

SECURITIES AND EXCHANGE COMMISSION

FORM NSAR-A

Semi-annual report for management companies filed on Form N-SAR

Filing Date: **1996-08-26** | Period of Report: **1996-06-30**
SEC Accession No. **0001005109-96-000002**

([HTML Version](#) on [secdatabase.com](#))

FILER

ASSET ALLOCATION PORTFOLIOS

CIK: **1005109** | State of Incorporation: **NY** | Fiscal Year End: **1231**
Type: **NSAR-A** | Act: **40** | File No.: **811-07459** | Film No.: **96620327**

Mailing Address
*ELIZABETHAN SQUARE
GEORGE TOWN GRAND
CAYMAN
CAYMAN ISLANDS BWI E9*

Business Address
*BINGHAM DANA & GOULD
150 FEDERAL ST
BOSTON MA 02110-1726
6179518383*

PAGE 1
000 A000000 06/30/96
000 C000000 0001005109
000 D000000 N
000 E000000 NF
000 F000000 Y
000 G000000 N
000 H000000 N
000 I000000 3.0.a
000 J000000 A
001 A000000 ASSET ALLOCATION PORTFOLIO
001 B000000 811-7459
001 C000000 6174231679
002 A000000 6 ST JAMES AVENUE
002 B000000 BOSTON
002 C000000 MA
002 D010000 02116
003 000000 Y
004 000000 N
005 000000 N
006 000000 N
007 A000000 Y
007 B000000 3
007 C010100 1
007 C020100 ASSET ALLOCATION PORTFOLIO 200
007 C030100 N
007 C010200 2
007 C020200 ASSET ALLOCATION PORTFOLIO 300
007 C030200 N
007 C010300 3
007 C020300 ASSET ALLOCATION PORTFOLIO 400
007 C030300 N
007 C010400 4
007 C010500 5
007 C010600 6
007 C010700 7
007 C010800 8
007 C010900 9
007 C011000 10
020 A000001 MORGAN STANLEY & CO INC.
020 B000001 13-2655998
020 C000001 16
020 A000002 CAPITAL INSTITUTIONAL SERVICES, INC.
020 B000002 75-1565705
020 C000002 14
020 A000003 INSTINET CORP.
020 B000003 13-3443395
020 C000003 13
020 A000004 SMITH BARNEY

020 B000004 13-3371860
020 C000004 9
020 A000005 BEAR STERNS & CO, INC.

PAGE 2

020 B000005 13-3299429
020 C000005 6
020 A000006 UBS SECURITIES, INC.
020 B000006 13-2932996
020 C000006 5
020 A000007 EVEREN SECURITIES, INC.
020 B000007 34-1542819
020 C000007 3
020 A000008 BARING SECURITIES, INC.
020 B000008 13-3713590
020 C000008 3
020 A000009 EDWARD(A.G) & SONS INC.
020 B000009 43-0895447
020 C000009 3
020 A000010 PEREGRINE BROKERAGE, INC.
020 B000010 13-3580644
020 C000010 3
021 000000 100
022 A000001 HSBC SECURITIES, INC.
022 B000001 13-2650272
022 C000001 90227
022 D000001 0
022 A000002 MERRILL LYNCH, PIERCE, FENNER & SMITH INC.
022 B000002 13-5674085
022 C000002 58047
022 D000002 10361
022 A000003 DRESDNER SECURITIES, INC.
022 B000003 04-2442748
022 C000003 55257
022 D000003 0
022 A000004 LANSTON (AUBREY G.) & CO.,INC.
022 B000004 13-5552129
022 C000004 38668
022 D000004 0
022 A000005 LEHMAN BROTHERS, INC.
022 B000005 13-2518466
022 C000005 22932
022 D000005 0
022 A000006 NESBITT BURNS SECURITIES, INC.
022 B000006 NA
022 C000006 19607
022 D000006 0
022 A000007 UBS SECURITIES, INC.
022 B000007 13-2932996
022 C000007 9864
022 D000007 6698

