5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20130515	200, 000. 000	204, 104. 000
	6. 5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1, 500, 000. 000	1, 530, 780. 000
	6. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	1, 000, 000. 000	1, 017, 250. 000
	6. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	10, 000, 000. 000	10, 172, 500. 000
	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	299, 000, 000. 000	300, 823, 900. 000
	5. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	1, 000, 000. 000	944, 290. 000
	5. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	700, 000. 000	661, 003. 000
	5. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	600, 000. 000	566, 574. 000
	5. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	200, 000. 000	188, 858. 000
豪ドル	小計	豪ドル 314, 680, 000. 000 (31, 493, 174, 400)	豪ドル 316, 599, 108. 600 (31, 685, 238, 788)
英ポンド		英ポンド	英ポンド
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 400, 000. 000	1, 781, 920. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	100, 000. 000	127, 280. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	100, 000. 000	127, 280. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	400, 000. 000	509, 120. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	500, 000. 000	636, 400. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	700, 000. 000	890, 960. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 200, 000. 000	1, 527, 360. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	100, 000. 000	127, 280. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	400, 000. 000	509, 120. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	400, 000. 000	509, 120. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	600, 000. 000	763, 680. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	400, 000. 000	509, 120. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	300, 000. 000	381, 840. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	100, 000. 000	127, 280. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	300, 000. 000	381, 840. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 300, 000. 000	1, 654, 640. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 600, 000. 000	2, 036, 480. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 400, 000. 000	1, 781, 920. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	300, 000. 000	381, 840. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 600, 000. 000	2, 036, 480. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	2, 200, 000. 000	2, 800, 160. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 400, 000. 000	1, 781, 920. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 400, 000. 000	1, 781, 920. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	500, 000. 000	636, 400. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	800, 000. 000	1, 018, 240. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 200, 000. 000	1, 527, 360. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	800, 000. 000	1, 018, 240. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	300, 000. 000	381, 840. 000
	8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	400, 000. 000	509, 120. 000

8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 200, 000. 000	1, 527, 360. 000
8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 500, 000. 000	1, 909, 200. 000
8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 300, 000. 000	1, 654, 640. 000
8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	1, 600, 000. 000	2, 036, 480. 000
8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	500, 000. 000	636, 400. 000
8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	400, 000. 000	509, 120. 000
8. 75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	2, 000, 000. 000	2, 545, 600. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	400, 000. 000	471, 240. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	500, 000. 000	640, 650. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	300, 000. 000	384, 390. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	300, 000. 000	384, 390. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	200, 000. 000	256, 260. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	100, 000. 000	128, 130. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	200, 000. 000	256, 260. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	200, 000. 000	256, 260. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	500, 000. 000	640, 650. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	2, 000, 000. 000	2, 562, 600. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	2, 000, 000. 000	2, 562, 600. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 000, 000. 000	1, 281, 300. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	400, 000. 000	512, 520. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	600, 000. 000	768, 780. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	2, 000, 000. 000	2, 562, 600. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 500, 000. 000	1, 921, 950. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 900, 000. 000	2, 434, 470. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	3, 100, 000. 000	3, 972, 030. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	2, 500, 000. 000	3, 203, 250. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	2, 500, 000. 000	3, 203, 250. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	4, 000, 000. 000	5, 125, 200. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	2, 200, 000. 000	2, 818, 860. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	2, 000, 000. 000	2, 562, 600. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	3, 000, 000. 000	3, 843, 900. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	4, 800, 000. 000	6, 150, 240. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	4, 000, 000. 000	5, 125, 200. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	6, 100, 000. 000	7, 815, 930. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	600, 000. 000	768, 780. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 200, 000. 000	1, 537, 560. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 500, 000. 000	1, 921, 950. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 900, 000. 000	2, 434, 470. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 800, 000. 000	2, 306, 340. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	2, 300, 000. 000	2, 946, 990. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 800, 000. 000	2, 306, 340. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	300, 000. 000	384, 390. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 300, 000. 000	1, 665, 690. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 600, 000. 000	2, 050, 080. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 400, 000. 000	1, 793, 820. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 500, 000. 000	1, 921, 950. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	800, 000. 000	1, 025, 040. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 500, 000. 000	1, 921, 950. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	2, 200, 000. 000	2, 818, 860. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	2, 000, 000. 000	2, 562, 600. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	900, 000. 000	1, 153, 170. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	900, 000. 000	1, 153, 170. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 000, 000. 000	1, 281, 300. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 000, 000. 000	1, 281, 300. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 700, 000. 000	2, 178, 210. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1, 400, 000. 000	1, 793, 820. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	600, 000. 000	768, 780. 000
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	500, 000. 000	640, 650. 000

8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	3,700,000.000	4,740,810.000	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	500,000.000	640,650.000	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1,000,000.000	1,281,300.000	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1,000,000.000	1,281,300.000	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1,700,000.000	2,178,210.000	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	600,000.000	768,780.000	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	400,000.000	512,520.000	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1,000,000.000	1,281,300.000	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1,300,000.000	1,665,690.000	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	400,000.000	512,520.000	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	900,000.000	1,153,170.000	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	2,000,000.000	2,562,600.000	
5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20080307	200,000.000	199,180.000	
5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20080307	500,000.000	497,950.000	
5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20080307	400,000.000	398,360.000	
5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20080307	600,000.000	597,540.000	
4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20090307	300,000.000	293,160.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	5,000,000.000	4,799,500.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	1,900,000.000	1,823,810.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	1,500,000.000	1,439,850.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	1,900,000.000	1,823,810.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	1,800,000.000	1,727,820.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	1,800,000.000	1,727,820.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	300,000.000	287,970.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	1,300,000.000	1,247,870.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	1,400,000.000	1,343,860.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	1,000,000.000	959,900.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	1,300,000.000	1,247,870.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	1,000,000.000	959,900.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	900,000.000	863,910.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	1,000,000.000	959,900.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	900,000.000	863,910.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	500,000.000	479,950.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	2,000,000.000	1,919,800.000	
英ポンド	小計	英ポンド 152,700,000.000 (36,548,745,000)	英ポンド 186,580,170.000 (44,657,963,689)
デンマーク クローネ		デンマーク クローネ	デンマーク クローネ
7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	1,900,000.000	2,441,424.000	
7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	1,500,000.000	1,927,440.000	
7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	2,400,000.000	3,083,904.000	
6% DANISH GOVERNMENT BOND 20111115	1,000,000.000	1,063,460.000	
6% DANISH GOVERNMENT BOND 20111115	4,100,000.000	4,360,186.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	1,000,000.000	1,033,600.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	500,000.000	516,800.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	500,000.000	516,800.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	300,000.000	310,080.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	1,000,000.000	1,033,600.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	500,000.000	516,800.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	1,000,000.000	1,033,600.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	7,000,000.000	7,235,200.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	7,000,000.000	7,235,200.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	6,000,000.000	6,201,600.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	2,000,000.000	2,067,200.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	5,000,000.000	5,168,000.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	5,000,000.000	5,168,000.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	12,000,000.000	12,403,200.000	
5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	4,000,000.000	4,134,400.000	

	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	14,000,000.000	14,470,400.000
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	18,000,000.000	18,604,800.000
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	4,500,000.000	4,651,200.000
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	18,000,000.000	18,604,800.000
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	25,000,000.000	25,840,000.000
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	1,300,000.000	1,343,680.000
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	1,000,000.000	1,033,600.000
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	1,300,000.000	1,343,680.000
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	1,200,000.000	1,240,320.000
デンマーク クローネ	小計	デンマーク クローネ 148,000,000.000 (3,223,440,000)	デンマーク クローネ 154,582,974.000 (3,366,817,174)
ノルウェー クローネ		ノルウェー クローネ	ノルウェー クローネ
	6% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20110516	1,200,000.000	1,240,620.000
	6% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20110516	1,000,000.000	1,033,850.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,000,000.000	1,074,360.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	500,000.000	537,180.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	200,000.000	214,872.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,000,000.000	1,074,360.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	500,000.000	537,180.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,000,000.000	1,074,360.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	500,000.000	537,180.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,500,000.000	1,611,540.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	7,000,000.000	7,520,520.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	7,000,000.000	7,520,520.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	6,000,000.000	6,446,160.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	2,000,000.000	2,148,720.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	10,000,000.000	10,743,600.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,500,000.000	1,611,540.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,000,000.000	1,074,360.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	3,500,000.000	3,760,260.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	8,000,000.000	8,594,880.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	10,000,000.000	10,743,600.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	10,500,000.000	11,280,780.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	11,500,000.000	12,355,140.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	8,000,000.000	8,594,880.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	15,000,000.000	16,115,400.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,200,000.000	1,289,232.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,500,000.000	1,611,540.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,000,000.000	1,074,360.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	6,000,000.000	6,446,160.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	6,000,000.000	6,446,160.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	11,500,000.000	12,355,140.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	2,000,000.000	2,148,720.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	9,000,000.000	9,669,240.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	14,000,000.000	15,041,040.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	10,000,000.000	10,743,600.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	11,000,000.000	11,817,960.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,500,000.000	1,611,540.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	3,000,000.000	3,223,080.000
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	3,000,000.000	3,223,080.000
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	3,000,000.000	3,008,760.000
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	2,400,000.000	2,407,008.000
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	2,400,000.000	2,407,008.000
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	600,000.000	601,752.000
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	2,300,000.000	2,306,716.000
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	12,000,000.000	12,035,040.000

ノルウェー クローネ	小計	ノルウェー クローネ 212,800,000.000 (4,324,096,000)	ノルウェー クローネ 226,912,998.000 (4,610,872,119)
スウェーデン クローナ		スウェーデン クローナ	スウェーデン クローナ
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,500,000.000	1,711,950.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	500,000.000	570,650.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	400,000.000	456,520.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,000,000.000	1,141,300.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	200,000.000	228,260.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	300,000.000	342,390.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	300,000.000	342,390.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	2,500,000.000	2,853,250.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,000,000.000	1,141,300.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	5,500,000.000	6,277,150.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,000,000.000	1,141,300.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	2,000,000.000	2,282,600.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	2,500,000.000	2,853,250.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	17,200,000.000	19,630,360.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,500,000.000	1,711,950.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	3,000,000.000	3,423,900.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	13,000,000.000	14,836,900.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	16,000,000.000	18,260,800.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	11,000,000.000	12,554,300.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	5,500,000.000	6,277,150.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	7,000,000.000	7,989,100.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,000,000.000	1,141,300.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,000,000.000	1,141,300.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,000,000.000	1,141,300.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,500,000.000	1,711,950.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,500,000.000	1,711,950.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	4,000,000.000	4,565,200.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	13,000,000.000	14,836,900.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	14,000,000.000	15,978,200.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	5,000,000.000	5,706,500.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	8,000,000.000	9,130,400.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	8,000,000.000	9,130,400.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	6,000,000.000	6,847,800.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	12,000,000.000	13,695,600.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	7,000,000.000	7,989,100.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	3,000,000.000	3,423,900.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	6,000,000.000	6,847,800.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	25,000,000.000	28,532,500.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	3,000,000.000	3,423,900.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	4,000,000.000	4,565,200.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	8,000,000.000	9,130,400.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	500,000.000	570,650.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	100,000.000	114,130.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	100,000.000	114,130.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	2,000,000.000	2,282,600.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	2,200,000.000	2,510,860.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	500,000.000	570,650.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,300,000.000	1,483,690.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	3,000,000.000	3,423,900.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	2,000,000.000	2,282,600.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	2,400,000.000	2,739,120.000
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,300,000.000	1,483,690.000

6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,300,000.000	1,483,690.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	700,000.000	798,910.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,200,000.000	1,369,560.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	6,900,000.000	7,874,970.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	8,200,000.000	9,358,660.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	7,400,000.000	8,445,620.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,400,000.000	1,597,820.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	8,400,000.000	9,586,920.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	10,400,000.000	11,869,520.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	7,000,000.000	7,989,100.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	3,400,000.000	3,880,420.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,100,000.000	1,255,430.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	2,100,000.000	2,396,730.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	3,000,000.000	3,423,900.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,700,000.000	1,940,210.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	800,000.000	913,040.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,100,000.000	1,255,430.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	2,700,000.000	3,081,510.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	3,200,000.000	3,652,160.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	2,300,000.000	2,624,990.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	4,500,000.000	5,135,850.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,900,000.000	2,168,470.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,100,000.000	1,255,430.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,000,000.000	1,141,300.000
6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	1,000,000.000	1,141,300.000
5.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20121008	3,700,000.000	3,903,500.000
5.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20121008	1,000,000.000	1,055,000.000
5.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20121008	3,000,000.000	3,165,000.000
5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	4,900,000.000	5,263,776.000
5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	3,000,000.000	3,222,720.000
5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	1,400,000.000	1,503,936.000
5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	2,300,000.000	2,470,752.000
5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	1,000,000.000	1,074,240.000
5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	2,400,000.000	2,578,176.000
スウェーデン 小計 クローナ	スウェーデン クローナ 347,800,000.000 (6,083,022,000)	スウェーデン クローナ 395,273,730.000 (6,913,337,537)
ユーロ	ユーロ	ユーロ
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20090704	13,500,000.000	13,451,400.000
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20090704	500,000.000	498,200.000
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20090704	900,000.000	896,760.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	37,500,000.000	49,588,875.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,000,000.000	1,322,370.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	600,000.000	793,422.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,000,000.000	1,322,370.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	2,500,000.000	3,305,925.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	4,600,000.000	6,082,902.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	2,000,000.000	2,644,740.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	4,500,000.000	5,950,665.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	7,900,000.000	10,446,723.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,200,000.000	1,586,844.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,400,000.000	1,851,318.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	2,800,000.000	3,702,636.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	400,000.000	528,948.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	2,000,000.000	2,644,740.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	2,700,000.000	3,570,399.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	2,300,000.000	3,041,451.000
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	2,200,000.000	2,909,214.000

7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	600,000.000	793,422.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,600,000.000	2,115,792.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	3,200,000.000	4,231,584.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	2,500,000.000	3,305,925.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	900,000.000	1,190,133.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,500,000.000	1,983,555.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,500,000.000	1,983,555.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	2,300,000.000	3,041,451.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	2,000,000.000	2,644,740.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,500,000.000	1,983,555.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,200,000.000	1,586,844.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	800,000.000	1,057,896.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	4,000,000.000	5,289,480.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,100,000.000	1,454,607.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	100,000.000	132,237.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	100,000.000	132,237.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	925,659.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,200,000.000	1,586,844.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	300,000.000	396,711.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	500,000.000	661,185.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	925,659.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	500,000.000	661,185.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	2,500,000.000	3,305,925.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,500,000.000	1,983,555.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	925,659.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	200,000.000	264,474.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	800,000.000	1,057,896.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,200,000.000	1,586,844.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	925,659.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	400,000.000	528,948.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	3,100,000.000	4,099,347.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	800,000.000	1,057,896.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	600,000.000	793,422.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	900,000.000	1,190,133.000
7. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	200,000.000	264,474.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	100,000.000	122,930.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	700,000.000	860,510.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	200,000.000	245,860.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	200,000.000	245,860.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	200,000.000	245,860.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	100,000.000	122,930.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	500,000.000	614,650.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	5,000,000.000	6,146,500.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	4,000,000.000	4,917,200.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,000,000.000	2,458,600.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	6,500,000.000	7,990,450.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	8,000,000.000	9,834,400.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	9,000,000.000	11,063,700.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	5,700,000.000	7,007,010.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	6,800,000.000	8,359,240.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	6,500,000.000	7,990,450.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	5,000,000.000	6,146,500.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,800,000.000	3,442,040.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	400,000.000	491,720.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,000,000.000	2,458,600.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,700,000.000	3,319,110.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,300,000.000	2,827,390.000
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,200,000.000	2,704,460.000

8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	600,000.000	737,580.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,600,000.000	1,966,880.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	3,200,000.000	3,933,760.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,500,000.000	3,073,250.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	900,000.000	1,106,370.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,500,000.000	1,843,950.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,800,000.000	2,212,740.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,000,000.000	2,458,600.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,500,000.000	1,843,950.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	800,000.000	983,440.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	6,000,000.000	7,375,800.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	500,000.000	614,650.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	800,000.000	983,440.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	700,000.000	860,510.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,000,000.000	1,229,300.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	200,000.000	245,860.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	900,000.000	1,106,370.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	500,000.000	614,650.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	300,000.000	368,790.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	3,200,000.000	3,933,760.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	3,000,000.000	3,687,900.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	600,000.000	737,580.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	100,000.000	122,930.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	4,400,000.000	5,408,920.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,900,000.000	3,564,970.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,300,000.000	2,827,390.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,600,000.000	1,966,880.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	700,000.000	860,510.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	800,000.000	983,440.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,200,000.000	1,475,160.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	700,000.000	860,510.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	600,000.000	737,580.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	500,000.000	614,650.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,200,000.000	2,704,460.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	3,100,000.000	3,810,830.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,500,000.000	3,073,250.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	3,200,000.000	3,933,760.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	800,000.000	983,440.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	400,000.000	491,720.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,100,000.000	2,581,530.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	2,500,000.000	3,073,250.000	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	200,000.000	245,860.000	
6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	1,000,000.000	1,211,410.000	
5% FINNISH GOVERNMENT BOND 20090425	300,000.000	303,534.000	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	500,000.000	596,110.000	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,000,000.000	2,384,440.000	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,000,000.000	2,384,440.000	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,800,000.000	3,338,216.000	
6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130131	1,400,000.000	1,519,910.000	
ユーロ 小計	ユーロ 283,700,000.000 (45,982,096,000)	ユーロ 355,802,590.000 (57,668,483,787)	
国債証券 合計	196,208,017,400 [196,208,017,400]	236,569,316,805 [236,569,316,805]	
合計	196,208,017,400 [196,208,017,400]	236,569,316,805 [236,569,316,805]	

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における () 内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における [] 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 21 銘柄	—%	100.0%	24.4%
カナダドル	国債証券 8 銘柄	—%	100.0%	12.7%
豪ドル	国債証券 4 銘柄	—%	100.0%	13.4%
英ポンド	国債証券 6 銘柄	—%	100.0%	18.9%
デンマーククローネ	国債証券 3 銘柄	—%	100.0%	1.4%
ノルウェークローネ	国債証券 3 銘柄	—%	100.0%	1.9%
スウェーデンクローナ	国債証券 3 銘柄	—%	100.0%	2.9%
ユーロ	国債証券 7 銘柄	—%	100.0%	24.4%

第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

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

「世界REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

区 分	注記 番号	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
		金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		1,581,385,276	5,815,754,750
コール・ローン		3,141,913,340	4,228,088,348
投資証券		158,804,120,085	215,247,259,054
派生商品評価勘定		217,089	8,261
未収入金		650,464,291	8,353,950
未収配当金		761,069,164	1,236,276,447
流動資産合計		164,939,169,245	226,535,740,810
資産合計		164,939,169,245	226,535,740,810
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		939,692	25,342
未払金		2,284,796,881	801,460,284
流動負債合計		2,285,736,573	801,485,626
負債合計		2,285,736,573	801,485,626
純資産の部			
元本等			
元本	※1	111,497,000,885	179,841,129,990
剰余金			
期末剰余金		51,156,431,787	45,893,125,194
剰余金合計		51,156,431,787	45,893,125,194
元本等合計		162,653,432,672	225,734,255,184
純資産合計		162,653,432,672	225,734,255,184
負債・純資産合計		164,939,169,245	226,535,740,810

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 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、証券取引所又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、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。</p>	<p>投資証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、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、原則として本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>	<p>為替予約取引 同左</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、投資証券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を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>	<p>受取配当金 同左</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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) 第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

	等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	
--	---	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
1. ※1 本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	58,526,240,508 円	111,497,000,885 円
同期中における追加設定元本額	56,691,479,689 円	77,979,097,740 円
同期中における一部解約元本額	3,720,719,312 円	9,634,968,635 円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
りそな・世界資産分散ファンド	100,146,555,074 円	165,762,176,165 円
りそな・東京応援・資産分散ファンド	3,143,026,561 円	4,733,042,509 円
りそな・埼玉応援・資産分散ファンド	1,926,100,959 円	2,146,422,841 円
りそな・多摩応援・資産分散ファンド	783,681,086 円	689,808,731 円
りそな・神奈川応援・資産分散ファンド	520,947,936 円	457,313,617 円
りそな・中部応援・資産分散ファンド	1,484,364,868 円	2,187,205,386 円
りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド	530,689,495 円	488,854,738 円
りそな・大阪応援・資産分散ファンド	2,583,770,131 円	2,911,535,308 円
りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド	377,864,775 円	464,770,695 円
計	111,497,000,885 円	179,841,129,990 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	111,497,000,885 口	179,841,129,990 口

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成19年2月13日現在		平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含ま れた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含ま れた評価差額 (円)
投資証券	158,804,120,085	15,640,600,497	215,247,259,054	△ 32,605,995,911
合 計	158,804,120,085	15,640,600,497	215,247,259,054	△ 32,605,995,911

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成18年9月12日から平成19年2月13日まで、及び平成19年3月10日から平成19年8月13日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

I 取引状況に関する事項

区 分	自平成18年9月27日 至平成19年2月13日	自平成19年2月14日 至平成19年8月13日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	外貨建有価証券等の買付代金の支払い及び保有する外貨建有価証券等の売却代金、償還金、利金等の受取りのため、外国為替予約を行っております。	外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び、取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスク	同左

	の大きさを示すものではありません。
--	-------------------

II 取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	平成 19 年 2 月 13 日現在				平成 19 年 8 月 13 日現在			
	契約額等 (円)	うち 1 年超	時 価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1 年超	時 価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	946,216,082	—	946,061,143	154,939	48,851,835	—	48,843,574	8,261
米ドル	841,614,551	—	841,476,310	138,241	48,851,835	—	48,843,574	8,261
豪ドル	39,887,904	—	39,879,409	8,495	—	—	—	—
ユーロ	64,713,627	—	64,705,424	8,203	—	—	—	—
買 建	3,381,096,082	—	3,380,218,540	△ 877,542	48,851,835	—	48,826,493	△25,342
米ドル	2,539,481,531	—	2,539,441,674	△ 39,857	—	—	—	—
カナダドル	184,805,832	—	184,214,366	△ 591,466	—	—	—	—
シンガポール ドル	11,865,039	—	11,861,738	△ 3,301	—	—	—	—
英ポンド	644,943,680	—	644,700,762	△ 242,918	48,851,835	—	48,826,493	△25,342
合 計	4,327,312,164	—	4,326,279,683	△722,603	97,703,670	—	97,670,067	△17,081

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

- ① 特定期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 特定期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 特定期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 特定期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4588円 (14,588円)	1.2552円 (12,552円)

附属明細表

第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

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル			米ドル	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	263,900	24,012,261.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	382,842	38,766,580.920	
		BIOMED REALTY TRUST INC	571,528	14,282,484.720	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	449,600	18,599,952.000	
		VORNADO REALTY TRUST	217,367	22,671,378.100	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,033,734	40,605,071.520	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	1,641,300	35,353,602.000	
		SOVRAN SELF STORAGE INC	520,693	22,764,697.960	
		VENTAS INC	704,500	24,763,175.000	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	501,489	11,955,497.760	
		BRE PROPERTIES-CL A	267,200	14,228,400.000	
		CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	510,125	15,038,485.000	
		MACK-CALI REALTY CORP	587,100	22,979,094.000	
		COLONIAL PROPERTIES TRUST	508,220	16,171,560.400	
		DEVELOPERS DIV REALTY	376,260	18,406,639.200	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	244,800	10,489,680.000	
		EQUITY ONE INC	597,765	15,356,582.850	
		GLIMCHER REALTY TRUST	176,893	3,688,219.050	
		HEALTH CARE PPTYS INVEST	391,943	10,939,129.130	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	244,607	8,363,113.330	
		HOME PROPERTIES INC	270,000	13,637,700.000	
		HOSPITALITY PROPERTIES	343,064	12,861,469.360	
		HRPT PROPERTIES TRUST	706,000	7,229,440.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	1,460,198	51,764,019.100	
		MID-AMERICA APARTMENT COM	389,500	18,571,360.000	
		MISSION WEST PROPERTIES	223,210	2,678,520.000	
		NATIONWIDE HEALTH PPTYS	390,368	10,118,338.560	
		PARKWAY PROPERTIES INC	229,521	10,011,706.020	
		SENIOR HOUSING PROP TRUST	762,222	14,939,551.200	
		UDR INC	491,234	11,779,791.320	
		WASHINGTON REAL ESTATE IN	449,300	14,287,740.000	
		EQUITY INNS INC 8.75% B	23,500	482,925.000	
		HEALTH CARE REIT 7.875% D	64,200	1,537,590.000	
		COLONIAL PROPS 8.125% D	50,400	1,260,000.000	
		CBL&ASSOC PROP 7.75% C	35,200	846,912.000	
		COUSINS PROPERTY 7.75% A	52,500	1,296,750.000	
		DEVELOP DIV RLTY 7.375% H	52,100	1,254,047.000	
		MAGUIRE PROPS 7.625% A	48,000	960,000.000	
		SL GREEN REALTY 7.625% C	50,700	1,252,290.000	
PS BUSINESS PARK 7% H	127,400	2,833,376.000			
PS BUSINESS PARK 6.875% I	51,600	1,142,940.000			
DEVELOP DIV RLTY 8% G	73,800	1,857,546.000			
DEVELOP DIV RLTY 7.5% I	64,600	1,550,400.000			
SL GREEN REALTY 7.875% D	53,600	1,326,064.000			
APARTMENT INVEST 8% T	203,500	4,975,575.000			
APARTMENT INVEST 7.75% U	69,400	1,648,250.000			
BRANDYWINE RLTY 7.375% D	34,700	815,450.000			
BRANDYWINE RLTY 7.5% C	32,100	764,622.000			
HEALTH CARE PPTY 7.1% F	183,800	4,267,836.000			

HOSPITALITY PROP 8.875% B	50,633	1,273,419.950	
HRPT PROPERTIES 8.75% B	60,000	1,497,000.000	
PROLOGIS TRUST 6.75% F	43,000	997,600.000	
SAUL CENTERS INC 8% A	53,800	1,334,240.000	
WEINGARTEN RLTY 6.75% D	181,500	4,365,075.000	
INLAND REAL ESTATE CORP	672,000	9,864,960.000	
STRATEGIC HOTELS&RESORTS	1,123,800	23,678,466.000	
HEALTH CARE REIT 7.625% F	59,900	1,437,600.000	
CORP OFFICE PROPS 8% G	62,200	1,493,422.000	
CORP OFFICE PROPS 7.5% H	48,000	1,112,640.000	
APARTMENT INVEST 8% V	35,200	853,600.000	
PS BUSINESS PARK 7.6% L	46,200	1,116,192.000	
ASHFORD HOSPITAL 8.55% A	27,300	666,120.000	
U-STORE-IT TRUST	361,700	4,709,334.000	
KILROY REALTY CORP 7.5% F	43,975	1,044,406.250	
CEDAR SHOPPING CENTERS	1,051,600	13,281,708.000	
TANGER FACTORY 7.50% C	53,900	1,320,550.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	301,600	4,542,096.000	
CBL&ASSOC PROP 7.375% D	67,890	1,585,910.400	
COUSINS PROPERTY 7.5% B	60,600	1,457,430.000	
VORNADO RLTY TST 6.625% G	91,510	1,996,748.200	
APARTMENT INVEST 7.875% Y	57,800	1,390,090.000	
ENTERTAINMENT PROP7.75% B	27,300	616,980.000	
DIGITAL REALTY 8.5% A	37,200	933,720.000	
SUNSTONE HOTEL 8% A	59,000	1,410,100.000	
TAUBMAN CENTERS 7.625% H	48,700	1,179,514.000	
DIGITAL REALTY 7.875% B	31,000	742,450.000	
PS BUSINESS PARKS 7.2% M	121,900	2,840,270.000	
REGENCY CENTERS 7.25% D	90,300	2,192,484.000	
VORNADO REALTY TST 6.75%F	166,900	3,738,560.000	
VORNADO REALTY TST 6.75%H	100,900	2,233,926.000	
LASALLE HOTEL 7.5000% D	37,600	876,080.000	
LASALLE HOTEL 8% E	88,200	2,182,950.000	
EQUITY INNS INC 8% C	24,500	502,005.000	
HRPT PROPERTIES 7.125% C	149,100	3,544,107.000	
AMB PROPERTY 7.0% O	26,000	603,200.000	
PUBLIC STORAGE 6.95% H	135,100	3,164,042.000	
STRATEGIC HOTEL 8.25% C	55,000	1,306,250.000	
PUBLIC STORAGE INC I	146,200	3,600,906.000	
PS BUSINESS PARK 7.375% O	58,300	1,372,965.000	
DUKE REALTY CORP 7.25% N	44,000	1,075,800.000	
CORP OFFICE PROPS J	18,100	417,929.000	
PUBLIC STORAGE INC -K	236,500	5,791,885.000	
PUBLIC STORAGE INC E	40,100	911,072.000	
NAT'L RETAIL PROP CL C	142,200	3,425,598.000	
PUBLIC STORAGE INC L	459,600	10,483,476.000	
LASALLE HOTEL G	137,000	3,301,700.000	
REALTY INCOME PFD E	289,200	6,492,540.000	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	1,381,953	14,676,340.860	
PUBLIC STORAGE INC M	400,100	9,062,265.000	
PS BUSINESS PARK P	159,600	3,437,784.000	
BIOMED REALTY 7.375 A	228,000	5,016,000.000	
WEINGARTEN RLTY F	192,200	4,324,500.000	
HOSPITALITY PROP C	210,000	4,672,500.000	
FIRST IND REALTY 7.25% J	146,700	3,250,872.000	
STRATEGIC HOTEL 8.25% B	38,900	941,380.000	
DUKE REALTY CORP 6.95% M	129,000	3,032,790.000	

米ドル	小計	27,388,044	米ドル 781,761,361.160 (92,466,733,798)
カナダドル			カナダドル
	CAN REAL ESTATE INVEST TR	672,000	20,294,400.000
	BOARDWALK REAL ESTATE INV	636,800	28,656,000.000
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTA	1,362,475	24,865,168.750
カナダドル	小計	2,671,275	カナダドル 73,815,568.750 (8,285,059,437)
豪ドル			豪ドル
	TISHMAN SPEYER OFFICE FUN	17,140,000	39,764,800.000
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	7,691,610	16,613,877.600
	COMMONWEALTH PROPERTY OFF	9,414,800	15,722,716.000
	DB RREEF TRUST	17,619,300	33,829,056.000
	GPT GROUP	6,802,706	31,972,718.200
	ING INDUSTRIAL FUND	6,752,998	17,017,554.960
	ING OFFICE FUND	15,421,046	26,215,778.200
	MACQUARIE COUNTRYWIDE TRU	20,761,736	40,277,767.840
	MACQUARIE DDR TRUST	34,417,400	41,300,880.000
	MIRVAC GROUP	1,920,000	10,368,000.000
	STOCKLAND	2,014,225	16,415,933.750
	WESTFIELD GROUP	4,517,720	86,288,452.000
	RUBICON EUROPE TRUST GROU	14,820,000	14,079,000.000
豪ドル	小計	159,293,541	豪ドル 389,866,534.550 (39,017,842,778)
香港ドル			香港ドル
	LINK REIT	10,462,500	172,212,750.000
	CHAMPION REIT	34,199,042	140,558,062.620
	FORTUNE REAL ESTATE INVES	24,842,000	139,115,200.000
香港ドル	小計	69,503,542	香港ドル 451,886,012.620 (6,832,516,511)
シンガポールドル			シンガポールドル
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	9,733,000	24,624,490.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	7,860,400	20,122,624.000
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	10,131,000	12,765,060.000
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	4,530,000	7,655,700.000
シンガポールドル	小計	32,254,400	シンガポールドル 65,167,874.000 (5,070,060,597)
ニュージーランドドル			ニュージーランドドル
	KIWI INCOME PROPERTY TRU	6,287,500	9,179,750.000
	AMP NZ OFFICE TRUST	10,975,278	13,828,850.280
ニュージーランドドル	小計	17,262,778	ニュージーランドドル 23,008,600.280 (2,027,517,856)
英ポンド			英ポンド
	LAND SECURITIES PLC	2,586,400	43,736,024.000
	SEGRO	3,986,500	21,148,382.500
	HAMMERSON PLC	1,222,579	15,343,366.450
	BRITISH LAND CO PLC	2,617,206	30,673,654.320
	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	915,030	10,028,728.800
	BRIXTON PLC	3,263,687	11,373,949.190

	DERWENT LONDON PLC	376,031	6,941,532.260	
英ポンド	小計	14,967,433	英ポンド 139,245,637.520 (33,328,443,341)	
ユーロ	CORIO NV	253,121	ユーロ 13,744,470.300	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-C	187,742	7,032,815.320	
	VASTNED OFFICES/INDUSTRIA	630,096	15,311,332.800	
	VASTNED RETAIL NV	114,907	6,549,699.000	
	UNIBAIL-RODAMCO	430,507	74,990,014.330	
	KLEPIERRE	59,700	6,861,321.000	
	FONCIERE DES REGIONS	306,010	35,292,133.300	
	SILIC	60,334	7,802,392.880	
	BEFIMMO S. C. A	71,627	5,138,520.980	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	31,645	1,383,202.950	
ユーロ	小計	2,145,689	ユーロ 174,105,902.860 (28,219,084,736)	
投資証券	合計		215,247,259,054 [215,247,259,054]	
合計			215,247,259,054 [215,247,259,054]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における () 内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における [] 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 106 銘柄	—%	100%	43.0%
カナダドル	投資証券 3 銘柄	—%	100%	3.8%
豪ドル	投資証券 13 銘柄	—%	100%	18.1%
香港ドル	投資証券 3 銘柄	—%	100%	3.2%
シンガポール ドル	投資証券 4 銘柄	—%	100%	2.4%
ニュージー ランドドル	投資証券 2 銘柄	—%	100%	0.9%
英ポンド	投資証券 7 銘柄	—%	100%	15.5%
ユーロ	投資証券 10 銘柄	—%	100%	13.1%

第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
「注記表 (デリバティブ取引等関係に関する注記)」に記載しております。

りそな・埼玉応援・資産分散ファンド

(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）並びに同規則第2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、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か月未満であるため、財務諸表は6か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、前特定期間（平成18年9月27日から平成19年2月13日まで）及び当特定期間（平成19年2月14日から平成19年8月13日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 3 月 30 日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員

公認会計士

三浦邦仁 

指定社員
業務執行社員

公認会計士

久野佳樹 

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・埼玉応援・資産分散ファンドの平成 18 年 9 月 27 日から平成 19 年 2 月 13 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、注記表並びに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・埼玉応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 13 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。

大和証券投資信託委託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

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 9 月 28 日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士
業務執行社員

山元 丸志 

指定社員 公認会計士
業務執行社員

久野 佳樹 

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・埼玉応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 14 日から平成 19 年 8 月 13 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、注記表並びに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・埼玉応援・資産分散ファンドの平成 19 年 8 月 13 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。