022 A000008 MORGAN GRENFELL
022 B000008 NA
022 C000008 14534
022 D000008 0
022 A000009 GOLDMAN SACHS & CO.

PAGE 3

022 B000009 13-5108880
022 C000009 11642
022 D000009 0
022 A000010 MORGAN STANLEY & CO., INC.
022 B000010 13-2655998
022 C000010 9845
022 D000010 0
023 C000000 390457
023 D000000 25079
026 A000000 N
026 B000000 Y
026 C000000 Y
026 D000000 Y
026 E000000 N
026 F000000 N
026 G010000 N
026 G020000 N
026 H000000 N
027 000000 Y
077 A000000 N
086 A010000 0
086 A020000 0
086 B010000 0
086 B020000 0
086 C010000 0
086 C020000 0
086 D010000 0
086 D020000 0
086 E010000 0
086 E020000 0
086 F010000 0
086 F020000 0
008 A000101 CITIBANK, NA
008 B000101 A
008 C000101 801-000000
008 D010101 NEW YORK
008 D020101 NY
008 D030101 10043
010 A000101 LANDMARK FUNDS BROKER DEALER SERVICES, INC.
010 B000101 8-41134
010 C010101 BOSTON
010 C020101 MA
010 C030101 02116
011 A000101 LANDMARK FUNDS BROKER DEALER SERVICES, INC.

011 B000101 8-15648
011 C010101 BOSTON
011 C020101 MA
011 C030101 02116
012 A000101 CITIBANK, NA
012 B000101 84-0000000
012 C010101 NEW YORK

PAGE 4

012 C020101 NY
012 C030101 10043
013 A000101 PRICE WATERHOUSE, LLP
013 B010101 BOSTON
013 B020101 MA
013 B030101 02110
014 A000101 THE LANDMARK FUNDS BROKER DEALER SERVICES, INC
014 B000101 8-15648
015 A000101 STATE STREET BANK AND TRUST COMPANY
015 B000101 C
015 C010101 BOSTON
015 C020101 MA
015 C030101 02110
015 E010101 X
018 000100 Y
019 A000100 Y
019 B000100 38
019 C000100 LANDMARK..
024 000100 N
025 D000101 0
025 D000102 0
025 D000103 0
025 D000104 0
025 D000105 0
025 D000106 0
025 D000107 0
025 D000108 0
028 A010100 0
028 A020100 0
028 A030100 0
028 A040100 0
028 B010100 0
028 B020100 0
028 B030100 0
028 B040100 0
028 C010100 0
028 C020100 0
028 C030100 0
028 C040100 0
028 D010100 0
028 D020100 0
028 D030100 0

028	D040100	0
028	E010100	0
028	E020100	0
028	E030100	0
028	E040100	0
028	F010100	15255
028	F020100	0
028	F030100	0
028	F040100	0

PAGE 5

028	G010100	15255
028	G020100	0
028	G030100	0
028	G040100	0
028	H000100	15255
029	000100	N
030	A000100	0
030	B000100	0.00
030	C000100	0.00
031	A000100	0
031	B000100	0
032	000100	0
033	000100	0
034	000100	N
035	000100	0
036	B000100	0
037	000100	N
038	000100	0
039	000100	N
040	000100	N
042	A000100	0
042	B000100	0
042	C000100	0
042	D000100	0
042	E000100	0
042	F000100	0
042	G000100	0
042	H000100	0
043	000100	0
044	000100	0
045	000100	Y
046	000100	N
047	000100	Y
048	000100	0.650
048	A010100	0
048	A020100	0.000
048	B010100	0
048	B020100	0.000
048	C010100	0
048	C020100	0.000

048 D010100 0
048 D020100 0.000
048 E010100 0
048 E020100 0.000
048 F010100 0
048 F020100 0.000
048 G010100 0
048 G020100 0.000
048 H010100 0
048 H020100 0.000
048 I010100 0

PAGE 6

048 I020100 0.000
048 J010100 0
048 J020100 0.000
048 K010100 0
048 K020100 0.000
049 000100 N
050 000100 N
051 000100 N
052 000100 N
053 A000100 Y
053 B000100 Y
053 C000100 N
054 A000100 Y
054 B000100 Y
054 C000100 Y
054 D000100 N
054 E000100 N
054 F000100 N
054 G000100 Y
054 H000100 Y
054 I000100 N
054 J000100 Y
054 K000100 N
054 L000100 N
054 M000100 Y
054 N000100 N
054 O000100 N
055 A000100 N
055 B000100 N
056 000100 Y
057 000100 N
058 A000100 N
058 B000100 N
058 C000100 N
058 D000100 N
058 E000100 N
059 000100 Y
060 A000100 Y

060 B000100 Y
061 000100 1000
062 A000100 N
062 B000100 0.0
062 C000100 0.0
062 D000100 0.0
062 E000100 0.0
062 F000100 0.0
062 G000100 0.0
062 H000100 0.0
062 I000100 0.0
062 J000100 0.0
062 K000100 0.0