大和証券投資信託委託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・埼玉応援・資産分散ファンド

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		平成19年2月13日現在 金 額 (円)	平成19年8月13日現在 金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		352,493,594	200,525,999
親投資信託受益証券		8,466,976,415	8,192,862,497
流動資産合計		8,819,470,009	8,393,388,496
資産合計		8,819,470,009	8,393,388,496
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		102,408,108	17,863,188
未払解約金		—	10,478,916
未払受託者報酬		338,689	391,005
未払委託者報酬		8,128,706	9,384,237
その他未払費用		182,780	362,120
流動負債合計		111,058,283	38,479,466
負債合計		111,058,283	38,479,466
純資産の部			
元本等			
元本	※1	8,614,522,613	8,931,594,038
剰余金			
期末剰余金		93,889,113	—
期末欠損金		—	576,685,008
(うち分配準備積立金)		(4,899,145)	(74,611,705)
剰余金合計	※2	93,889,113	△576,685,008
元本等合計		8,708,411,726	8,354,909,030
純資産合計		8,708,411,726	8,354,909,030
負債・純資産合計		8,819,470,009	8,393,388,496

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
		金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益			
受取利息		174,919	649,002
有価証券売買等損益		506,976,415	△494,113,918
営業収益合計		507,151,334	△493,464,916
営業費用			
受託者報酬		1,218,915	2,414,724
委託者報酬	※1	29,254,928	57,954,565
その他費用		182,780	386,120
営業費用合計		30,656,623	60,755,409
営業利益金額		476,494,711	—
営業損失金額		—	554,220,325
経常利益金額		476,494,711	—
経常損失金額		—	554,220,325
当期純利益金額		476,494,711	—
当期純損失金額		—	554,220,325
一部解約に伴う当期純利益金額分配額		265,553	4,310,539
期首剰余金		—	93,889,113
剰余金増加額		89,199,437	2,459,526
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)		(89,199,437)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)		(—)	(2,459,526)
剰余金減少額		308,446	4,124,868
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)		(308,446)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)		(—)	(4,124,868)
分配金	※2	471,231,036	110,377,915
期末剰余金		93,889,113	—
期末欠損金		—	576,685,008

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1. ※1 期首元本額	4,114,198,196 円	8,614,522,613 円
期中追加設定元本額	4,528,336,286 円	1,151,006,022 円
期中一部解約元本額	28,011,869 円	833,934,597 円
2. 特定期間末日における受益権 の総数	8,614,522,613 口	8,931,594,038 口
3. ※2 元本の欠損	—————	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 576,685,008 円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	3,584,238 円	6,771,221 円
2. ※2 分配金の計算過程	<p>(自平成 18 年 9 月 27 日 至平成 18 年 10 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (12,801,621 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (41,546,035 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (7,854,620 円) 及び分配準備積立金 (0 円) より分配対象額は 62,202,276 円 (1 万口当たり 131.51 円) でありましたが、分配を行っておりません。</p> <p>(自平成 18 年 10 月 14 日 至平成 18 年 11 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (6,180,182 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (7,592,312 円) 及び分配準備積立金 (54,347,656 円) より分配対象額は 68,120,150 円 (1 万口当たり 128.96 円) でありませんが、分配を行っておりません。</p> <p>(自平成 18 年 11 月 14 日 至平成 18 年 12 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (10,713,214 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券</p>	<p>(自平成 19 年 2 月 14 日 至平成 19 年 3 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (5,491,376 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (43,108,400 円) 及び分配準備積立金 (4,877,896 円) より分配対象額は 53,477,672 円 (1 万口当たり 56.75 円) であり、うち 18,811,722 円 (1 万口当たり 19.96 円) を分配金額としております。</p> <p>(自平成 19 年 3 月 14 日 至平成 19 年 4 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (39,133,127 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (76,170,079 円) 及び分配準備積立金 (0 円) より分配対象額は 115,303,206 円 (1 万口当たり 120.18 円) であり、うち 19,096,098 円 (1 万口当たり 19.90 円) を分配金額としております。</p> <p>(自平成 19 年 4 月 14 日 至平成 19 年 5 月 14 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (26,697,319 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券</p>

<p> 売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(151,155,785円)、投資信託約款に規定される収益調整金(27,649,724円)及び分配準備積立金(60,522,573円)より分配対象額は250,041,296円(1万口当たり439.96円)であり、うち192,145,156円(1万口当たり338.09円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成18年12月14日 至平成19年1月15日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(26,108,327円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(141,477,707円)、投資信託約款に規定される収益調整金(51,426,528円)及び分配準備積立金(30,196,578円)より分配対象額は249,209,140円(1万口当たり366.39円)であり、うち176,677,772円(1万口当たり259.76円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年1月16日 至平成19年2月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(17,456,288円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(68,794,960円)、投資信託約款に規定される収益調整金(88,989,968円)及び分配準備積立金(21,056,005円)より分配対象額は196,297,221円(1万口当たり227.87円)であり、うち102,408,108円(1万口当たり118.88円)を分配金額としております。 </p>	<p> 売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(56,760,181円)及び分配準備積立金(38,850,247円)より分配対象額は122,307,747円(1万口当たり127.66円)であり、うち18,576,251円(1万口当たり19.39円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年5月15日 至平成19年6月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,578,468円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(35,787,834円)及び分配準備積立金(64,540,571円)より分配対象額は109,906,873円(1万口当たり116.19円)であり、うち18,856,488円(1万口当たり19.93円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年6月14日 至平成19年7月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(44,311,428円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(36,083,730円)及び分配準備積立金(53,322,921円)より分配対象額は133,718,079円(1万口当たり146.24円)であり、うち17,174,168円(1万口当たり18.78円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年7月14日 至平成19年8月13日) </p>
--	--

		<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(13,968,832円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(34,046,021円)及び分配準備積立金(78,506,061円)より分配対象額は126,520,914円(1万口当たり141.66円)であり、うち17,863,188円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
--	--	---

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成19年2月13日現在		当 期 平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託 受益証券	8,466,976,415	94,866,766	8,192,862,497	△ 654,555,381
合 計	8,466,976,415	94,866,766	8,192,862,497	△ 654,555,381

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

前 期 自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日	当 期 自 平成19年2月14日 至 平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
該当事項はありません。	市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1. 0109 円 (10, 109 円)	0. 9354 円 (9, 354 円)

(4) 附属明細表

第 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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託 受益証券	埼玉応援マザーファンド	2, 777, 064, 357	2, 678, 200, 865	
	ハイグレード・ソブリン・マザーファンド	2, 477, 575, 266	2, 820, 471, 682	
	世界REITマザーファンド	2, 146, 422, 841	2, 694, 189, 950	
合計		7, 401, 062, 464	8, 192, 862, 497	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第 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。

(参考)

当ファンドは「埼玉応援マザーファンド」受益証券、「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」受益証券及び「世界REITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

「埼玉応援マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

区 分	注記 番号	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
		金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		257,620,390	42,205,839
株式		2,707,697,200	2,633,617,000
未収配当金		1,362,240	2,319,225
流動資産合計		2,966,679,830	2,678,142,064
資産合計		2,966,679,830	2,678,142,064
負債の部			
流動負債			
未払金		121,605,347	—
流動負債合計		121,605,347	—
負債合計		121,605,347	—
純資産の部			
元本等			
元本	※1	2,766,706,533	2,777,064,357
剰余金			
期末剰余金		78,367,950	—
期末欠損金		—	98,922,293
剰余金合計	※2	78,367,950	△98,922,293
元本等合計		2,845,074,483	2,678,142,064
純資産合計		2,845,074,483	2,678,142,064
負債・純資産合計		2,966,679,830	2,678,142,064

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>2. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>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段、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。</p> <p>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、未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。</p>	<p>株式 同左</p> <p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。ただし、平成 19 年 6 月 30 日以前に計上した受取配当金については、その金額が確定している場合には当該金額、未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。</p> <p>(会計方針の変更) 従来、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、未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いましたが、「投資信託に関する会計規則に関する細則」の改正により、平成 19 年 7 月 1 日以降計上する受取配当金については、原則として、株式の配当落ち日において、予想配当金額についてもその全額を計上する方法に変更しました。 この変更による損益への影響は軽微であります。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
1. ※1 本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	1,360,000,000円	2,766,706,533円
同期中における追加設定元本額	1,406,706,533円	246,369,604円
同期中における一部解約元本額	－円	236,011,780円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
りそな・埼玉応援・資産分散ファンド	2,766,706,533円	2,777,064,357円
計	2,766,706,533円	2,777,064,357円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	2,766,706,533口	2,777,064,357口
3. ※2 元本の欠損	――	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98,922,293円であります。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成19年2月13日現在		平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	2,707,697,200	33,560,704	2,633,617,000	△ 199,080,308
合 計	2,707,697,200	33,560,704	2,633,617,000	△ 199,080,308

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成18年9月27日から平成19年2月13日まで、及び平成19年2月14日から平成19年8月13日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

自平成18年9月27日 至平成19年2月13日	自平成19年2月14日 至平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日		
関連当事者の名称 (当ファンドと当該関連当事者との関係)	取引の内容	取引の種類別の取引金額	取引により発生した債権又は債務に係る主な項目別の当該計算期間の末日における残高
大和証券 (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 526,132円	委託手数料の未受渡金額 未払金 13,447円
大和証券SMBC (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 32,892円	委託手数料の未受渡金額 未払金 ー円

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針

社内規定により取引業者の選定を行っております。また、各資産の売買においては、社内基準に基づき最良執行を行っており、個々の取引条件はその結果として決定されております。なお、ビット（オファー）やベークスを引合い条件に用いる取引については、相見積もりをとっており、一般の取引と条件が同様と判断しております。当該取引の売買手数料相当額については、取引慣行上、取引総額に含まれますため金額を記載しておりません。

2. 取引条件の変更及び当該変更が計算書類に与えている影響
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0283円 (10,283円)	0.9644円 (9,644円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
三光ソフラン	30,000	146	4,380,000	
三国コカ・コーラ	30,800	1,195	36,806,000	
ウエルシア関東	4,400	3,750	16,500,000	
サイボー	4,800	870	4,176,000	
大正製薬	37,000	2,355	87,135,000	
東洋インキ	35,000	421	14,735,000	
ビー・エム・エル	2,500	1,640	4,100,000	
大成ラミック	3,600	2,715	9,774,000	
フコク	10,100	1,090	11,009,000	
川口金属	8,000	525	4,200,000	
三井金属	66,000	493	32,538,000	
三菱マテリアル	144,000	639	92,016,000	
古河スカイ	26,000	466	12,116,000	
エイチワン	12,600	1,410	17,766,000	
ファインシンター	10,000	519	5,190,000	
ボッシュ	52,000	566	29,432,000	
日特エンジニアリング	8,800	866	7,620,800	
大崎エンジニアリング	22	278,000	6,116,000	
SMC	8,300	15,290	126,907,000	
アイチコーポレーション	45,700	1,352	61,786,400	
椿本チエイン	22,000	792	17,424,000	
日本ピストンリング	48,000	228	10,944,000	
東芝	132,000	1,090	143,880,000	
安川電機	28,000	1,417	39,676,000	
沖電気	79,000	232	18,328,000	
サンケン電気	72,000	885	63,720,000	
ワコム	241	244,000	58,804,000	
日本信号	6,000	725	4,350,000	
日本電波工業	2,400	6,780	16,272,000	
クラリオン	163,000	166	27,058,000	
アドバンテスト	23,000	4,680	107,640,000	
芝浦電子	3,800	2,700	10,260,000	
エンプラス	12,000	1,744	20,928,000	
エフテック	7,100	2,670	18,957,000	
曙ブレーキ	64,000	780	49,920,000	
カルソニックカンセイ	31,000	442	13,702,000	
本田技研	31,900	4,000	127,600,000	
ショーワ	43,800	1,519	66,532,200	
八千代工業	12,800	1,577	20,185,600	
テイ・エス テック	16,100	4,620	74,382,000	

カップクリエイト	10,450	1,810	18,914,500	
安楽亭	9,000	786	7,074,000	
サイゼリヤ	30,100	1,740	52,374,000	
ハイデイ日高	6,500	1,130	7,345,000	
シグマ光機	3,700	1,350	4,995,000	
キヤノン電子	23,900	3,150	75,285,000	
タムロン	15,700	3,550	55,735,000	
エー・アンド・デイ	12,800	1,400	17,920,000	
ジェコー	7,000	487	3,409,000	
リズム時計	82,000	173	14,186,000	
中央化学	6,500	870	5,655,000	
ツツミ	11,600	2,765	32,074,000	
リンテック	8,800	2,300	20,240,000	
いなげや	5,000	904	4,520,000	
島忠	29,600	3,490	103,304,000	
しまむら	10,800	11,180	120,744,000	
伊勢丹	25,900	1,836	47,552,400	
ユニー	22,000	1,205	26,510,000	
ヤオコー	11,500	2,890	33,235,000	
りそなホールディングス	450	239,000	107,550,000	
武蔵野銀行	19,800	5,500	108,900,000	
東武鉄道	99,000	535	52,965,000	
日本梱包運輸	9,000	1,525	13,725,000	
ナガワ	7,400	1,185	8,769,000	
メデカ ジャパン	27,000	365	9,855,000	
マミーマート	4,800	1,060	5,088,000	
ヤマダ電機	11,000	11,640	128,040,000	
ベルク	9,700	1,170	11,349,000	
ベルーナ	31,900	1,299	41,438,100	
合計	1,890,663		2,633,617,000	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第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。

「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

「世界REITマザーファンド」の状況

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

りそな・多摩応援・資産分散ファンド

(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）並びに同規則第2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、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か月未満であるため、財務諸表は6か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、前特定期間（平成18年9月27日から平成19年2月13日まで）及び当特定期間（平成19年2月14日から平成19年8月13日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 3 月 30 日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員

公認会計士

三浦邦仁



指定社員
業務執行社員

公認会計士

久野佳樹



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・多摩応援・資産分散ファンドの平成 18 年 9 月 27 日から平成 19 年 2 月 13 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、注記表並びに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・多摩応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 13 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。

大和証券投資信託委託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

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 9 月 28 日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士
業務執行社員

山元太志 

指定社員 公認会計士
業務執行社員

久野佳樹 

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・多摩応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 14 日から平成 19 年 8 月 13 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、注記表並びに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・多摩応援・資産分散ファンドの平成 19 年 8 月 13 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。

大和証券投資信託委託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・多摩応援・資産分散ファンド

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		平成19年2月13日現在 金 額 (円)	平成19年8月13日現在 金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		107,032,779	100,020,059
親投資信託受益証券		3,289,473,554	2,648,593,624
流動資産合計		3,396,506,333	2,748,613,683
資産合計		3,396,506,333	2,748,613,683
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		81,235,204	5,839,288
未払解約金		10,721,854	3,774,000
未払受託者報酬		140,072	127,252
未払委託者報酬		3,361,874	3,054,266
その他未払費用		103,243	123,891
流動負債合計		95,562,247	12,918,697
負債合計		95,562,247	12,918,697
純資産の部			
元本等			
元本	※1	3,265,510,430	2,919,644,453
剰余金			
期末剰余金		35,433,656	—
期末欠損金		—	183,949,467
(うち分配準備積立金)		(31,198,060)	(36,962,552)
剰余金合計	※2	35,433,656	△183,949,467
元本等合計		3,300,944,086	2,735,694,986
純資産合計		3,300,944,086	2,735,694,986
負債・純資産合計		3,396,506,333	2,748,613,683

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
		金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益			
受取利息		108,720	225,980
有価証券売買等損益		306,473,554	△162,879,930
営業収益合計		306,582,274	△162,653,950
営業費用			
受託者報酬		688,644	826,481
委託者報酬	※1	16,528,189	19,836,567
その他費用		103,243	126,374
営業費用合計		17,320,076	20,789,422
営業利益金額		289,262,198	—
営業損失金額		—	183,443,372
経常利益金額		289,262,198	—
経常損失金額		—	183,443,372
当期純利益金額		289,262,198	—
当期純損失金額		—	183,443,372
一部解約に伴う当期純利益金額分配額		4,880,074	1,970,540
期首剰余金		—	35,433,656
剰余金増加額		4,485,554	5,427,486
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)		(4,485,554)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)		(—)	(5,427,486)
剰余金減少額		2,786,486	2,015,387
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)		(2,786,486)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)		(—)	(2,015,387)
分配金	※2	250,647,536	37,381,310
期末剰余金		35,433,656	—
期末欠損金		—	183,949,467

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1. ※1 期首元本額	3,319,368,889 円	3,265,510,430 円
期中追加設定元本額	289,859,324 円	199,847,814 円
期中一部解約元本額	343,717,783 円	545,713,791 円
2. 特定期間末日における受益権 の総数	3,265,510,430 口	2,919,644,453 口
3. ※2 元本の欠損	—————	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 183,949,467 円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期 自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日	当 期 自 平成19年2月14日 至 平成19年8月13日
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	2,032,790 円	2,296,211 円
2. ※2 分配金の計算過程	<p>(自平成18年9月27日 至平成18年10月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,379,318円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(14,441,868円)、投資信託約款に規定される収益調整金(954,393円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は24,775,579円(1万口当たり72.61円)ですが、分配を行っておりません。</p> <p>(自平成18年10月14日 至平成18年11月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,199,943円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(841,948円)及び分配準備積立金(23,821,186円)より分配対象額は28,863,077円(1万口当たり82.36円)ですが、分配を行っておりません。</p> <p>(自平成18年11月14日 至平成18年12月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(6,953,866円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券</p>	<p>(自平成19年2月14日 至平成19年3月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,914,692円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,118,201円)及び分配準備積立金(30,907,918円)より分配対象額は35,940,811円(1万口当たり107.44円)であり、うち6,683,008円(1万口当たり19.98円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成19年3月14日 至平成19年4月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(15,639,671円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,857,831円)及び分配準備積立金(25,597,502円)より分配対象額は45,095,004円(1万口当たり134.98円)であり、うち6,681,494円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成19年4月14日 至平成19年5月14日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(8,730,581円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券</p>