PAGE 7

062 L000100 0.0
062 M000100 0.0
062 N000100 0.0
062 O000100 0.0
062 P000100 0.0
062 Q000100 0.0
062 R000100 0.0
063 A000100 0
063 B000100 0.0
066 A000100 Y
066 B000100 N
066 C000100 N
066 D000100 N
066 E000100 N
066 F000100 Y
066 G000100 N
067 000100 Y
068 A000100 N
068 B000100 N
069 000100 N
070 A010100 Y
070 A020100 N
070 B010100 Y
070 B020100 N
070 C010100 Y
070 C020100 Y
070 D010100 Y
070 D020100 N
070 E010100 Y
070 E020100 N
070 F010100 N
070 F020100 N
070 G010100 Y
070 G020100 N
070 H010100 N
070 H020100 N

070 I010100 N
070 I020100 N
070 J010100 Y
070 J020100 Y
070 K010100 Y
070 K020100 N
070 L010100 Y
070 L020100 Y
070 M010100 Y
070 M020100 Y
070 N010100 Y
070 N020100 N
070 O010100 N
070 O020100 N
070 P010100 N

PAGE 8

070 P020100 N
070 Q010100 N
070 Q020100 N
070 R010100 N
070 R020100 N
071 A000100 16623
071 B000100 5499
071 C000100 11449
071 D000100 48
072 A000100 1
072 B000100 15
072 C000100 1
072 D000100 0
072 E000100 0
072 F000100 2
072 G000100 0
072 H000100 0
072 I000100 0
072 J000100 5
072 K000100 0
072 L000100 2
072 M000100 1
072 N000100 0
072 O000100 0
072 P000100 0
072 Q000100 0
072 R000100 3
072 S000100 1
072 T000100 0
072 U000100 0
072 V000100 0
072 W000100 0
072 X000100 14
072 Y000100 12

072 Z000100	14
072AA000100	0
072BB000100	0
072CC010100	46
072CC020100	0
072DD010100	0
072DD020100	0
072EE000100	0
073 A010100	0.0000
073 A020100	0.0000
073 B000100	0.0000
073 C000100	0.0000
074 A000100	5
074 B000100	0
074 C000100	7254
074 D000100	6195
074 E000100	0

PAGE 9

074 F000100	4971
074 G000100	0
074 H000100	0
074 I000100	0
074 J000100	3416
074 K000100	0
074 L000100	115
074 M000100	224
074 N000100	22180
074 O000100	6862
074 P000100	0
074 Q000100	0
074 R010100	0
074 R020100	0
074 R030100	0
074 R040100	3
074 S000100	0
074 T000100	15315
074 U010100	0
074 U020100	0
074 V010100	0.00
074 V020100	0.00
074 W000100	0.0000
074 X000100	0
074 Y000100	0
075 A000100	0
075 B000100	9424
076 000100	0.00
080 C000100	0
081 B000100	0
082 B000100	0
083 B000100	0

084 B000100 0
 008 A000201 CITIBANK, NA
 008 B000201 A
 008 C000201 801-000000
 008 D010201 NEW YORK
 008 D020201 NY
 008 D030201 10043
 010 A000201 LANDMARK FUNDS BROKER DEALER SERVICES, INC.
 010 B000201 8-41134
 010 C010201 BOSTON
 010 C020201 MA
 010 C030201 02116
 011 A000201 LANDMARK FUNDS BROKER DEALER SERVICES, INC.
 011 B000201 8-15648
 011 C010201 BOSTON
 011 C020201 MA
 011 C030201 02116
 012 A000201 CITIBANK, NA
 012 B000201 84-0000000

PAGE 10

012 C010201 NEW YORK
 012 C020201 NY
 012 C030201 10043
 013 A000201 PRICE WATERHOUSE, LLP
 013 B010201 BOSTON
 013 B020201 MA
 013 B030201 02110
 014 A000201 THE LANDMARK FUNDS BROKER DEALER SERVICES, INC
 014 B000201 8-15648
 015 A000201 STATE STREET BANK AND TRUST COMPANY
 015 B000201 C
 015 C010201 BOSTON
 015 C020201 MA
 015 C030201 02110
 015 E010201 X
 018 000200 Y
 019 A000200 Y
 019 B000200 38
 019 C000200 LANDMARK..
 024 000200 N
 025 D000201 0
 025 D000202 0
 025 D000203 0
 025 D000204 0
 025 D000205 0
 025 D000206 0
 025 D000207 0
 025 D000208 0
 028 A010200 0
 028 A020200 0

028	A030200	0
028	A040200	0
028	B010200	0
028	B020200	0
028	B030200	0
028	B040200	0
028	C010200	0
028	C020200	0
028	C030200	0
028	C040200	0
028	D010200	0
028	D020200	0
028	D030200	0
028	D040200	0
028	E010200	0
028	E020200	0
028	E030200	0
028	E040200	0
028	F010200	34620
028	F020200	0
028	F030200	0