<p> 売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(85,931,421円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,200,171円)及び分配準備積立金(27,284,317円)より分配対象額は122,369,775円(1万口当たり357.64円)であり、うち84,775,470円(1万口当たり247.76円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成18年12月14日 至平成19年1月15日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(12,428,578円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(71,557,442円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,502,944円)及び分配準備積立金(33,452,678円)より分配対象額は119,941,642円(1万口当たり368.09円)であり、うち84,636,862円(1万口当たり259.74円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年1月16日 至平成19年2月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,556,364円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(72,701,150円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,235,596円)及び分配準備積立金(32,175,750円)より分配対象額は116,668,860円(1万口当たり357.28円)であり、うち81,235,204円(1万口当たり248.77円)を分配金額としております。 </p>	<p> 売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,802,587円)及び分配準備積立金(33,928,663円)より分配対象額は46,461,831円(1万口当たり141.60円)であり、うち6,162,931円(1万口当たり18.78円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年5月15日 至平成19年6月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,599,911円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,846,787円)及び分配準備積立金(35,128,721円)より分配対象額は42,575,419円(1万口当たり134.21円)であり、うち6,337,766円(1万口当たり19.98円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年6月14日 至平成19年7月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(14,308,967円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,755,204円)及び分配準備積立金(30,782,699円)より分配対象額は48,846,870円(1万口当たり161.67円)であり、うち5,676,823円(1万口当たり18.79円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年7月14日 至平成19年8月13日) </p>
---	---

		<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,729,667円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,645,054円)及び分配準備積立金(38,072,173円)より分配対象額は46,446,894円(1万口当たり159.08円)であり、うち5,839,288円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
--	--	---

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成19年2月13日現在		当 期 平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託 受益証券	3,289,473,554	84,729,368	2,648,593,624	△ 172,252,846
合 計	3,289,473,554	84,729,368	2,648,593,624	△ 172,252,846

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

前 期 自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日	当 期 自 平成19年2月14日 至 平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
該当事項はありません。	市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1. 0109 円 (10, 109 円)	0. 9370 円 (9, 370 円)

(4) 附属明細表

第 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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託 受益証券	多摩応援マザーファンド	890, 671, 118	871, 521, 688	
	ハイグレード・ソブリン・ マザーファンド	800, 442, 742	911, 224, 017	
	世界REITマザーファンド	689, 808, 731	865, 847, 919	
合計		2, 380, 922, 591	2, 648, 593, 624	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第 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。

(参考)

当ファンドは「多摩応援マザーファンド」受益証券、「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」受益証券及び「世界REITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

「多摩応援マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

区 分	注記 番号	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
		金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		45,917,080	35,857,613
株式		1,027,893,900	835,207,500
未収入金		11,840,084	—
未収配当金		690,750	471,790
流動資産合計		1,086,341,814	871,536,903
資産合計		1,086,341,814	871,536,903
負債の部			
流動負債			
未払金		15,552,592	—
流動負債合計		15,552,592	—
負債合計		15,552,592	—
純資産の部			
元本等			
元本	※1	1,032,171,606	890,671,118
剰余金			
期末剰余金		38,617,616	—
期末欠損金		—	19,134,215
剰余金合計	※2	38,617,616	△19,134,215
元本等合計		1,070,789,222	871,536,903
純資産合計		1,070,789,222	871,536,903
負債・純資産合計		1,086,341,814	871,536,903

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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段、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。</p>	<p>株式 同左</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>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、未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。</p>	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。ただし、平成 19 年 6 月 30 日以前に計上した受取配当金については、その金額が確定している場合には当該金額、未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。 (会計方針の変更) 従来、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、未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いましたが、「投資信託に関する会計規則に関する細則」の改正により、平成 19 年 7 月 1 日以降計上する受取配当金については、原則として、株式の配当落ち日において、予想配当金額についてもその全額を計上する方法に変更しました。 この変更による損益への影響は軽微であります。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成 19 年 2 月 13 日現在	平成 19 年 8 月 13 日現在
1. ※1 本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	1,085,000,000 円	1,032,171,606 円
同期中における追加設定元本額	88,645,158 円	—円
同期中における一部解約元本額	141,473,552 円	141,500,488 円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
りそな・多摩応援・資産分散ファンド	1,032,171,606 円	890,671,118 円
計	1,032,171,606 円	890,671,118 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	1,032,171,606 口	890,671,118 口
3. ※2 元本の欠損	—	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 19,134,215 円であります。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成 19 年 2 月 13 日現在		平成 19 年 8 月 13 日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	1,027,893,900	19,588,225	835,207,500	△ 68,143,209
合 計	1,027,893,900	19,588,225	835,207,500	△ 68,143,209

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成 18 年 9 月 27 日から平成 19 年 2 月 13 日まで、及び平成 19 年 2 月 14 日から平成 19 年 8 月 13 日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日		
関連当事者の名称 (当ファンドと当該関連当事者との関係)	取引の内容	取引の種類別の取引金額	取引により発生した債権又は債務に係る主な項目別の当該計算期間の末日における残高
大和証券 (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 651,160円	委託手数料の未受渡金額 未払金 57,508円
大和証券SMBC (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 199,434円	委託手数料の未受渡金額 未払金 ー円

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針

社内規定により取引業者の選定を行っております。また、各資産の売買においては、社内基準に基づき最良執行を行っており、個々の取引条件はその結果として決定されております。なお、ビット（オファー）やベークスを引合い条件に用いる取引については、相見積もりをとっており、一般の取引と条件が同様と判断しております。当該取引の売買手数料相当額については、取引慣行上、取引総額に含まれますため金額を記載しておりません。

2. 取引条件の変更及び当該変更が計算書類に与えている影響
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0374円 (10,374円)	0.9785円 (9,785円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
総合臨床HLDGS	40	61,900	2,476,000	
ゲンダイエージェンシー	43	117,000	5,031,000	
わらべや日洋	6,400	1,463	9,363,200	
NBC	3,600	1,599	5,756,400	
日本ファルコム	38	41,150	1,563,700	
プロダクション・アイジー	16	102,000	1,632,000	
光ビジネスフオーム	2,000	1,000	2,000,000	
第一化成	2,000	480	960,000	
シダックス	135	78,000	10,530,000	
日本マイクロテーピング	4,000	492	1,968,000	
日本フィルコン	8,500	773	6,570,500	
菊池プレス工業	3,000	2,185	6,555,000	
新立川航空機	4,100	3,330	13,653,000	
エーワン精密	5	500,000	2,500,000	
新川	7,600	2,340	17,784,000	
エス・イー・エス	9,200	664	6,108,800	
ワイエイシイ	3,600	1,793	6,454,800	
共立	26,000	348	9,048,000	
テセック	2,200	1,250	2,750,000	
JUKI	40,000	1,005	40,200,000	
アーム電子	1,600	451	721,600	
レイテックス	2,000	672	1,344,000	
カシオマイクロニクス	5,300	765	4,054,500	
ケンウツド	136,000	163	22,168,000	
ミツミ電機	9,100	4,310	39,221,000	
天昇電気	6,000	271	1,626,000	
フオスター電機	9,000	1,717	15,453,000	
リオン	3,800	770	2,926,000	
横河電機	25,600	1,605	41,088,000	
共和電業	10,000	355	3,550,000	
ニレコ	3,600	1,172	4,219,200	
日本マイクロニクス	7,400	3,880	28,712,000	
アパールデータ	3,200	1,295	4,144,000	
ケル	6,000	391	2,346,000	
富士通フロンテック	9,500	933	8,863,500	
日本電子	29,000	639	18,531,000	
日野自動車	50,000	780	39,000,000	
タチエス	13,500	1,009	13,621,500	
TBK	11,000	468	5,148,000	
昭和飛行機	13,000	1,431	18,603,000	

ジャムコ	10,000	1,200	12,000,000	
セイジョー	4,000	2,520	10,080,000	
アムスク	2,100	544	1,142,400	
エコス	3,700	814	3,011,800	
魚力	5,600	1,459	8,170,400	
うかい	2,000	2,100	4,200,000	
アロカ	11,500	1,447	16,640,500	
国際計測器	5,600	1,580	8,848,000	
東京精密	10,700	3,690	39,483,000	
シチズンホールディングス	37,500	1,141	42,787,500	
アルメディオ	2,000	678	1,356,000	
いなげや	19,000	904	17,176,000	
OLYMPIC	8,800	712	6,265,600	
立飛企業	5,200	6,700	34,840,000	
東栄住宅	10,200	1,412	14,402,400	
飯田産業	11,500	1,802	20,723,000	
新日本建物	12,800	610	7,808,000	
アーネストワン	24,500	687	16,831,500	
タクトホーム	92	73,300	6,743,600	
ロジコム	5	135,000	675,000	
京王電鉄	55,000	737	40,535,000	
名糖運輸	4,000	884	3,536,000	
キューソー流通システム	4,800	1,345	6,456,000	
よみうりランド	31,000	575	17,825,000	
KSK	2,800	800	2,240,000	
学 究 社	2,000	329	658,000	
ケーユー	8,800	712	6,265,600	
松屋フーズ	7,200	1,395	10,044,000	
ユニダックス	6,500	574	3,731,000	
サンドラッグ	16,500	2,575	42,487,500	
合計	802,474		835,207,500	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第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。

「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」の状況
前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

「世界REITマザーファンド」の状況
前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

りそな・神奈川応援・資産分散ファンド

(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）並びに同規則第2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、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か月未満であるため、財務諸表は6か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、前特定期間（平成18年9月27日から平成19年2月13日まで）及び当特定期間（平成19年2月14日から平成19年8月13日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 3 月 30 日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士
業務執行社員

三浦邦仁 

指定社員 公認会計士
業務執行社員

久野佳樹 

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・神奈川応援・資産分散ファンドの平成 18 年 9 月 27 日から平成 19 年 2 月 13 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、注記表並びに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・神奈川応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 13 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。

大和証券投資信託委託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

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 9 月 28 日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士
業務執行社員

山元 太志 

指定社員 公認会計士
業務執行社員

久野 佳樹 

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・神奈川応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 14 日から平成 19 年 8 月 13 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、注記表並びに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・神奈川応援・資産分散ファンドの平成 19 年 8 月 13 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。

大和証券投資信託委託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・神奈川応援・資産分散ファンド

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		平成19年2月13日現在 金 額 (円)	平成19年8月13日現在 金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		96,643,163	29,170,943
親投資信託受益証券		2,222,413,668	1,788,032,831
流動資産合計		2,319,056,831	1,817,203,774
資産合計		2,319,056,831	1,817,203,774
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		49,112,699	3,903,724
未払解約金		823,709	2,731,734
未払受託者報酬		95,349	85,045
未払委託者報酬		2,288,558	2,041,261
その他未払費用		69,711	81,387
流動負債合計		52,390,026	8,843,151
負債合計		52,390,026	8,843,151
純資産の部			
元本等			
元本	※1	2,243,421,719	1,951,862,376
剰余金			
期末剰余金		23,245,086	—
期末欠損金		—	143,501,753
(うち分配準備積立金)		(18,197,089)	(22,877,408)
剰余金合計	※2	23,245,086	△143,501,753
元本等合計		2,266,666,805	1,808,360,623
純資産合計		2,266,666,805	1,808,360,623
負債・純資産合計		2,319,056,831	1,817,203,774

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
		金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益			
受取利息		85,777	173,526
有価証券売買等損益		191,413,668	△130,380,837
営業収益合計		191,499,445	△130,207,311
営業費用			
受託者報酬		465,201	543,120
委託者報酬	※1	11,165,498	13,035,845
その他費用		69,711	85,003
営業費用合計		11,700,410	13,663,968
営業利益金額		179,799,035	—
営業損失金額		—	143,871,279
経常利益金額		179,799,035	—
経常損失金額		—	143,871,279
当期純利益金額		179,799,035	—
当期純損失金額		—	143,871,279
一部解約に伴う当期純利益金額分配額		3,673,888	—
一部解約に伴う当期純損失金額分配額		—	172,347
期首剰余金		—	23,245,086
剰余金増加額		5,387,298	2,231,333
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)		(5,387,298)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)		(—)	(2,231,333)
剰余金減少額		1,749,727	389,492
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)		(1,749,727)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)		(—)	(389,492)
分配金	※2	156,517,632	24,889,748
期末剰余金		23,245,086	—
期末欠損金		—	143,501,753

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1. ※1 期首元本額	2,156,421,034 円	2,243,421,719 円
期中追加設定元本額	324,628,721 円	64,792,327 円
期中一部解約元本額	237,628,036 円	356,351,670 円
2. 特定期間末日における受益権 の総数	2,243,421,719 口	1,951,862,376 口
3. ※2 元本の欠損	—————	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 143,501,753 円でありま す。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期		当 期	
	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日		自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日	
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	1,356,887 円		1,496,931 円	
2. ※2 分配金の計算過程	<p>（自平成 18 年 9 月 27 日 至平成 18 年 10 月 13 日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,250,222 円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（22,439,846 円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,284,649 円）及び分配準備積立金（0 円）より分配対象額は 29,974,717 円（1 万口当たり 132.15 円）であります、分配を行っておりません。</p> <p>（自平成 18 年 10 月 14 日 至平成 18 年 11 月 13 日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,698,692 円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0 円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,380,137 円）及び分配準備積立金（28,690,068 円）より分配対象額は 32,768,897 円（1 万口当たり 138.95 円）であります、分配を行っておりません。</p> <p>（自平成 18 年 11 月 14 日 至平成 18 年 12 月 13 日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した</p>		<p>（自平成 19 年 2 月 14 日 至平成 19 年 3 月 13 日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（998,986 円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0 円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,902,702 円）及び分配準備積立金（17,443,390 円）より分配対象額は 21,345,078 円（1 万口当たり 97.44 円）であり、うち 4,380,453 円（1 万口当たり 20 円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成 19 年 3 月 14 日 至平成 19 年 4 月 13 日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,764,742 円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0 円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,460,838 円）及び分配準備積立金（13,906,625 円）より分配対象額は 28,132,205 円（1 万口当たり 129.08 円）であり、うち 4,354,024 円（1 万口当たり 19.98 円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成 19 年 4 月 14 日 至平成 19 年 5 月 14 日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した</p>	

額(4,401,752円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(49,951,297円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,800,977円)及び分配準備積立金(29,671,246円)より分配対象額は86,825,272円(1万口当たり388.41円)であり、うち62,098,971円(1万口当たり277.80円)を分配金額としております。

(自平成18年12月14日 至平成19年1月15日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(8,404,014円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(34,668,805円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,761,287円)及び分配準備積立金(21,660,689円)より分配対象額は68,494,795円(1万口当たり302.07円)であり、うち45,305,962円(1万口当たり199.80円)を分配金額としております。

(自平成19年1月16日 至平成19年2月13日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,847,408円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(43,698,387円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,047,997円)及び分配準備積立金(18,763,993円)より分配対象額は72,357,785円(1万口当たり322.53円)であり、うち49,112,699円(1万口当たり218.92円)を分配金額としております。

額(5,983,329円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,028,042円)及び分配準備積立金(20,466,817円)より分配対象額は29,478,188円(1万口当たり136.93円)であり、うち4,300,311円(1万口当たり19.98円)を分配金額としております。

(自平成19年5月15日 至平成19年6月13日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(2,218,652円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,959,443円)及び分配準備積立金(21,555,721円)より分配対象額は26,733,816円(1万口当たり127.54円)であり、うち4,188,190円(1万口当たり19.98円)を分配金額としております。

(自平成19年6月14日 至平成19年7月13日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,440,693円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,869,696円)及び分配準備積立金(18,663,165円)より分配対象額は30,973,554円(1万口当たり154.82円)であり、うち3,763,046円(1万口当たり18.81円)を分配金額としております。

	(自平成19年7月14日 至平成19年8月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,047,431円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,814,321円)及び分配準備積立金(23,733,701円)より分配対象額は29,595,453円(1万口当たり151.63円)であり、うち3,903,724円(1万口当たり20円)を分配金額としております。
--	---

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成19年2月13日現在		当 期 平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託 受益証券	2,222,413,668	51,675,322	1,788,032,831	△ 145,622,008
合 計	2,222,413,668	51,675,322	1,788,032,831	△ 145,622,008

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

前 期 自平成18年9月27日 至平成19年2月13日	当 期 自平成19年2月14日 至平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
該当事項はありません。	市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、 一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行 なわれていないため、該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1. 0104 円 (10, 104 円)	0. 9265 円 (9, 265 円)

(4) 附属明細表

第 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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託 受益証券	神奈川応援マザーファンド	630, 633, 313	589, 263, 767	
	ハイグレード・ソブリン・ マザーファンド	548, 795, 689	624, 749, 012	
	世界REITマザーファンド	457, 313, 617	574, 020, 052	
合計		1, 636, 742, 619	1, 788, 032, 831	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第 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。

(参考)

当ファンドは「神奈川応援マザーファンド」受益証券、「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」受益証券及び「世界REITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

「神奈川応援マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

区 分	注記 番号	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
		金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		19,885,409	13,953,349
株式		730,094,200	574,903,100
未収配当金		117,900	436,920
流動資産合計		750,097,509	589,293,369
資産合計		750,097,509	589,293,369
負債の部			
負債合計		—	—
純資産の部			
元本等			
元本	※1	733,667,898	630,633,313
剰余金			
期末剰余金		16,429,611	—
期末欠損金		—	41,339,944
剰余金合計	※2	16,429,611	△41,339,944
元本等合計		750,097,509	589,293,369
純資産合計		750,097,509	589,293,369
負債・純資産合計		750,097,509	589,293,369