PAGE 11

028	F040200	0
028	G010200	34620
028	G020200	0
028	G030200	0
028	G040200	0
028	H000200	34620
029	000200	N
030	A000200	0
030	B000200	0.00
030	C000200	0.00
031	A000200	0
031	B000200	0
032	000200	0
033	000200	0
034	000200	N
035	000200	0
036	B000200	0
037	000200	N
038	000200	0
039	000200	N
040	000200	N
042	A000200	0
042	B000200	0
042	C000200	0
042	D000200	0
042	E000200	0
042	F000200	0
042	G000200	0

042 H000200 0
043 000200 0
044 000200 0
045 000200 Y
046 000200 N
047 000200 Y
048 000200 0.650
048 A010200 0
048 A020200 0.000
048 B010200 0
048 B020200 0.000
048 C010200 0
048 C020200 0.000
048 D010200 0
048 D020200 0.000
048 E010200 0
048 E020200 0.000
048 F010200 0
048 F020200 0.000
048 G010200 0
048 G020200 0.000
048 H010200 0
048 H020200 0.000

PAGE 12

048 I010200 0
048 I020200 0.000
048 J010200 0
048 J020200 0.000
048 K010200 0
048 K020200 0.000
049 000200 N
050 000200 N
051 000200 N
052 000200 N
053 A000200 Y
053 B000200 Y
053 C000200 N
054 A000200 Y
054 B000200 Y
054 C000200 Y
054 D000200 N
054 E000200 N
054 F000200 N
054 G000200 Y
054 H000200 Y
054 I000200 N
054 J000200 Y
054 K000200 N
054 L000200 N
054 M000200 Y

054 N000200 N
054 O000200 N
055 A000200 N
055 B000200 N
056 000200 Y
057 000200 N
058 A000200 N
058 B000200 N
058 C000200 N
058 D000200 N
058 E000200 N
059 000200 Y
060 A000200 Y
060 B000200 Y
061 000200 1000
062 A000200 N
062 B000200 0.0
062 C000200 0.0
062 D000200 0.0
062 E000200 0.0
062 F000200 0.0
062 G000200 0.0
062 H000200 0.0
062 I000200 0.0
062 J000200 0.0

PAGE 13

062 K000200 0.0
062 L000200 0.0
062 M000200 0.0
062 N000200 0.0
062 O000200 0.0
062 P000200 0.0
062 Q000200 0.0
062 R000200 0.0
063 A000200 0
063 B000200 0.0
066 A000200 Y
066 B000200 N
066 C000200 Y
066 D000200 N
066 E000200 N
066 F000200 N
066 G000200 N
067 000200 Y
068 A000200 N
068 B000200 N
069 000200 N
070 A010200 Y
070 A020200 N
070 B010200 Y

070 B020200 N
070 C010200 Y
070 C020200 Y
070 D010200 Y
070 D020200 N
070 E010200 Y
070 E020200 N
070 F010200 N
070 F020200 N
070 G010200 Y
070 G020200 N
070 H010200 N
070 H020200 N
070 I010200 N
070 I020200 N
070 J010200 Y
070 J020200 Y
070 K010200 Y
070 K020200 N
070 L010200 Y
070 L020200 Y
070 M010200 Y
070 M020200 Y
070 N010200 Y
070 N020200 N
070 O010200 N
070 O020200 N

PAGE 14

070 P010200 N
070 P020200 N
070 Q010200 N
070 Q020200 N
070 R010200 N
070 R020200 N
071 A000200 42319
071 B000200 12741
071 C000200 30166
071 D000200 42
072 A000200 1
072 B000200 34
072 C000200 2
072 D000200 0
072 E000200 0
072 F000200 5
072 G000200 0
072 H000200 0
072 I000200 0
072 J000200 6
072 K000200 0
072 L000200 2

072 M000200	1
072 N000200	0
072 O000200	0
072 P000200	0
072 Q000200	0
072 R000200	3
072 S000200	1
072 T000200	0
072 U000200	0
072 V000200	0
072 W000200	0
072 X000200	18
072 Y000200	12
072 Z000200	30
072AA000200	2
072BB000200	0
072CC010200	90
072CC020200	0
072DD010200	0
072DD020200	0
072EE000200	0
073 A010200	0.0000
073 A020200	0.0000
073 B000200	0.0000
073 C000200	0.0000
074 A000200	10
074 B000200	0
074 C000200	13396
074 D000200	14079

PAGE 15

074 E000200	0
074 F000200	15580
074 G000200	0
074 H000200	0
074 I000200	0
074 J000200	7629
074 K000200	0
074 L000200	258
074 M000200	508
074 N000200	51460
074 O000200	16712
074 P000200	0
074 Q000200	0
074 R010200	0
074 R020200	0
074 R030200	0
074 R040200	6
074 S000200	0
074 T000200	34742
074 U010200	0

074 U020200 0
074 V010200 0.00
074 V020200 0.00
074 W000200 0.0000
074 X000200 0
074 Y000200 0
075 A000200 0
075 B000200 21567
076 000200 0.00
080 C000200 0
081 B000200 0
082 B000200 0
083 B000200 0
084 B000200 0
008 A000301 CITIBANK, NA
008 B000301 A
008 C000301 801-000000
008 D010301 NEW YORK
008 D020301 NY
008 D030301 10043
010 A000301 LANDMARL FUNDS BROKER DEALER SERVICES, INC.
010 B000301 8-41134
010 C010301 BOSTON
010 C020301 MA
010 C030301 02116
011 A000301 LANDMARK FUNDS BROKER DEALER SERVICES, INC.
011 B000301 8-15648
011 C010301 BOSTON
011 C020301 MA
011 C030301 02116
012 A000301 CITIBANK, NA

PAGE 16

012 B000301 84-0000000
012 C010301 NEW YORK
012 C020301 NY
012 C030301 10043
013 A000301 PRICE WATERHOUSE, LLP
013 B010301 BOSTON
013 B020301 MA
013 B030301 02110
014 A000301 THE LANDMARK FUNDS BROKER DEALER SERVICES, INC
014 B000301 8-15648
015 A000301 STATE STREET BANK AND TRUST COMPANY
015 B000301 C
015 C010301 BOSTON
015 C020301 MA
015 C030301 02110
015 E010301 X
018 000300 Y
019 A000300 Y

019	B000300	38
019	C000300	LANDMARK..
024	000300	N
025	D000301	0
025	D000302	0
025	D000303	0
025	D000304	0
025	D000305	0
025	D000306	0
025	D000307	0
025	D000308	0
028	A010300	0
028	A020300	0
028	A030300	0
028	A040300	0
028	B010300	0
028	B020300	0
028	B030300	0
028	B040300	0
028	C010300	0
028	C020300	0
028	C030300	0
028	C040300	0
028	D010300	0
028	D020300	0
028	D030300	0
028	D040300	0
028	E010300	0
028	E020300	0
028	E030300	0
028	E040300	0
028	F010300	48436
028	F020300	0

PAGE 17

028	F030300	0
028	F040300	0
028	G010300	48436
028	G020300	0
028	G030300	0
028	G040300	0
028	H000300	48436
029	000300	N
030	A000300	0
030	B000300	0.00
030	C000300	0.00
031	A000300	0
031	B000300	0
032	000300	0
033	000300	0
034	000300	N

035	000300	0
036	B000300	0
037	000300	N
038	000300	0
039	000300	N
040	000300	N
042	A000300	0
042	B000300	0
042	C000300	0
042	D000300	0
042	E000300	0
042	F000300	0
042	G000300	0
042	H000300	0
043	000300	0
044	000300	0
045	000300	Y
046	000300	N
047	000300	Y
048	000300	0.650
048	A010300	0
048	A020300	0.000
048	B010300	0
048	B020300	0.000
048	C010300	0
048	C020300	0.000
048	D010300	0
048	D020300	0.000
048	E010300	0
048	E020300	0.000
048	F010300	0
048	F020300	0.000
048	G010300	0
048	G020300	0.000
048	H010300	0

PAGE 18

048	H020300	0.000
048	I010300	0
048	I020300	0.000
048	J010300	0
048	J020300	0.000
048	K010300	0
048	K020300	0.000
049	000300	N
050	000300	N
051	000300	N
052	000300	N
053	A000300	Y
053	B000300	Y
053	C000300	N

054 A000300 Y
054 B000300 Y
054 C000300 Y
054 D000300 N
054 E000300 N
054 F000300 N
054 G000300 Y
054 H000300 Y
054 I000300 N
054 J000300 Y
054 K000300 N
054 L000300 N
054 M000300 Y
054 N000300 N
054 O000300 N
055 A000300 N
055 B000300 N
056 000300 Y
057 000300 N
058 A000300 N
058 B000300 N
058 C000300 N
058 D000300 N
058 E000300 N
059 000300 Y
060 A000300 Y
060 B000300 Y
061 000300 1000
062 A000300 N
062 B000300 0.0
062 C000300 0.0
062 D000300 0.0
062 E000300 0.0
062 F000300 0.0
062 G000300 0.0
062 H000300 0.0
062 I000300 0.0