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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段、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。</p>	<p>株式 同左</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>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、未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。</p>	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。ただし、平成 19 年 6 月 30 日以前に計上した受取配当金については、その金額が確定している場合には当該金額、未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。 (会計方針の変更) 従来、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、未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いましたが、「投資信託に関する会計規則に関する細則」の改正により、平成 19 年 7 月 1 日以降計上する受取配当金については、原則として、株式の配当落ち日において、予想配当金額についてもその全額を計上する方法に変更しました。 この変更による損益への影響は軽微であります。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
1. ※1 本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	710,000,000 円	733,667,898 円
同期中における追加設定元本額	69,605,590 円	—円
同期中における一部解約元本額	45,937,692 円	103,034,585 円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
りそな・神奈川応援・資産分散ファンド	733,667,898 円	630,633,313 円
計	733,667,898 円	630,633,313 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	733,667,898 口	630,633,313 口
3. ※2 元本の欠損	—	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41,339,944円です。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成19年2月13日現在		平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	730,094,200	17,835,766	574,903,100	△ 61,529,867
合 計	730,094,200	17,835,766	574,903,100	△ 61,529,867

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成18年9月27日から平成19年2月13日まで、及び平成19年2月14日から平成19年8月13日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日	自 平成19年2月14日 至 平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日		
関連当事者の名称 (当ファンドと当該関連当事者との関係)	取引の内容	取引の種類別の取引金額	取引により発生した債権又は債務に係る主な項目別の当該計算期間の末日における残高
大和証券 (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 169,513円	委託手数料の未受渡金額 未払金 ー円
大和証券SMBC (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 85,463円	委託手数料の未受渡金額 未払金 ー円

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針

社内規定により取引業者の選定を行っております。また、各資産の売買においては、社内基準に基づき最良執行を行っており、個々の取引条件はその結果として決定されております。なお、ビット（オファー）やベークスを引合い条件に用いる取引については、相見積もりをとっており、一般の取引と条件が同様と判断しております。当該取引の売買手数料相当額については、取引慣行上、取引総額に含まれますため金額を記載しておりません。

2. 取引条件の変更及び当該変更が計算書類に与えている影響
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0224円 (10,224円)	0.9344円 (9,344円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
サカタのタネ	4,600	1,504	6,918,400	
スルガコーポレーション	3,400	2,095	7,123,000	
日揮	12,000	2,280	27,360,000	
東芝プラントシステム	9,000	1,020	9,180,000	
日本農産工業	12,000	317	3,804,000	
システムプロ	21	81,100	1,703,100	
コカコーラセントラルジャパン	8	903,000	7,224,000	
クリエイトエス・ディー	1,900	2,475	4,702,500	
横浜冷凍	5,000	880	4,400,000	
ブックオフコーポレーション	1,700	1,589	2,701,300	
アルファCO	900	2,375	2,137,500	
アツギ	19,000	169	3,211,000	
保土谷化学	7,000	335	2,345,000	
東京応化工業	4,200	2,410	10,122,000	
ファンケル	6,300	1,676	10,558,800	
東亜石油	11,000	187	2,057,000	
オハラ	1,100	2,375	2,612,500	
東邦チタニウム	5,400	4,820	26,028,000	
ユニプレス	3,700	848	3,137,600	
パイオラックス	1,200	2,120	2,544,000	
日本発条	22,000	983	21,626,000	
アマダ	21,000	1,240	26,040,000	
アイダエンジニア	7,000	764	5,348,000	
岡本工作	4,000	438	1,752,000	
ソディック	4,700	866	4,070,200	
千代田化工建	12,000	2,030	24,360,000	
新興プランテック	4,000	1,336	5,344,000	
アネスト岩田	4,000	574	2,296,000	
アマノ	7,200	1,468	10,569,600	
日鍛バルブ	2,400	771	1,850,400	
富士電機HLDGS	52,000	445	23,140,000	
芝浦メカトロニクス	5,000	690	3,450,000	
富士通	36,000	726	26,136,000	
NECエレクトロニクス	9,200	3,460	31,832,000	
アルバック	3,800	4,620	17,556,000	
ディーアンドエムHLDGS	8,000	374	2,992,000	
京三製作所	6,000	412	2,472,000	
アンリツ	11,000	532	5,852,000	
帝国通信工業	5,000	519	2,595,000	
メイコー	1,000	3,800	3,800,000	

小野測器	3,000	939	2,817,000	
OBARA	1,900	2,075	3,942,500	
イリソ電子工業	900	3,330	2,997,000	
レーザーテック	1,100	2,605	2,865,500	
図研	2,500	1,176	2,940,000	
日産自動車	24,900	1,211	30,153,900	
日産車体	14,000	679	9,506,000	
関東自動車	6,400	1,573	10,067,200	
シロキ工業	8,000	287	2,296,000	
プレス工業	10,000	456	4,560,000	
ヨロズ	1,900	1,250	2,375,000	
コナカ	2,700	980	2,646,000	
コロワイド	5,500	533	2,931,500	
マクニカ	1,600	2,890	4,624,000	
ニフコ	4,800	2,575	12,360,000	
岡村製作所	10,000	956	9,560,000	
ナイス	10,000	482	4,820,000	
横浜銀行	35,000	837	29,295,000	
ランド	15	132,000	1,980,000	
相模鉄道	38,000	395	15,010,000	
アルプス物流	1,600	1,423	2,276,800	
日新	9,000	419	3,771,000	
丸全昭和運輸	9,000	420	3,780,000	
神奈川交通	6,000	546	3,276,000	
宇徳	3,000	658	1,974,000	
NEC モバイリング	1,300	1,918	2,493,400	
光栄	6,100	2,020	12,322,000	
シーイーシー	1,700	1,002	1,703,400	
日立ソフトウェア	5,800	2,500	14,500,000	
富士ソフト	3,400	2,385	8,109,000	
合計	563,844		574,903,100	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第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。

「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」の状況
前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

「世界REITマザーファンド」の状況
前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

りそな・中部応援・資産分散ファンド

- (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）並びに同規則第2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、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か月未満であるため、財務諸表は6か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、前特定期間（平成18年9月27日から平成19年2月13日まで）及び当特定期間（平成19年2月14日から平成19年8月13日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 3 月 30 日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員 公認会計士
業 務 執 行 社 員

三浦邦仁 

指 定 社 員 公認会計士
業 務 執 行 社 員

久野佳樹 

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・中部応援・資産分散ファンドの平成 18 年 9 月 27 日から平成 19 年 2 月 13 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、注記表並びに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・中部応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 13 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。

大和証券投資信託委託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

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 9 月 28 日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員 公認会計士

山元 大志 

指定社員
業務執行社員 公認会計士

久野 佳樹 

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・中部応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 14 日から平成 19 年 8 月 13 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、注記表並びに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・中部応援・資産分散ファンドの平成 19 年 8 月 13 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。

大和証券投資信託委託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・中部応援・資産分散ファンド

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		平成19年2月13日現在 金 額 (円)	平成19年8月13日現在 金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		303,990,398	121,700,346
親投資信託受益証券		6,294,627,870	8,482,565,411
未収入金		—	80,000,000
流動資産合計		6,598,618,268	8,684,265,757
資産合計		6,598,618,268	8,684,265,757
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		214,083,034	18,151,482
未払解約金		—	8,676,308
未払受託者報酬		247,974	403,873
未払委託者報酬		5,951,580	9,693,215
その他未払費用		116,770	365,786
流動負債合計		220,399,358	37,290,664
負債合計		220,399,358	37,290,664
純資産の部			
元本等			
元本	※1	6,313,614,229	9,094,895,933
剰余金			
期末剰余金		64,604,681	—
期末欠損金		—	447,920,840
(うち分配準備積立金)		(—)	(92,772,552)
剰余金合計	※2	64,604,681	△447,920,840
元本等合計		6,378,218,910	8,646,975,093
純資産合計		6,378,218,910	8,646,975,093
負債・純資産合計		6,598,618,268	8,684,265,757

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
		金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益			
受取利息		94,414	355,090
有価証券売買等損益		454,627,870	△302,062,459
営業収益合計		454,722,284	△301,707,369
営業費用			
受託者報酬		778,914	2,439,156
委託者報酬	※1	18,694,784	58,540,836
その他費用		116,770	416,175
営業費用合計		19,590,468	61,396,167
営業利益金額		435,131,816	—
営業損失金額		—	363,103,536
経常利益金額		435,131,816	—
経常損失金額		—	363,103,536
当期純利益金額		435,131,816	—
当期純損失金額		—	363,103,536
一部解約に伴う当期純利益金額分配額		21,386	5,717,810
期首剰余金		—	64,604,681
剰余金増加額		99,899,327	5,110,036
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)		(99,899,327)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)		(—)	(5,110,036)
剰余金減少額		19,379	35,034,370
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)		(19,379)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)		(—)	(35,034,370)
分配金	※2	470,385,697	113,779,841
期末剰余金		64,604,681	—
期末欠損金		—	447,920,840

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1. ※1 期首元本額	2,276,149,882 円	6,313,614,229 円
期中追加設定元本額	4,039,107,666 円	4,045,374,570 円
期中一部解約元本額	1,643,319 円	1,264,092,866 円
2. 特定期間末日における受益権 の総数	6,313,614,229 口	9,094,895,933 口
3. ※2 元本の欠損	—————	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 447,920,840 円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	2,324,548 円	6,876,654 円
2. ※2 分配金の計算過程	<p>(自平成 18 年 9 月 27 日 至平成 18 年 10 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (6,935,082 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (50,028,549 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (3,573,445 円) 及び分配準備積立金 (0 円) より分配対象額は 60,537,076 円 (1 万口当たり 246.16 円) であります。分配を行っておりません。</p> <p>(自平成 18 年 10 月 14 日 至平成 18 年 11 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (3,596,127 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (14,484,593 円) 及び分配準備積立金 (56,963,631 円) より分配対象額は 75,044,351 円 (1 万口当たり 246.05 円) であります。分配を行っておりません。</p> <p>(自平成 18 年 11 月 14 日 至平成 18 年 12 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (6,309,930 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券</p>	<p>(自平成 19 年 2 月 14 日 至平成 19 年 3 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (5,152,760 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (41,758,018 円) 及び分配準備積立金 (0 円) より分配対象額は 46,910,778 円 (1 万口当たり 50.59 円) であり、うち 18,422,279 円 (1 万口当たり 19.87 円) を分配金額としております。</p> <p>(自平成 19 年 3 月 14 日 至平成 19 年 4 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (41,666,270 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (32,671,116 円) 及び分配準備積立金 (0 円) より分配対象額は 74,337,386 円 (1 万口当たり 74.41 円) であり、うち 19,885,179 円 (1 万口当たり 19.90 円) を分配金額としております。</p> <p>(自平成 19 年 4 月 14 日 至平成 19 年 5 月 14 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (31,132,939 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券</p>

<p> 売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(75,043,745円)、投資信託約款に規定される収益調整金(29,126,381円)及び分配準備積立金(60,557,897円)より分配対象額は171,037,953円(1万口当たり520.16円)であり、うち137,505,091円(1万口当たり418.18円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成18年12月14日 至平成19年1月15日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(17,824,803円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(82,944,541円)、投資信託約款に規定される収益調整金(64,303,989円)及び分配準備積立金(4,405,330円)より分配対象額は169,478,663円(1万口当たり342.10円)であり、うち118,797,572円(1万口当たり239.80円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年1月16日 至平成19年2月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(13,666,714円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(178,761,196円)、投資信託約款に規定される収益調整金(86,259,805円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は278,687,715円(1万口当たり441.41円)であり、うち214,083,034円(1万口当たり339.08円)を分配金額としております。 </p>	<p> 売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(33,425,460円)及び分配準備積立金(21,570,760円)より分配対象額は86,129,159円(1万口当たり85.68円)であり、うち19,828,733円(1万口当たり19.73円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年5月15日 至平成19年6月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,880,291円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(33,704,353円)及び分配準備積立金(32,101,649円)より分配対象額は75,686,293円(1万口当たり76.01円)であり、うち19,655,039円(1万口当たり19.74円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年6月14日 至平成19年7月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(44,890,264円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(52,834,963円)、投資信託約款に規定される収益調整金(32,244,578円)及び分配準備積立金(21,273,510円)より分配対象額は151,243,315円(1万口当たり159.18円)であり、うち17,837,129円(1万口当たり18.77円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年7月14日 至平成19年8月13日) </p>	<p> 売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(33,425,460円)及び分配準備積立金(21,570,760円)より分配対象額は86,129,159円(1万口当たり85.68円)であり、うち19,828,733円(1万口当たり19.73円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年5月15日 至平成19年6月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,880,291円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(33,704,353円)及び分配準備積立金(32,101,649円)より分配対象額は75,686,293円(1万口当たり76.01円)であり、うち19,655,039円(1万口当たり19.74円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年6月14日 至平成19年7月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(44,890,264円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(52,834,963円)、投資信託約款に規定される収益調整金(32,244,578円)及び分配準備積立金(21,273,510円)より分配対象額は151,243,315円(1万口当たり159.18円)であり、うち17,837,129円(1万口当たり18.77円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年7月14日 至平成19年8月13日) </p>
---	---	---

	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(14,172,943円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(30,956,726円)及び分配準備積立金(96,751,091円)より分配対象額は141,880,760円(1万口当たり156.00円)であり、うち18,151,482円(1万口当たり19.96円)を分配金額としております。</p>
--	--

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成19年2月13日現在		当 期 平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託 受益証券	6,294,627,870	198,649,301	8,482,565,411	△ 528,715,407
合 計	6,294,627,870	198,649,301	8,482,565,411	△ 528,715,407

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

前 期 自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日	当 期 自 平成19年2月14日 至 平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
該当事項はありません。	市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、 一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行 なわれていないため、該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1. 0102 円 (10, 102 円)	0. 9508 円 (9, 508 円)

(4) 附属明細表

第 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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託 受益証券	中部応援マザーファンド	2, 575, 704, 874	2, 838, 684, 341	
	ハイグレード・ソブリン・ マザーファンド	2, 546, 118, 122	2, 898, 500, 870	
	世界REITマザーファンド	2, 187, 205, 386	2, 745, 380, 200	
合計		7, 309, 028, 382	8, 482, 565, 411	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第 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。

(参考)

当ファンドは「中部応援マザーファンド」受益証券、「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」受益証券及び「世界REITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

「中部応援マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

区 分	注記 番号	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
		金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		74,845,850	46,815,631
株式		1,998,680,300	2,790,514,000
未収入金		—	40,822,221
未収配当金		302,760	572,445
流動資産合計		2,073,828,910	2,878,724,297
資産合計		2,073,828,910	2,878,724,297
負債の部			
流動負債			
未払解約金		—	40,000,000
流動負債合計		—	40,000,000
負債合計		—	40,000,000
純資産の部			
元本等			
元本	※1	1,855,615,182	2,575,704,874
剰余金			
期末剰余金		218,213,728	263,019,423
剰余金合計		218,213,728	263,019,423
元本等合計		2,073,828,910	2,838,724,297
純資産合計		2,073,828,910	2,838,724,297
負債・純資産合計		2,073,828,910	2,878,724,297

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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段、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。</p>	<p>株式 同左</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>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、未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。</p>	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。ただし、平成 19 年 6 月 30 日以前に計上した受取配当金については、その金額が確定している場合には当該金額、未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。 (会計方針の変更) 従来、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、未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いましたが、「投資信託に関する会計規則に関する細則」の改正により、平成 19 年 7 月 1 日以降計上する受取配当金については、原則として、株式の配当落ち日において、予想配当金額についてもその全額を計上する方法に変更しました。 この変更による損益への影響はありません。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
1. ※1 本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	750,000,000円	1,855,615,182円
同期中における追加設定元本額	1,105,615,182円	1,122,985,975円
同期中における一部解約元本額	－円	402,896,283円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
りそな・中部応援・資産分散ファンド	1,855,615,182円	2,575,704,874円
計	1,855,615,182円	2,575,704,874円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	1,855,615,182口	2,575,704,874口

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成19年2月13日現在		平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	1,998,680,300	143,417,413	2,790,514,000	△ 45,525,411
合 計	1,998,680,300	143,417,413	2,790,514,000	△ 45,525,411

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成18年9月27日から平成19年2月13日まで、及び平成19年2月14日から平成19年8月13日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

自平成18年9月27日 至平成19年2月13日	自平成19年2月14日 至平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日		
関連当事者の名称 (当ファンドと当該関連当事者との関係)	取引の内容	取引の種類別の取引金額	取引により発生した債権又は債務に係る主な項目別の当該計算期間の末日における残高
大和証券 (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 741,860円	委託手数料の未受渡金額 未払金 ー円
大和証券SMBC (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 1,054,234円	委託手数料の未受渡金額 未払金 ー円

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針

社内規定により取引業者の選定を行っております。また、各資産の売買においては、社内基準に基づき最良執行を行っており、個々の取引条件はその結果として決定されております。なお、ビット（オファー）やベークスを引合い条件に用いる取引については、相見積もりをとっており、一般の取引と条件が同様と判断しております。当該取引の売買手数料相当額については、取引慣行上、取引総額に含まれますため金額を記載しておりません。

2. 取引条件の変更及び当該変更が計算書類に与えている影響
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1176円 (11,176円)	1.1021円 (11,021円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
ゲオ	46	250,000	11,500,000	
カゴメ	7,900	2,035	16,076,500	
アルペン	3,500	2,020	7,070,000	
松坂屋ホールディングス	17,000	961	16,337,000	
トヨタ紡織	16,500	3,310	54,615,000	
サークルKサンクス	7,600	1,991	15,131,600	
北越製紙	18,000	599	10,782,000	
イビデン	13,200	9,030	119,196,000	
アイカ工業	5,800	1,263	7,325,400	
キッセイ薬品工業	5,000	2,215	11,075,000	
リゾートトラスト	4,000	2,720	10,880,000	
ユー・エス・エス	2,880	7,600	21,888,000	
東海ゴム	9,200	2,085	19,182,000	
日本碍子	33,000	3,750	123,750,000	
日本特殊陶業	22,000	2,000	44,000,000	
フジミインコーポレーテッド	2,800	2,910	8,148,000	
大同特殊鋼	36,000	868	31,248,000	
愛知製鋼	20,000	632	12,640,000	
住友電工	6,080	1,795	10,913,600	
リンナイ	3,300	3,840	12,672,000	
オークマ	17,000	1,731	29,427,000	
東芝機械	18,000	904	16,272,000	
オーエスジー	8,800	1,599	14,071,200	
森精機製作所	8,600	3,000	25,800,000	
豊田自動織機	23,400	5,160	120,744,000	
ブラザー工業	25,200	1,415	35,658,000	
ジェイテクト	27,100	1,922	52,086,200	
ミネベア	35,000	690	24,150,000	
マキタ	12,600	4,680	58,968,000	
セイコーエプソン	17,300	3,110	53,803,000	
デンソー	29,700	4,260	126,522,000	
ファナック	12,100	12,140	146,894,000	
浜松ホトニクス	6,800	3,630	24,684,000	
新光電気工業	11,700	2,685	31,414,500	
東海理化電機	8,500	3,190	27,115,000	
トヨタ自動車	17,400	7,070	123,018,000	
トヨタ車体	10,000	1,842	18,420,000	
日信工業	5,600	3,380	18,928,000	
フタバ産業	6,000	2,870	17,220,000	
アイシン精機	25,900	4,530	117,327,000	