PAGE 19

062 J000300 0.0
062 K000300 0.0
062 L000300 0.0
062 M000300 0.0
062 N000300 0.0
062 O000300 0.0
062 P000300 0.0
062 Q000300 0.0
062 R000300 0.0
063 A000300 0
063 B000300 0.0
066 A000300 Y

066 B000300 N
066 C000300 Y
066 D000300 N
066 E000300 N
066 F000300 N
066 G000300 N
067 000300 Y
068 A000300 N
068 B000300 N
069 000300 N
070 A010300 Y
070 A020300 N
070 B010300 Y
070 B020300 N
070 C010300 Y
070 C020300 Y
070 D010300 Y
070 D020300 N
070 E010300 Y
070 E020300 N
070 F010300 N
070 F020300 N
070 G010300 Y
070 G020300 N
070 H010300 N
070 H020300 N
070 I010300 N
070 I020300 N
070 J010300 Y
070 J020300 Y
070 K010300 Y
070 K020300 N
070 L010300 Y
070 L020300 Y
070 M010300 Y
070 M020300 Y
070 N010300 Y
070 N020300 N
070 O010300 N

PAGE 20

070 O020300 N
070 P010300 N
070 P020300 N
070 Q010300 N
070 Q020300 N
070 R010300 N
070 R020300 N

071 A000300 28876
071 B000300 18818
071 C000300 41418

071	D000300	45
072	A000300	1
072	B000300	41
072	C000300	5
072	D000300	0
072	E000300	0
072	F000300	7
072	G000300	0
072	H000300	0
072	I000300	0
072	J000300	7
072	K000300	0
072	L000300	2
072	M000300	2
072	N000300	0
072	O000300	0
072	P000300	0
072	Q000300	0
072	R000300	3
072	S000300	1
072	T000300	0
072	U000300	0
072	V000300	0
072	W000300	0
072	X000300	22
072	Y000300	12
072	Z000300	36
072AA	000300	2
072BB	000300	0
072CC	010300	9
072CC	020300	0
072DD	010300	0
072DD	020300	0
072EE	000300	0
073	A010300	0.0000
073	A020300	0.0000
073	B000300	0.0000
073	C000300	0.0000
074	A000300	26
074	B000300	0
074	C000300	20731

PAGE 21

074	D000300	10129
074	E000300	0
074	F000300	30544
074	G000300	0
074	H000300	0
074	I000300	0
074	J000300	11012
074	K000300	0

074	L000300	271
074	M000300	745
074	N000300	73458
074	O000300	24966
074	P000300	0
074	Q000300	0
074	R010300	0
074	R020300	0
074	R030300	0
074	R040300	9
074	S000300	0
074	T000300	48483
074	U010300	0
074	U020300	0
074	V010300	0.00
074	V020300	0.00
074	W000300	0.0000
074	X000300	0
074	Y000300	0
075	A000300	0
075	B000300	31706
076	000300	0.00
080	C000300	0
081	B000300	0
082	B000300	0
083	B000300	0
084	B000300	0
SIGNATURE	JOHN R. ELDER	
TITLE	TREASURER	

WARNING: THE EDGAR SYSTEM ENCOUNTERED ERROR(S) WHILE PROCESSING THIS SCHEDULE.