スズキ	42,100	3,210	135,141,000	
ヤマハ発動機	25,100	3,200	80,320,000	
豊田合成	11,100	3,790	42,069,000	
日本精機	5,000	3,000	15,000,000	
エフ・シー・シー	4,500	2,030	9,135,000	
スギ薬局	5,000	2,785	13,925,000	
スター精密	4,500	3,030	13,635,000	
日本電産サンキョー	19,000	835	15,865,000	
ヤマハ	18,200	2,540	46,228,000	
豊田通商	31,000	3,050	94,550,000	
サンゲツ	3,600	2,540	9,144,000	
コメリ	4,700	3,210	15,087,000	
ユニー	19,000	1,205	22,895,000	
第四銀行	33,000	480	15,840,000	
静岡銀行	61,000	1,189	72,529,000	
十六銀行	33,000	672	22,176,000	
スルガ銀行	25,000	1,520	38,000,000	
八十二銀行	46,000	887	40,802,000	
山梨中央銀行	19,000	691	13,129,000	
大垣共立銀行	29,000	592	17,168,000	
百五銀行	25,000	757	18,925,000	
名古屋銀行	21,000	806	16,926,000	
愛知銀行	1,000	12,620	12,620,000	
東海旅客鉄道	102	1,150,000	117,300,000	
名古屋鉄道	78,000	345	26,910,000	
セイノーホールディングス	20,000	1,055	21,100,000	
中部電力	37,900	3,310	125,449,000	
東邦瓦斯	49,000	602	29,498,000	
メイテック	3,300	3,720	12,276,000	
スズケン	8,500	3,520	29,920,000	
合計	1,243,108		2,790,514,000	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第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。

「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

「世界REITマザーファンド」の状況

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド

- (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）並びに同規則第2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、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か月未満であるため、財務諸表は6か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、前特定期間（平成18年9月27日から平成19年2月13日まで）及び当特定期間（平成19年2月14日から平成19年8月13日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 3 月 30 日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 三浦邦仁 
業務執行社員

指定社員 公認会計士 久野佳樹 
業務執行社員

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・京都滋賀応援・資産分散ファンドの平成 18 年 9 月 27 日から平成 19 年 2 月 13 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、注記表並びに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・京都滋賀応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 13 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。

大和証券投資信託委託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

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 9 月 28 日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士
業務執行社員

山元 丸志 

指定社員 公認会計士
業務執行社員

久野 佳樹 

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・京都滋賀応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 14 日から平成 19 年 8 月 13 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、注記表並びに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・京都滋賀応援・資産分散ファンドの平成 19 年 8 月 13 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。

大和証券投資信託委託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・京都滋賀応援・資産分散ファンド

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		平成19年2月13日現在 金 額 (円)	平成19年8月13日現在 金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		104,774,510	53,466,912
親投資信託受益証券		2,309,628,465	1,926,547,747
流動資産合計		2,414,402,975	1,980,014,659
資産合計		2,414,402,975	1,980,014,659
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		51,145,210	4,189,705
未払受託者報酬		96,791	92,074
未払委託者報酬		2,323,049	2,209,922
その他未払費用		61,705	92,378
流動負債合計		53,626,755	6,584,079
負債合計		53,626,755	6,584,079
純資産の部			
元本等			
元本	※1	2,335,869,799	2,094,852,551
剰余金			
期末剰余金		24,906,421	—
期末欠損金		—	121,421,971
(うち分配準備積立金)		(12,502,034)	(20,689,043)
剰余金合計	※2	24,906,421	△121,421,971
元本等合計		2,360,776,220	1,973,430,580
純資産合計		2,360,776,220	1,973,430,580
負債・純資産合計		2,414,402,975	1,980,014,659

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日 金 額 (円)	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日 金 額 (円)
営業収益			
受取利息		72,271	210,653
有価証券売買等損益		185,628,465	△80,580,718
営業収益合計		185,700,736	△80,370,065
営業費用			
受託者報酬		411,830	616,365
委託者報酬	※1	9,884,729	14,793,737
その他費用		61,705	95,005
営業費用合計		10,358,264	15,505,107
営業利益金額		175,342,472	—
営業損失金額		—	95,875,172
経常利益金額		175,342,472	—
経常損失金額		—	95,875,172
当期純利益金額		175,342,472	—
当期純損失金額		—	95,875,172
一部解約に伴う当期純利益金額分配額		54,146	—
一部解約に伴う当期純損失金額分配額		—	2,510,805
期首剰余金		—	24,906,421
剰余金増加額		12,427,307	—
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)		(12,427,307)	(—)
剰余金減少額		78,158	4,101,042
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)		(78,158)	(3,519,612)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)		(—)	(581,430)
分配金	※2	162,731,054	48,862,983
期末剰余金		24,906,421	—
期末欠損金		—	121,421,971

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成 19 年 2 月 13 日現在	平成 19 年 8 月 13 日現在
1. ※1 期首元本額	1,732,622,055 円	2,335,869,799 円
期中追加設定元本額	610,177,643 円	273,559,989 円
期中一部解約元本額	6,929,899 円	514,577,237 円
2. 特定期間末日における受益権 の総数	2,335,869,799 口	2,094,852,551 口
3. ※2 元本の欠損	—	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 121,421,971 円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	1,201,806 円	1,700,781 円
2. ※2 分配金の計算過程	(自平成 18 年 9 月 27 日 至平成 18 年 10 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う 当期純利益金額分配後の配当等 収益から費用を控除した額 (5,047,425 円)、解約に伴う当 期純利益金額分配後の有価証券 売買等損益から費用を控除し、 繰越欠損金を補填した額 (20,139,933 円)、投資信託約款 に規定される収益調整金 (1,026,121 円)及び分配準備積	(自平成 19 年 2 月 14 日 至平成 19 年 3 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う 当期純利益金額分配後の配当等 収益から費用を控除した額 (1,331,999 円)、解約に伴う当 期純利益金額分配後の有価証券 売買等損益から費用を控除し、 繰越欠損金を補填した額(0 円)、 投資信託約款に規定される収益 調整金(8,168,902 円)及び分配 準備積立金(12,311,354 円)よ

立金 (0 円) より分配対象額は 26,213,479 円 (1 万口当たり 144.91 円) であります。分配を行っておりません。

(自平成 18 年 10 月 14 日 至平成 18 年 11 月 13 日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (2,210,272 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (2,313,106 円) 及び分配準備積立金 (25,187,358 円) より分配対象額は 29,710,736 円 (1 万口当たり 151.66 円) であります。分配を行っておりません。

(自平成 18 年 11 月 14 日 至平成 18 年 12 月 13 日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (3,817,210 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (38,089,751 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (4,967,164 円) 及び分配準備積立金 (27,397,630 円) より分配対象額は 74,271,755 円 (1 万口当たり 368.47 円) であり、うち 52,004,432 円 (1 万口当たり 258 円) を分配金額としております。

(自平成 18 年 12 月 14 日 至平成 19 年 1 月 15 日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (8,228,880 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (48,434,650 円)、投資信託約款

り分配対象額は 21,812,255 円 (1 万口当たり 88.56 円) であり、うち 4,920,806 円 (1 万口当たり 19.98 円) を分配金額としております。

(自平成 19 年 3 月 14 日 至平成 19 年 4 月 13 日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (11,962,658 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (11,269,241 円) 及び分配準備積立金 (8,722,547 円) より分配対象額は 31,954,446 円 (1 万口当たり 126.60 円) であり、うち 5,025,902 円 (1 万口当たり 19.91 円) を分配金額としております。

(自平成 19 年 4 月 14 日 至平成 19 年 5 月 14 日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (7,638,608 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (9,069,568 円) 及び分配準備積立金 (18,166,783 円) より分配対象額は 34,874,959 円 (1 万口当たり 136.76 円) であり、うち 4,794,325 円 (1 万口当たり 18.80 円) を分配金額としております。

(自平成 19 年 5 月 15 日 至平成 19 年 6 月 13 日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (2,067,958 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益

<p>に規定される収益調整金 (7,412,951円) 及び分配準備積立金 (17,251,442円) より分配対象額は81,327,923円 (1万口当たり381.82円) であり、うち59,581,412円 (1万口当たり279.73円) を分配金額としております。</p> <p>(自平成19年1月16日 至平成19年2月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (5,063,869円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (44,256,336円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (12,404,387円) 及び分配準備積立金 (14,327,039円) より分配対象額は76,051,631円 (1万口当たり325.58円) であり、うち51,145,210円 (1万口当たり218.96円) を分配金額としております。</p>	<p>調整金 (7,876,345円) 及び分配準備積立金 (18,033,319円) より分配対象額は27,977,622円 (1万口当たり127.41円) であり、うち4,374,618円 (1万口当たり19.92円) を分配金額としております。</p> <p>(自平成19年6月14日 至平成19年7月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (10,390,372円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (14,350,109円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (7,763,961円) 及び分配準備積立金 (15,370,521円) より分配対象額は47,874,963円 (1万口当たり222.55円) であり、うち25,557,627円 (1万口当たり118.80円) を分配金額としております。</p> <p>(自平成19年7月14日 至平成19年8月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (3,184,907円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (43,681円) 及び分配準備積立金 (21,693,841円) より分配対象額は24,922,429円 (1万口当たり118.97円) であり、うち4,189,705円 (1万口当たり20円) を分配金額としております。</p>
---	---

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成19年2月13日現在		当 期 平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託 受益証券	2,309,628,465	51,501,962	1,926,547,747	△ 136,879,750
合 計	2,309,628,465	51,501,962	1,926,547,747	△ 136,879,750

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

前 期 自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日	当 期 自 平成19年2月14日 至 平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日	当 期 自 平成19年2月14日 至 平成19年8月13日
該当事項はありません。	市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前 期 平成19年2月13日現在	当 期 平成19年8月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0107円 (10,107円)	0.9420円 (9,420円)

(4) 附属明細表

第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

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託 受益証券	京都滋賀応援マザーファンド	632,098,928	651,946,834	
	ハイグレード・ソブリン・ マザーファンド	580,631,102	660,990,446	
	世界REITマザーファンド	488,854,738	613,610,467	
合計		1,701,584,768	1,926,547,747	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第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。

(参考)

当ファンドは「京都滋賀応援マザーファンド」受益証券、「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」受益証券及び「世界REITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

「京都滋賀応援マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

区 分	注記 番号	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
		金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		29,781,537	13,632,733
株式		736,553,400	638,115,400
未収配当金		261,810	228,400
流動資産合計		766,596,747	651,976,533
資産合計		766,596,747	651,976,533
負債の部			
負債合計		—	—
純資産の部			
元本等			
元本	※1	735,754,095	632,098,928
剰余金			
期末剰余金		30,842,652	19,877,605
剰余金合計		30,842,652	19,877,605
元本等合計		766,596,747	651,976,533
純資産合計		766,596,747	651,976,533
負債・純資産合計		766,596,747	651,976,533

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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段、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。</p>	<p>株式 同左</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>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、未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。</p>	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。ただし、平成 19 年 6 月 30 日以前に計上した受取配当金については、その金額が確定している場合には当該金額、未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。 (会計方針の変更) 従来、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、未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したが、「投資信託に関する会計規則に関する細則」の改正により、平成 19 年 7 月 1 日以降計上する受取配当金については、原則として、株式の配当落ち日において、予想配当金額についてもその全額を計上する方法に変更しました。 この変更による損益への影響は軽微であります。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
1. ※1 本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	554,000,000 円	735,754,095 円
同期中における追加設定元本額	195,983,923 円	36,283,106 円
同期中における一部解約元本額	14,229,828 円	139,938,273 円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド	735,754,095 円	632,098,928 円
計	735,754,095 円	632,098,928 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	735,754,095 口	632,098,928 口

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成19年2月13日現在		平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	736,553,400	27,191,351	638,115,400	△ 18,005,330
合 計	736,553,400	27,191,351	638,115,400	△ 18,005,330

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成18年9月27日から平成19年2月13日まで、及び平成19年2月14日から平成19年8月13日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日	自 平成19年2月14日 至 平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日		
関連当事者の名称 (当ファンドと当該関連当事者との関係)	取引の内容	取引の種類別の取引金額	取引により発生した債権又は債務に係る主な項目別の当該計算期間の末日における残高
大和証券 (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 357,920円	委託手数料の未受渡金額 未払金 ー円
大和証券SMBC (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 179,091円	委託手数料の未受渡金額 未払金 ー円

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針

社内規定により取引業者の選定を行っております。また、各資産の売買においては、社内基準に基づき最良執行を行っており、個々の取引条件はその結果として決定されております。なお、ビット（オファー）やベークスを引合い条件に用いる取引については、相見積もりをとっており、一般の取引と条件が同様と判断しております。当該取引の売買手数料相当額については、取引慣行上、取引総額に含まれますため金額を記載しておりません。

2. 取引条件の変更及び当該変更が計算書類に与えている影響
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0419円 (10,419円)	1.0314円 (10,314円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
SEED	2	140,000	280,000	
金下建設	3,000	535	1,605,000	
宝ホールディングス	29,000	718	20,822,000	
ウライ	1,000	200	200,000	
グンゼ	31,000	601	18,631,000	
オンリー	6	113,000	678,000	
ダイニック	6,000	280	1,680,000	
ワコールホールディングス	20,000	1,535	30,700,000	
フジックス	1,000	465	465,000	
クラウドディア	700	1,260	882,000	
システム・ディ	400	574	229,600	
フェイス	161	15,900	2,559,900	
新日本理化	5,100	249	1,269,900	
第一工業製薬	5,000	293	1,465,000	
三洋化成	16,000	743	11,888,000	
日本新薬	9,000	1,080	9,720,000	
ファルコバイオシステムズ	1,700	905	1,538,500	
ワタベウエディング	1,300	1,932	2,511,600	
トーセ	1,100	1,557	1,712,700	
京進	1,100	404	444,400	
コタ	1,000	747	747,000	
互応化学工業	1,000	1,005	1,005,000	
日本電気硝子	15,000	1,846	27,690,000	
メタルアート	2,000	374	748,000	
日東精工	6,000	926	5,556,000	
京都機械工具	2,000	335	670,000	
サンコー	5,000	650	3,250,000	
キヤノンマシナリー	1,100	3,460	3,806,000	
サムコ	600	1,195	717,000	
フジテック	13,000	705	9,165,000	
川重冷熱工業	2,000	445	890,000	
ニチダイ	1,200	710	852,000	
ユーシン精機	2,200	2,035	4,477,000	
日本電産	4,700	7,580	35,626,000	
第一精工	2,100	2,080	4,368,000	
日新電機	14,000	471	6,594,000	
オムロン	10,400	2,960	30,784,000	
不二電機工業	700	969	678,300	
シライ電子工業	1,900	402	763,800	
オプテックス・エフエー	3	175,000	525,000	

シーシーエス	3	320,000	960,000	
エスケーエレクトロニクス	14	103,000	1,442,000	
日本電産リード	500	1,650	825,000	
堀場製作所	5,700	4,450	25,365,000	
オブテックス	2,300	2,495	5,738,500	
ローム	3,100	9,790	30,349,000	
京セラ	2,600	10,720	27,872,000	
村田製作所	3,800	8,540	32,452,000	
ニチコン	10,500	1,603	16,831,500	
日本輸送機	5,000	634	3,170,000	
たけびし	2,000	497	994,000	
島津製作所	25,000	1,331	33,275,000	
大日本スクリーン	34,000	852	28,968,000	
日本写真印刷	6,000	3,190	19,140,000	
野崎印刷	3,000	188	564,000	
任天堂	700	53,700	37,590,000	
松風	2,200	1,621	3,566,200	
ルシアン	4,000	159	636,000	
ムーンバット	4,000	120	480,000	
キング	3,000	407	1,221,000	
上原成商事	3,000	548	1,644,000	
ニッセンHD	8,500	682	5,797,000	
平和堂	7,900	1,920	15,168,000	
滋賀銀行	36,000	768	27,648,000	
京都銀行	22,000	1,582	34,804,000	
アイフル	8,300	2,685	22,285,500	
びわこ銀行	19,000	211	4,009,000	
中央倉庫	2,000	1,300	2,600,000	
王将フードサービス	3,100	1,460	4,526,000	
合計	445,689		638,115,400	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第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。

「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」の状況
前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

「世界REITマザーファンド」の状況
前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

りそな・大阪応援・資産分散ファンド

(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)並びに同規則第2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、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か月未満であるため、財務諸表は6か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、前特定期間(平成18年9月27日から平成19年2月13日まで)及び当特定期間(平成19年2月14日から平成19年8月13日まで)の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 3 月 30 日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員

公認会計士

三浦邦仁 

指定社員
業務執行社員

公認会計士

久野佳樹 

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・大阪応援・資産分散ファンドの平成 18 年 9 月 27 日から平成 19 年 2 月 13 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、注記表並びに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・大阪応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 13 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。