<TABLE> <S> <C>

<ARTICLE> 6

<CIK> 0001005109

<NAME> ASSET ALLOCATION PORTFOLIO 200

<SERIES>

<NUMBER> 1

<NAME>ASSET ALLOCATION PORTFOLIO

<S>	<C>
<PERIOD-TYPE>	1-mos
<FISCAL-YEAR-END>	DEC-31-1996
<PERIOD-END>	JUN-30-1996
<INVESTMENTS-AT-COST>	18,597,597
<INVESTMENTS-AT-VALUE>	18,643,518
<RECEIVABLES>	3,531,363
<ASSETS-OTHER>	0
<OTHER-ITEMS-ASSETS>	5,374
<TOTAL-ASSETS>	22,180,255
<PAYABLE-FOR-SECURITIES>	6,645,088
<SENIOR-LONG-TERM-DEBT>	0
<OTHER-ITEMS-LIABILITIES>	0
<TOTAL-LIABILITIES>	6,645,088
<SENIOR-EQUITY>	0
<PAID-IN-CAPITAL-COMMON>	15,315,421
<SHARES-COMMON-STOCK>	0
<SHARES-COMMON-PRIOR>	0
<ACCUMULATED-NII-CURRENT>	0
<OVERDISTRIBUTION-NII>	0
<ACCUMULATED-NET-GAINS>	0
<OVERDISTRIBUTION-GAINS>	0
<ACCUM-APPREC-OR-DEPREC>	0
<NET-ASSETS>	15,315,421
<DIVIDEND-INCOME>	608
<INTEREST-INCOME>	15,855
<OTHER-INCOME>	0
<EXPENSES-NET>	2,622
<NET-INVESTMENT-INCOME>	13,841
<REALIZED-GAINS-CURRENT>	324
<APPREC-INCREASE-CURRENT>	45,921
<NET-CHANGE-FROM-OPS>	60,086
<EQUALIZATION>	0
<DISTRIBUTIONS-OF-INCOME>	0
<DISTRIBUTIONS-OF-GAINS>	0
<DISTRIBUTIONS-OTHER>	0
<NUMBER-OF-SHARES-SOLD>	15,255,335
<NUMBER-OF-SHARES-REDEEMED>	0

<SHARES-REINVESTED>	0
<NET-CHANGE-IN-ASSETS>	15,315,421
<ACCUMULATED-NII-PRIOR>	0
<ACCUMULATED-GAINS-PRIOR>	0
<OVERDISTRIB-NII-PRIOR>	0
<OVERDIST-NET-GAINS-PRIOR>	0
<GROSS-ADVISORY-FEES>	2,009
<INTEREST-EXPENSE>	0
<GROSS-EXPENSE>	14,109
<AVERAGE-NET-ASSETS>	9,423,862
<PER-SHARE-NAV-BEGIN>	0.00
<PER-SHARE-NII>	0.00
<PER-SHARE-GAIN-APPREC>	0.00
<PER-SHARE-DIVIDEND>	0.00
<PER-SHARE-DISTRIBUTIONS>	0.00
<RETURNS-OF-CAPITAL>	0.00
<PER-SHARE-NAV-END>	0.00
<EXPENSE-RATIO>	0.85
<AVG-DEBT-OUTSTANDING>	0
<AVG-DEBT-PER-SHARE>	0

</TABLE>

WARNING: THE EDGAR SYSTEM ENCOUNTERED ERROR(S) WHILE PROCESSING THIS SCHEDULE.

<TABLE> <S> <C>

<ARTICLE> 6

<CIK> 0001005109

<NAME> ASSET ALLOCATION PORTFOLIO 300

<SERIES>

<NUMBER> 2

<NAME>ASSET ALLOCATION PORTFOLIO

<S>	<C>
<PERIOD-TYPE>	1-mos
<FISCAL-YEAR-END>	DEC-31-1996
<PERIOD-END>	JUN-30-1996
<INVESTMENTS-AT-COST>	43,472,531
<INVESTMENTS-AT-VALUE>	43,562,270
<RECEIVABLES>	7,886,956
<ASSETS-OTHER>	0
<OTHER-ITEMS-ASSETS>	10,456
<TOTAL-ASSETS>	51,459,682
<PAYABLE-FOR-SECURITIES>	16,220,061
<SENIOR-LONG-TERM-DEBT>	0
<OTHER-ITEMS-LIABILITIES>	0
<TOTAL-LIABILITIES>	16,220,061
<SENIOR-EQUITY>	0
<PAID-IN-CAPITAL-COMMON>	34,741,955
<SHARES-COMMON-STOCK>	0
<SHARES-COMMON-PRIOR>	0
<ACCUMULATED-NII-CURRENT>	0
<OVERDISTRIBUTION-NII>	0
<ACCUMULATED-NET-GAINS>	0
<OVERDISTRIBUTION-GAINS>	0
<ACCUM-APPREC-OR-DEPREC>	0
<NET-ASSETS>	34,741,955
<DIVIDEND-INCOME>	2,265
<INTEREST-INCOME>	33,617
<OTHER-INCOME>	0
<EXPENSES-NET>	6,012
<NET-INVESTMENT-INCOME>	29,870
<REALIZED-GAINS-CURRENT>	2,542
<APPREC-INCREASE-CURRENT>	89,739
<NET-CHANGE-FROM-OPS>	122,151
<EQUALIZATION>	0
<DISTRIBUTIONS-OF-INCOME>	0
<DISTRIBUTIONS-OF-GAINS>	0
<DISTRIBUTIONS-OTHER>	0
<NUMBER-OF-SHARES-SOLD>	34,619,804
<NUMBER-OF-SHARES-REDEEMED>	0