大和証券投資信託委託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

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 9 月 28 日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士
業務執行社員

山元 太志



指定社員 公認会計士
業務執行社員

久野 佳樹



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・大阪応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 14 日から平成 19 年 8 月 13 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、注記表並びに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・大阪応援・資産分散ファンドの平成 19 年 8 月 13 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。

大和証券投資信託委託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・大阪応援・資産分散ファンド

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		平成19年2月13日現在 金 額 (円)	平成19年8月13日現在 金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		611,365,203	218,920,280
親投資信託受益証券		11,162,396,094	11,210,370,890
流動資産合計		11,773,761,297	11,429,291,170
資産合計		11,773,761,297	11,429,291,170
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		359,761,077	24,502,266
未払解約金		12,254,298	—
未払受託者報酬		467,747	533,403
未払委託者報酬		11,226,083	12,801,905
その他未払費用		291,405	493,231
流動負債合計		384,000,610	38,330,805
負債合計		384,000,610	38,330,805
純資産の部			
元本等			
元本	※1	11,274,968,138	12,251,135,456
剰余金			
期末剰余金		114,792,549	—
期末欠損金		—	860,175,091
(うち分配準備積立金)		(33,046,490)	(78,695,753)
剰余金合計	※2	114,792,549	△860,175,091
元本等合計		11,389,760,687	11,390,960,365
純資産合計		11,389,760,687	11,390,960,365
負債・純資産合計		11,773,761,297	11,429,291,170

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
		金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益			
受取利息		350,377	811,447
有価証券売買等損益		1,044,396,094	△742,025,204
営業収益合計		1,044,746,471	△741,213,757
営業費用			
受託者報酬		1,943,103	3,288,745
委託者報酬	※1	46,635,292	78,930,739
その他費用		291,405	523,430
営業費用合計		48,869,800	82,742,914
営業利益金額		995,876,671	—
営業損失金額		—	823,956,671
経常利益金額		995,876,671	—
経常損失金額		—	823,956,671
当期純利益金額		995,876,671	—
当期純損失金額		—	823,956,671
一部解約に伴う当期純利益金額分配額		1,115,469	—
一部解約に伴う当期純損失金額分配額		—	5,742,031
期首剰余金		—	114,792,549
剰余金増加額		82,227,023	6,893,490
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)		(82,227,023)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)		(—)	(6,893,490)
剰余金減少額		907,806	12,065,390
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)		(907,806)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)		(—)	(12,065,390)
分配金	※2	961,287,870	151,581,100
期末剰余金		114,792,549	—
期末欠損金		—	860,175,091

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1. ※1 期首元本額	7,502,409,332 円	11,274,968,138 円
期中追加設定元本額	3,856,187,956 円	2,270,046,219 円
期中一部解約元本額	83,629,150 円	1,293,878,901 円
2. 特定期間末日における受益権 の総数	11,274,968,138 口	12,251,135,456 口
3. ※2 元本の欠損	—————	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 860,175,091 円でありま す。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	5,667,165 円	9,214,873 円
2. ※2 分配金の計算過程	<p>（自平成 18 年 9 月 27 日 至平成 18 年 10 月 13 日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（22,768,351 円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（141,320,659 円）、投資信託約款に規定される収益調整金（9,317,107 円）及び分配準備積立金（0 円）より分配対象額は 173,406,117 円（1 万口当たり 211.08 円）であります、分配を行っておりません。</p> <p>（自平成 18 年 10 月 14 日 至平成 18 年 11 月 13 日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（10,479,385 円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0 円）、投資信託約款に規定される収益調整金（20,704,128 円）及び分配準備積立金（164,088,547 円）より分配対象額は 195,272,060 円（1 万口当たり 212.98 円）であります、分配を行っておりません。</p> <p>（自平成 18 年 11 月 14 日 至平成 18 年 12 月 13 日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した</p>	<p>（自平成 19 年 2 月 14 日 至平成 19 年 3 月 13 日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,565,255 円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0 円）、投資信託約款に規定される収益調整金（57,368,706 円）及び分配準備積立金（32,681,586 円）より分配対象額は 96,615,547 円（1 万口当たり 75.67 円）であり、うち 25,465,902 円（1 万口当たり 19.94 円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成 19 年 3 月 14 日 至平成 19 年 4 月 13 日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（59,877,185 円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0 円）、投資信託約款に規定される収益調整金（69,537,102 円）及び分配準備積立金（13,749,444 円）より分配対象額は 143,163,731 円（1 万口当たり 109.04 円）であり、うち 26,137,701 円（1 万口当たり 19.91 円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成 19 年 4 月 14 日 至平成 19 年 5 月 14 日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した</p>

額 (18,060,919 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (223,073,597 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (39,502,196 円) 及び分配準備積立金 (174,511,068 円) より分配対象額は 455,147,780 円 (1 万口当たり 484.10 円) であり、うち 355,587,128 円 (1 万口当たり 378.21 円) を分配金額としております。

(自平成 18 年 12 月 14 日 至平成 19 年 1 月 15 日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (37,589,298 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (194,663,469 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (56,850,195 円) 及び分配準備積立金 (59,881,611 円) より分配対象額は 348,984,573 円 (1 万口当たり 340.23 円) であり、うち 245,939,665 円 (1 万口当たり 239.77 円) を分配金額としております。

(自平成 19 年 1 月 16 日 至平成 19 年 2 月 13 日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (25,241,497 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (321,589,629 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (81,746,059 円) 及び分配準備積立金 (45,976,441 円) より分配対象額は 474,553,626 円 (1 万口当たり 420.89 円) であり、うち 359,761,077 円 (1 万口当たり 319.08 円) を分配金額としております。

額 (37,792,858 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (61,627,852 円) 及び分配準備積立金 (56,146,880 円) より分配対象額は 155,567,590 円 (1 万口当たり 117.91 円) であり、うち 25,270,805 円 (1 万口当たり 19.15 円) を分配金額としております。

(自平成 19 年 5 月 15 日 至平成 19 年 6 月 13 日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (13,565,093 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (61,477,802 円) 及び分配準備積立金 (67,725,278 円) より分配対象額は 142,768,173 円 (1 万口当たり 109.18 円) であり、うち 26,024,800 円 (1 万口当たり 19.90 円) を分配金額としております。

(自平成 19 年 6 月 14 日 至平成 19 年 7 月 13 日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (57,535,990 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (59,532,235 円) 及び分配準備積立金 (53,287,177 円) より分配対象額は 170,355,402 円 (1 万口当たり 134.87 円) であり、うち 24,179,626 円 (1 万口当たり 19.14 円) を分配金額としております。

	<p>(自平成19年7月14日 至平成19年8月13日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(19,273,844円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(57,875,402円)及び分配準備積立金(83,924,175円)より分配対象額は161,073,421円(1万口当たり131.48円)であり、うち24,502,266円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
--	--

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成19年2月13日現在		当 期 平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託 受益証券	11,162,396,094	359,245,947	11,210,370,890	△ 827,739,638
合 計	11,162,396,094	359,245,947	11,210,370,890	△ 827,739,638

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

前 期 自平成18年9月27日 至平成19年2月13日	当 期 自平成19年2月14日 至平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
該当事項はありません。	市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1. 0102 円 (10, 102 円)	0. 9298 円 (9, 298 円)

(4) 附属明細表

第 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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託 受益証券	大阪応援マザーファンド	3, 712, 617, 735	3, 766, 821, 953	
	ハイグレード・ソブリン・マザーファンド	3, 328, 346, 644	3, 788, 989, 819	
	世界REITマザーファンド	2, 911, 535, 308	3, 654, 559, 118	
合計		9, 952, 499, 687	11, 210, 370, 890	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第 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。

(参考)

当ファンドは「大阪応援マザーファンド」受益証券、「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」受益証券及び「世界REITマザーファンド」を主要投資対象としており、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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

「大阪応援マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

区 分	注記 番号	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
		金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		59,605,589	34,438,673
株式		3,626,277,000	3,731,516,800
未収配当金		622,350	798,960
流動資産合計		3,686,504,939	3,766,754,433
資産合計		3,686,504,939	3,766,754,433
負債の部			
負債合計		—	—
純資産の部			
元本等			
元本	※1	3,354,079,226	3,712,617,735
剰余金			
期末剰余金		332,425,713	54,136,698
剰余金合計		332,425,713	54,136,698
元本等合計		3,686,504,939	3,766,754,433
純資産合計		3,686,504,939	3,766,754,433
負債・純資産合計		3,686,504,939	3,766,754,433

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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段、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。</p>	<p>株式 同左</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>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、未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。</p>	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。ただし、平成 19 年 6 月 30 日以前に計上した受取配当金については、その金額が確定している場合には当該金額、未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。 (会計方針の変更) 従来、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、未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いましたが、「投資信託に関する会計規則に関する細則」の改正により、平成 19 年 7 月 1 日以降計上する受取配当金については、原則として、株式の配当落ち日において、予想配当金額についてもその全額を計上する方法に変更しました。 この変更による損益への影響は軽微であります。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
1. ※1 本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	2,460,000,000円	3,354,079,226円
同期中における追加設定元本額	894,079,226円	550,328,064円
同期中における一部解約元本額	—円	191,789,555円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
りそな・大阪応援・資産分散ファンド	3,354,079,226円	3,712,617,735円
計	3,354,079,226円	3,712,617,735円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	3,354,079,226口	3,712,617,735口

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成19年2月13日現在		平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	3,626,277,000	299,244,148	3,731,516,800	△ 340,310,009
合 計	3,626,277,000	299,244,148	3,731,516,800	△ 340,310,009

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成18年9月27日から平成19年2月13日まで、及び平成19年2月14日から平成19年8月13日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

自平成18年9月27日 至平成19年2月13日	自平成19年2月14日 至平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日		
関連当事者の名称 (当ファンドと当該関連当事者との関係)	取引の内容	取引の種類別の取引金額	取引により発生した債権又は債務に係る主な項目別の当該計算期間の末日における残高
大和証券 (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 1,462,678円	委託手数料の未受渡金額 未払金 ー円
大和証券SMBC (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 426,222円	委託手数料の未受渡金額 未払金 ー円

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針

社内規定により取引業者の選定を行っております。また、各資産の売買においては、社内基準に基づき最良執行を行っており、個々の取引条件はその結果として決定されております。なお、ビット（オファー）やベークスを引合い条件に用いる取引については、相見積もりをとっており、一般の取引と条件が同様と判断しております。当該取引の売買手数料相当額については、取引慣行上、取引総額に含まれますため金額を記載しておりません。

2. 取引条件の変更及び当該変更が計算書類に与えている影響
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0991円 (10,991円)	1.0146円 (10,146円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
大林組	58,000	642	37,236,000	
大和ハウス	47,000	1,650	77,550,000	
積水ハウス	55,000	1,545	84,975,000	
きんでん	21,000	1,110	23,310,000	
江崎グリコ	12,000	1,142	13,704,000	
日本ハム	18,000	1,292	23,256,000	
ローソン	8,300	3,990	33,117,000	
エディオン	8,800	1,101	9,688,800	
ハウス食品	8,900	1,863	16,580,700	
日清食品	10,200	3,530	36,006,000	
グンゼ	19,000	601	11,419,000	
東洋紡績	58,000	294	17,052,000	
帝人	76,000	634	48,184,000	
旭化成	115,000	834	95,910,000	
レンゴー	21,000	653	13,713,000	
エア・ウォーター	14,000	1,269	17,766,000	
日本触媒	16,000	1,054	16,864,000	
カネカ	29,000	913	26,477,000	
ダイセル化学	29,000	818	23,722,000	
積水化学	43,000	830	35,690,000	
武田薬品	24,900	7,900	196,710,000	
大日本住友製薬	32,000	1,096	35,072,000	
塩野義製薬	28,000	1,772	49,616,000	
田辺製薬	21,000	1,346	28,266,000	
小野薬品	9,800	6,400	62,720,000	
参天製薬	7,100	2,885	20,483,500	
日本ペイント	22,000	607	13,354,000	
関西ペイント	22,000	916	20,152,000	
小林製薬	3,500	3,900	13,650,000	
東洋炭素	1,800	11,280	20,304,000	
住友金属工業	272,000	621	168,912,000	
丸一鋼管	7,900	3,080	24,332,000	
住友電工	63,700	1,795	114,341,500	
クボタ	106,000	980	103,880,000	
ダイキン工業	22,200	4,950	109,890,000	
ダイフク	9,500	1,497	14,221,500	
N T N	37,000	968	35,816,000	
ジェイテクト	25,400	1,922	48,818,800	
松下電器産業	84,000	2,120	178,080,000	
シャープ	87,000	2,095	182,265,000	

日立マクセル	8,100	1,259	10,197,900	
船井電機	2,800	5,970	16,716,000	
キーエンス	4,100	25,560	104,796,000	
日東電工	13,700	5,700	78,090,000	
松下電工	62,000	1,393	86,366,000	
ダイハツ	36,000	1,120	40,320,000	
エクセディ	4,200	3,520	14,784,000	
シマノ	7,800	3,950	30,810,000	
コクヨ	11,000	1,254	13,794,000	
伊藤忠	127,000	1,238	157,226,000	
長瀬産業	11,000	1,377	15,147,000	
高島屋	26,000	1,251	32,526,000	
大丸	21,000	1,348	28,308,000	
阪急百貨店	16,000	1,039	16,624,000	
りそなホールディングス	451	239,000	107,789,000	
住友信託	135,000	951	128,385,000	
関西アーバン銀行	42,000	353	14,826,000	
大阪証券取引所	24	410,000	9,840,000	
ニッセイ同和損害保険	33,000	716	23,628,000	
富士火災	41,000	464	19,024,000	
ダイビル	10,100	1,761	17,786,100	
西日本旅客鉄道	162	517,000	83,754,000	
近畿鉄道	140,000	374	52,360,000	
阪急阪神HLDGS	102,000	618	63,036,000	
南海電鉄	43,000	353	15,179,000	
京阪電鉄	46,000	474	21,804,000	
商船三井	100,000	1,623	162,300,000	
住友倉庫	17,000	670	11,390,000	
関西電力	59,900	2,900	173,710,000	
大阪瓦斯	182,000	428	77,896,000	
合計	2,856,337		3,731,516,800	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第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。

「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」の状況
前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

「世界REITマザーファンド」の状況
前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド

(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）並びに同規則第2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、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か月未満であるため、財務諸表は6か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、前特定期間（平成18年9月27日から平成19年2月13日まで）及び当特定期間（平成19年2月14日から平成19年8月13日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成19年3月30日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員

公認会計士

三浦邦仁 

指定社員
業務執行社員

公認会計士

久野佳樹 

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・ひょうご応援・資産分散ファンドの平成18年9月27日から平成19年2月13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、注記表並びに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・ひょうご応援・資産分散ファンドの平成19年2月13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。

大和証券投資信託委託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

独立監査人の監査報告書

平成 19 年 9 月 28 日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員 公認会計士

山元 太志 

指定社員
業務執行社員 公認会計士

久野 佳樹 

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・ひょうご応援・資産分散ファンドの平成 19 年 2 月 14 日から平成 19 年 8 月 13 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、注記表並びに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・ひょうご応援・資産分散ファンドの平成 19 年 8 月 13 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。

大和証券投資信託委託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・ひょうご応援・資産分散ファンド

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		平成19年2月13日現在 金 額 (円)	平成19年8月13日現在 金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		75,842,533	56,672,372
親投資信託受益証券		1,611,692,232	1,773,512,027
未収入金		13,000,000	10,000,000
流動資産合計		1,700,534,765	1,840,184,399
資産合計		1,700,534,765	1,840,184,399
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		61,396,750	3,881,750
未払受託者報酬		69,332	84,896
未払委託者報酬		1,664,205	2,037,761
その他未払費用		46,986	76,496
流動負債合計		63,177,273	6,080,903
負債合計		63,177,273	6,080,903
純資産の部			
元本等			
元本	※1	1,620,483,009	1,940,875,388
剰余金			
期末剰余金		16,874,483	—
期末欠損金		—	106,771,892
(うち分配準備積立金)		(11,511,719)	(22,796,375)
剰余金合計	※2	16,874,483	△106,771,892
元本等合計		1,637,357,492	1,834,103,496
純資産合計		1,637,357,492	1,834,103,496
負債・純資産合計		1,700,534,765	1,840,184,399

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	注記 番号	前 期	当 期
		自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
		金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益			
受取利息		59,594	161,524
有価証券売買等損益		169,692,232	△55,180,205
営業収益合計		169,751,826	△55,018,681
営業費用			
受託者報酬		313,652	510,494
委託者報酬	※1	7,528,368	12,252,736
その他費用		46,986	82,259
営業費用合計		7,889,006	12,845,489
営業利益金額		161,862,820	—
営業損失金額		—	67,864,170
経常利益金額		161,862,820	—
経常損失金額		—	67,864,170
当期純利益金額		161,862,820	—
当期純損失金額		—	67,864,170
一部解約に伴う当期純利益金額分配額		863,684	2,117,834
期首剰余金		—	16,874,483
剰余金増加額		5,540,835	286,369
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)		(5,540,835)	(—)
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)		(—)	(286,369)
剰余金減少額		959,687	3,341,715
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)		(959,687)	(—)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)		(—)	(3,341,715)
分配金	※2	148,705,801	50,609,025
期末剰余金		16,874,483	—
期末欠損金		—	106,771,892

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 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、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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1. ※1 期首元本額	1,441,754,810 円	1,620,483,009 円
期中追加設定元本額	262,647,363 円	479,101,756 円
期中一部解約元本額	83,919,164 円	158,709,377 円
2. 特定期間末日における受益権 の総数	1,620,483,009 口	1,940,875,388 口
3. ※2 元本の欠損	—————	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 106,771,892 円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	915,895 円	1,410,648 円
2. ※2 分配金の計算過程	<p>(自平成 18 年 9 月 27 日 至平成 18 年 10 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (4,176,761 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (16,048,724 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (501,881 円) 及び分配準備積立金 (0 円) より分配対象額は 20,727,366 円 (1 万口当たり 140.21 円) であります。分配を行っておりません。</p> <p>(自平成 18 年 10 月 14 日 至平成 18 年 11 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (1,776,504 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (605,805 円) 及び分配準備積立金 (20,065,652 円) より分配対象額は 22,447,961 円 (1 万口当たり 149.12 円) であります。分配を行っておりません。</p> <p>(自平成 18 年 11 月 14 日 至平成 18 年 12 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (3,026,406 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券</p>	<p>(自平成 19 年 2 月 14 日 至平成 19 年 3 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (1,135,684 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (5,882,472 円) 及び分配準備積立金 (11,414,295 円) より分配対象額は 18,432,451 円 (1 万口当たり 94.95 円) であり、うち 3,862,913 円 (1 万口当たり 19.90 円) を分配金額としております。</p> <p>(自平成 19 年 3 月 14 日 至平成 19 年 4 月 13 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (8,991,468 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (6,932,748 円) 及び分配準備積立金 (8,621,426 円) より分配対象額は 24,545,642 円 (1 万口当たり 120.91 円) であり、うち 4,041,403 円 (1 万口当たり 19.91 円) を分配金額としております。</p> <p>(自平成 19 年 4 月 14 日 至平成 19 年 5 月 14 日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (6,246,812 円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券</p>

<p> 売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(45,719,977円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,396,142円)及び分配準備積立金(21,842,156円)より分配対象額は71,984,681円(1万口当たり477.95円)であり、うち55,394,775円(1万口当たり367.80円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成18年12月14日 至平成19年1月15日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(6,065,989円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(24,546,868円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,386,216円)及び分配準備積立金(15,098,397円)より分配対象額は49,097,470円(1万口当たり307.38円)であり、うち31,914,276円(1万口当たり199.80円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年1月16日 至平成19年2月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,614,596円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(56,023,311円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,362,764円)及び分配準備積立金(13,270,562円)より分配対象額は78,271,233円(1万口当たり483.01円)であり、うち61,396,750円(1万口当たり378.88円)を分配金額としております。 </p>	<p> 売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(5,088,942円)、投資信託約款に規定される収益調整金(7,066,805円)及び分配準備積立金(13,532,860円)より分配対象額は31,935,419円(1万口当たり156.69円)であり、うち3,824,882円(1万口当たり18.77円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年5月15日 至平成19年6月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(2,145,017円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(7,058,013円)及び分配準備積立金(20,847,950円)より分配対象額は30,050,980円(1万口当たり148.55円)であり、うち4,011,254円(1万口当たり19.83円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年6月14日 至平成19年7月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,489,576円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(20,438,886円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,810,643円)及び分配準備積立金(18,293,711円)より分配対象額は55,032,816円(1万口当たり282.21円)であり、うち30,986,823円(1万口当たり158.90円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年7月14日 至平成19年8月13日) </p>	<p> 売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(45,719,977円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,396,142円)及び分配準備積立金(21,842,156円)より分配対象額は71,984,681円(1万口当たり477.95円)であり、うち55,394,775円(1万口当たり367.80円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成18年12月14日 至平成19年1月15日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(6,065,989円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(24,546,868円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,386,216円)及び分配準備積立金(15,098,397円)より分配対象額は49,097,470円(1万口当たり307.38円)であり、うち31,914,276円(1万口当たり199.80円)を分配金額としております。 </p> <p> (自平成19年1月16日 至平成19年2月13日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,614,596円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(56,023,311円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,362,764円)及び分配準備積立金(13,270,562円)より分配対象額は78,271,233円(1万口当たり483.01円)であり、うち61,396,750円(1万口当たり378.88円)を分配金額としております。 </p>
---	---	---

		<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,009,299円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(287,893円)及び分配準備積立金(23,668,826円)より分配対象額は26,966,018円(1万口当たり138.94円)であり、うち3,881,750円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
--	--	---

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成19年2月13日現在		当 期 平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託 受益証券	1,611,692,232	61,260,609	1,773,512,027	△ 119,438,251
合 計	1,611,692,232	61,260,609	1,773,512,027	△ 119,438,251

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

前 期 自平成18年9月27日 至平成19年2月13日	当 期 自平成19年2月14日 至平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	当 期 自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
該当事項はありません。	市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	前 期 平成 19 年 2 月 13 日現在	当 期 平成 19 年 8 月 13 日現在
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1. 0104 円 (10, 104 円)	0. 9450 円 (9, 450 円)

(4) 附属明細表

第 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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託 受益証券	兵庫応援マザーファンド	531, 117, 619	592, 036, 809	
	ハイグレード・ソブリン・マザーファンド	525, 382, 153	598, 095, 042	
	世界REITマザーファンド	464, 770, 695	583, 380, 176	
合計		1, 521, 270, 467	1, 773, 512, 027	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第 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。

(参考)

当ファンドは「兵庫応援マザーファンド」受益証券、「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」受益証券及び「世界REITマザーファンド」を主要投資対象としており、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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

「兵庫応援マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

区 分	注記 番号	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
		金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		15,021,660	17,388,101
株式		517,372,600	574,232,200
未収入金		14,794,867	—
未収配当金		378,720	433,320
流動資産合計		547,567,847	592,053,621
資産合計		547,567,847	592,053,621
負債の部			
流動負債			
未払解約金		13,000,000	—
流動負債合計		13,000,000	—
負債合計		13,000,000	—
純資産の部			
元本等			
元本	※1	483,931,386	531,117,619
剰余金			
期末剰余金		50,636,461	60,936,002
剰余金合計		50,636,461	60,936,002
元本等合計		534,567,847	592,053,621
純資産合計		534,567,847	592,053,621
負債・純資産合計		547,567,847	592,053,621

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 18 年 9 月 27 日 至 平成 19 年 2 月 13 日	自 平成 19 年 2 月 14 日 至 平成 19 年 8 月 13 日
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>2. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>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段、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。</p> <p>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、未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。</p>	<p>株式 同左</p> <p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。ただし、平成 19 年 6 月 30 日以前に計上した受取配当金については、その金額が確定している場合には当該金額、未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。</p> <p>(会計方針の変更) 従来、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、未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いましたが、「投資信託に関する会計規則に関する細則」の改正により、平成 19 年 7 月 1 日以降計上する受取配当金については、原則として、株式の配当落ち日において、予想配当金額についてもその全額を計上する方法に変更しました。 この変更による損益への影響は軽微であります。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
1. ※1 本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	460,000,000 円	483,931,386 円
同期中における追加設定元本額	35,911,849 円	104,963,890 円
同期中における一部解約元本額	11,980,463 円	57,777,657 円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド	483,931,386 円	531,117,619 円
計	483,931,386 円	531,117,619 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	483,931,386 口	531,117,619 口

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成19年2月13日現在		平成19年8月13日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	517,372,600	46,136,557	574,232,200	△ 7,166,648
合 計	517,372,600	46,136,557	574,232,200	△ 7,166,648

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成18年9月27日から平成19年2月13日まで、及び平成19年2月14日から平成19年8月13日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日	自 平成19年2月14日 至 平成19年8月13日
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成18年9月27日 至 平成19年2月13日		
関連当事者の名称 (当ファンドと当該関連当事者との関係)	取引の内容	取引の種類別の取引金額	取引により発生した債権又は債務に係る主な項目別の当該計算期間の末日における残高
大和証券 (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 260,224円	委託手数料の未受渡金額 未払金 31,133円
大和証券SMBC (運用委託会社の持株会社の関係子会社)	株式の売買にかかる委託手数料	株式にかかるもの 24,772円	委託手数料の未受渡金額 未払金 ー円

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針

社内規定により取引業者の選定を行っております。また、各資産の売買においては、社内基準に基づき最良執行を行っており、個々の取引条件はその結果として決定されております。なお、ビット（オファー）やベークスを引合い条件に用いる取引については、相見積もりをとっており、一般の取引と条件が同様と判断しております。当該取引の売買手数料相当額については、取引慣行上、取引総額に含まれますため金額を記載しておりません。

2. 取引条件の変更及び当該変更が計算書類に与えている影響
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成19年2月13日現在	平成19年8月13日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1046円 (11,046円)	1,1147円 (11,147円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
モロゾフ	4,000	343	1,372,000	
伊藤ハム	24,000	491	11,784,000	
S F o o d s	4,000	1,023	4,092,000	
フジッコ	4,000	1,230	4,920,000	
ロックフィールド	1,500	1,741	2,611,500	
ケンコーマヨネーズ	1,000	765	765,000	
神戸物産	1,100	2,240	2,464,000	
アライドハーツ HLDGS	3,000	345	1,035,000	
ユニチカ	57,000	157	8,949,000	
日本毛織	10,000	937	9,370,000	
フェリシモ	1,300	2,400	3,120,000	
トリドール	6	232,000	1,392,000	
トーカロ	1,900	2,645	5,025,500	
住友精化	8,000	567	4,536,000	
多木化学	2,000	610	1,220,000	
フジプレミアム	3,900	420	1,638,000	
ハリマ化成	3,000	718	2,154,000	
石原薬品	900	1,660	1,494,000	
ビオフェルミン製薬	1,400	3,100	4,340,000	
関西ペイント	29,000	916	26,564,000	
ノエビア	4,200	1,345	5,649,000	
メック	2,400	1,049	2,517,600	
住友ゴム	21,400	1,277	27,327,800	
三ツ星ベルト	10,000	674	6,740,000	
バンドー化学	9,000	741	6,669,000	
日本山村硝子	13,000	293	3,809,000	
S E Cカーボン	4,000	2,090	8,360,000	
神戸製鋼所	66,000	434	28,644,000	
大和工業	6,000	4,760	28,560,000	
山陽特殊鋼	18,000	885	15,930,000	
日亜鋼業	6,000	504	3,024,000	
住友チタニウム	2,400	10,220	24,528,000	
アサヒブリテック	3,400	3,480	11,832,000	
ノーリツ	5,700	1,783	10,163,100	
タクマ	11,000	699	7,689,000	
大阪機工	8,000	412	3,296,000	
東洋機械金属	2,400	556	1,334,400	
神鋼環境ソリューション	7,000	210	1,470,000	
日工	5,000	328	1,640,000	
帝国電機製作所	600	2,790	1,674,000	

住友精密	6,000	604	3,624,000	
グローリー	6,800	3,310	22,508,000	
T O A	4,000	925	3,700,000	
古野電気	2,700	1,400	3,780,000	
日本電子材料	1,300	1,088	1,414,400	
シスメックス	5,400	4,540	24,516,000	
フェニックス電機	2,700	545	1,471,500	
大真空	6,000	760	4,560,000	
指月電機	3,000	410	1,230,000	
川崎重工業	59,000	504	29,736,000	
新明和工業	14,000	544	7,616,000	
極東開発工業	4,300	905	3,891,500	
ハイレックスコーポレーション	4,600	1,700	7,820,000	
西松屋チェーン	7,600	1,704	12,950,400	
S R I スポーツ	35	137,000	4,795,000	
アシックス	19,000	1,736	32,984,000	
東リ	8,000	289	2,312,000	
三共生興	7,000	461	3,227,000	
トーヨー	6,000	377	2,262,000	
マックスバリュ西日本	2,900	1,509	4,376,100	
みなの銀行	45,000	255	11,475,000	
ファースト住建	1,900	806	1,531,400	
山陽電鉄	13,000	330	4,290,000	
神姫バス	3,000	646	1,938,000	
川崎汽船	20,000	1,485	29,700,000	
明治海運	1,700	953	1,620,100	
上組	29,000	968	28,072,000	
日本管財	2,400	3,360	8,064,000	
加藤産業	4,300	1,498	6,441,400	
関西スーパーマーケット	3,300	795	2,623,500	
合計	660,441		574,232,200	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第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。

「ハイグレード・ソブリン・マザーファンド」の状況
前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

「世界REITマザーファンド」の状況
前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」に記載のとおりであります。

2 ファンドの現況

りそな・東京応援・資産分散ファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	18,263,071,917 円
II 負債総額	46,380,041 円
III 純資産総額 (I - II)	18,216,691,876 円
IV 発行済数量	19,383,489,602 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	0.9398 円

(参考) 東京応援マザーファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	5,948,664,064 円
II 負債総額	0 円
III 純資産総額 (I - II)	5,948,664,064 円
IV 発行済数量	5,735,751,288 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	1.0371 円

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	253,631,646,960 円
II 負債総額	13,245,709,607 円
III 純資産総額 (I - II)	240,385,937,353 円
IV 発行済数量	209,222,194,638 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	1.1490 円

(参考) 世界REITマザーファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	237,554,901,986 円
II 負債総額	1,107,388,310 円
III 純資産総額 (I - II)	236,447,513,676 円
IV 発行済数量	182,513,216,826 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	1.2955 円

りそな・埼玉応援・資産分散ファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	8,271,853,022 円
II 負債総額	9,795,365 円
III 純資産総額 (I - II)	8,262,057,657 円
IV 発行済数量	8,867,021,263 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	0.9318 円

(参考) 埼玉応援マザーファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	2,563,603,248 円
II 負債総額	0 円
III 純資産総額 (I - II)	2,563,603,248 円
IV 発行済数量	2,777,064,357 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	0.9231 円

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

りそな・多摩応援・資産分散ファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	2,685,412,315 円
II 負債総額	1,444,443 円
III 純資産総額 (I - II)	2,683,967,872 円
IV 発行済数量	2,875,323,694 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	0.9334 円

(参考) 多摩応援マザーファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	847,969,116 円
II 負債総額	3,418,510 円
III 純資産総額 (I - II)	844,550,606 円
IV 発行済数量	901,620,423 口
V 1 単位当たり純資産額 (III/IV)	0.9367 円

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

りそな・神奈川応援・資産分散ファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	1,797,527,558 円
II 負債総額	962,222 円
III 純資産総額 (I - II)	1,796,565,336 円
IV 発行済数量	1,929,476,263 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	0.9311 円

(参考) 神奈川応援マザーファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	581,118,158 円
II 負債総額	0 円
III 純資産総額 (I - II)	581,118,158 円
IV 発行済数量	630,633,313 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	0.9215 円

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

りそな・中部応援・資産分散ファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	8,600,046,078 円
II 負債総額	16,077,472 円
III 純資産総額 (I - II)	8,583,968,606 円
IV 発行済数量	8,946,374,218 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	0.9595 円

(参考) 中部応援マザーファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	2,833,550,880 円
II 負債総額	0 円
III 純資産総額 (I - II)	2,833,550,880 円
IV 発行済数量	2,575,704,874 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	1.1001 円

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	1,957,976,312 円
II 負債総額	1,052,111 円
III 純資産総額 (I - II)	1,956,924,201 円
IV 発行済数量	2,077,559,864 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	0.9419 円

(参考) 京都滋賀応援マザーファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	633,366,816 円
II 負債総額	0 円
III 純資産総額 (I - II)	633,366,816 円
IV 発行済数量	632,098,928 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	1.0020 円

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

りそな・大阪応援・資産分散ファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	11,407,370,752 円
II 負債総額	11,616,833 円
III 純資産総額 (I - II)	11,395,753,919 円
IV 発行済数量	12,095,323,905 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	0.9422 円

(参考) 大阪応援マザーファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	3,806,593,814 円
II 負債総額	0 円
III 純資産総額 (I - II)	3,806,593,814 円
IV 発行済数量	3,712,617,735 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	1.0253 円

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	1,787,386,894 円
II 負債総額	1,057,386 円
III 純資産総額 (I - II)	1,786,329,508 円
IV 発行済数量	1,869,931,109 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	0.9553 円

(参考) 兵庫応援マザーファンド

純資産額計算書

平成19年9月28日

I 資産総額	594,088,313 円
II 負債総額	0 円
III 純資産総額 (I - II)	594,088,313 円
IV 発行済数量	531,117,619 口
V 1単位当たり純資産額 (III/IV)	1.1186 円

(参考) ハイグレード・ソブリン・マザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

(参考) 世界REITマザーファンド

前記「りそな・東京応援・資産分散ファンド」の記載と同じ。

第5 設定及び解約の実績

りそな・東京応援・資産分散ファンド

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1 特定期間	7,803,751,633	238,844,322
第2 特定期間	7,950,563,086	2,201,263,054

(注) 当初設定数量は6,521,117,018口です。

りそな・埼玉応援・資産分散ファンド

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1 特定期間	4,528,336,286	28,011,869
第2 特定期間	1,151,006,022	833,934,597

(注) 当初設定数量は4,114,198,196口です。

りそな・多摩応援・資産分散ファンド

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1 特定期間	289,859,324	343,717,783
第2 特定期間	199,847,814	545,713,791

(注) 当初設定数量は3,319,368,889口です。

りそな・神奈川応援・資産分散ファンド

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1 特定期間	324,628,721	237,628,036
第2 特定期間	64,792,327	356,351,670

(注) 当初設定数量は2,156,421,034口です。

りそな・中部応援・資産分散ファンド

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1 特定期間	4,039,107,666	1,643,319
第2 特定期間	4,045,374,570	1,264,092,866

(注) 当初設定数量は2,276,149,882口です。

りそな・京都滋賀応援・資産分散ファンド

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1 特定期間	610,177,643	6,929,899
第2 特定期間	273,559,989	514,577,237

(注) 当初設定数量は1,732,622,055口です。

りそな・大阪応援・資産分散ファンド

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1 特定期間	3,856,187,956	83,629,150
第2 特定期間	2,270,046,219	1,293,878,901

(注) 当初設定数量は7,502,409,332口です。

りそな・ひょうご応援・資産分散ファンド

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1 特定期間	262,647,363	83,919,164
第2 特定期間	479,101,756	158,709,377

(注) 当初設定数量は1,441,754,810口です。