<SHARES-REINVESTED>	0
<NET-CHANGE-IN-ASSETS>	34,741,955
<ACCUMULATED-NII-PRIOR>	0
<ACCUMULATED-GAINS-PRIOR>	0
<OVERDISTRIB-NII-PRIOR>	0
<OVERDIST-NET-GAINS-PRIOR>	0
<GROSS-ADVISORY-FEES>	4,596
<INTEREST-EXPENSE>	0
<GROSS-EXPENSE>	17,696
<AVERAGE-NET-ASSETS>	21,567,406
<PER-SHARE-NAV-BEGIN>	0.00
<PER-SHARE-NII>	0.00
<PER-SHARE-GAIN-APPREC>	0.00
<PER-SHARE-DIVIDEND>	0.00
<PER-SHARE-DISTRIBUTIONS>	0.00
<RETURNS-OF-CAPITAL>	0.00
<PER-SHARE-NAV-END>	0.00
<EXPENSE-RATIO>	0.85
<AVG-DEBT-OUTSTANDING>	0
<AVG-DEBT-PER-SHARE>	0

</TABLE>

WARNING: THE EDGAR SYSTEM ENCOUNTERED ERROR(S) WHILE PROCESSING THIS SCHEDULE.

<TABLE> <S> <C>

<ARTICLE> 6

<CIK> 0001005109

<NAME> ASSET ALLOCATION PORTFOLIO 400

<SERIES>

<NUMBER> 3

<NAME>ASSET ALLOCATION PORTFOLIO

<S>	<C>
<PERIOD-TYPE>	1-mos
<FISCAL-YEAR-END>	DEC-31-1996
<PERIOD-END>	JUN-30-1996
<INVESTMENTS-AT-COST>	62,140,002
<INVESTMENTS-AT-VALUE>	62,148,585
<RECEIVABLES>	11,283,015
<ASSETS-OTHER>	0
<OTHER-ITEMS-ASSETS>	26,297
<TOTAL-ASSETS>	73,457,897
<PAYABLE-FOR-SECURITIES>	24,244,798
<SENIOR-LONG-TERM-DEBT>	0
<OTHER-ITEMS-LIABILITIES>	0
<TOTAL-LIABILITIES>	24,244,798
<SENIOR-EQUITY>	0
<PAID-IN-CAPITAL-COMMON>	48,482,695
<SHARES-COMMON-STOCK>	0
<SHARES-COMMON-PRIOR>	0
<ACCUMULATED-NII-CURRENT>	0
<OVERDISTRIBUTION-NII>	0
<ACCUMULATED-NET-GAINS>	0
<OVERDISTRIBUTION-GAINS>	0
<ACCUM-APPREC-OR-DEPREC>	0
<NET-ASSETS>	48,482,695
<DIVIDEND-INCOME>	4,760
<INTEREST-INCOME>	40,797
<OTHER-INCOME>	0
<EXPENSES-NET>	9,358
<NET-INVESTMENT-INCOME>	36,199
<REALIZED-GAINS-CURRENT>	2,141
<APPREC-INCREASE-CURRENT>	8,583
<NET-CHANGE-FROM-OPS>	46,923
<EQUALIZATION>	0
<DISTRIBUTIONS-OF-INCOME>	0
<DISTRIBUTIONS-OF-GAINS>	0
<DISTRIBUTIONS-OTHER>	0
<NUMBER-OF-SHARES-SOLD>	48,435,772
<NUMBER-OF-SHARES-REDEEMED>	0

<SHARES-REINVESTED>	0
<NET-CHANGE-IN-ASSETS>	48,482,695
<ACCUMULATED-NII-PRIOR>	0
<ACCUMULATED-GAINS-PRIOR>	0
<OVERDISTRIB-NII-PRIOR>	0
<OVERDIST-NET-GAINS-PRIOR>	0
<GROSS-ADVISORY-FEES>	6,757
<INTEREST-EXPENSE>	0
<GROSS-EXPENSE>	21,857
<AVERAGE-NET-ASSETS>	31,706,188
<PER-SHARE-NAV-BEGIN>	0.00
<PER-SHARE-NII>	0.00
<PER-SHARE-GAIN-APPREC>	0.00
<PER-SHARE-DIVIDEND>	0.00
<PER-SHARE-DISTRIBUTIONS>	0.00
<RETURNS-OF-CAPITAL>	0.00
<PER-SHARE-NAV-END>	0.00
<EXPENSE-RATIO>	0.90
<AVG-DEBT-OUTSTANDING>	0
<AVG-DEBT-PER-SHARE>	0

</TABLE>