

2012年8月運用報告書(2012年8月1日～2012年8月31日)

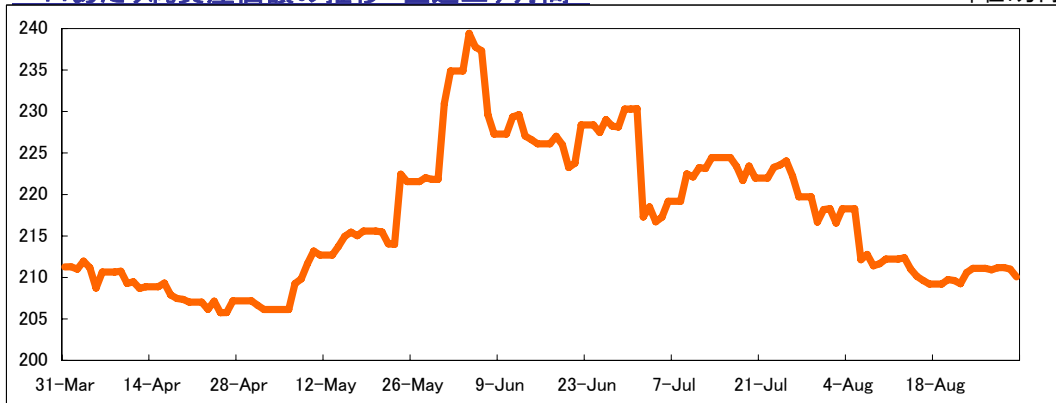
純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：8.10%】

	設定時 (1999/2/1)	2012年4月末	2012年5月末	2012年6月末	2012年7月末	2012年8月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	2,071,825	2,309,692	2,302,926	2,181,722	2,100,723
月次騰落率	—	-1.93%	11.48%	-0.29%	-5.26%	-3.71%
設定来騰落率	—	107.18%	130.97%	130.29%	118.17%	110.07%

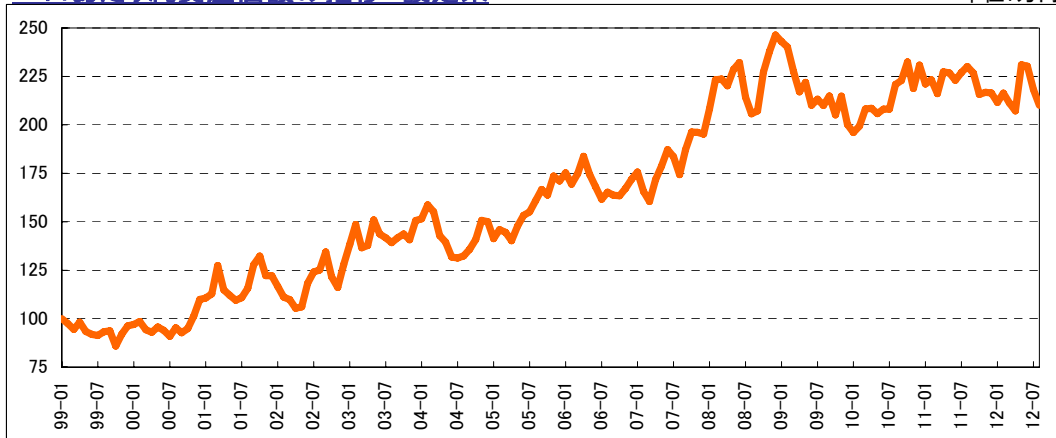
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

単位：万円



一口あたり純資産価額の推移 設定来

単位：万円



各セクターごとの損益

2012年8月の運用成績はマイナスとなり、アセットトライは前月比3.71%の損失となりました。

通貨・為替	金利	株価指数	エネルギー	金属	農産物	その他商品
--	--	-	+	-	-	-

(注) +は利益、-は損失、その数が損益の大きさを表しています。

マーケット概要

為替相場は当初の米ドルはユーロの買い戻しが進展するに伴いドル安傾向となりました。ただ、これまで堅調を維持していたオセアニア通貨が下落に転じ、欧州債務問題を背景にユーロ買いもまた限定的となるなど、トレンドのはっきりしないサマーマーケット特有の地合となりました。円相場は一時79円台半ばへの円安となりましたが、円売りが続かず再び79円割れの円高地合となりました。

主要国の短期金利は、日米欧ともに低金利政策を維持するなか、利下げ観測の強いユーロで低下傾向となりました。長期金利は、南欧の債務不安国の金利が高止まりする一方、主要国では低水準での推移が継続。月半ばにかけては株価の上昇などを背景に米英独でも一旦上昇傾向となりましたが、次第に欧州中銀、米国ともに追加緩和観測が強まると月末には低下しました。

主要国の株価指数は、当初は全般に堅調でしたが、月末にかけては反落しました。米国の経済指標好調や欧州中銀による債務問題国の国債買い入れなどの対応が見込まれ上昇。ただ、中国経済の成長鈍化が鮮明となるなか、月末にかけては中国・日本市場主導で反落となり、月間のパフォーマンスは概ね小幅高にとどまりました。

原油相場は、当初の80ドル台半ばから上昇しました。シリアなど中東地域の情勢不安が続くなか、北海油田での設備メンテナンスもあってプレント主導で98ドル台へ上昇。月末には主要7カ国による石油備蓄放出の示唆を受けて反落したものの、ハリケーン「アイザック」の上陸に備えてメキシコ湾岸の石油関連設備が停止したこともあり、95ドル水準を維持しました。

金相場は当初1,610ドルから一旦1,600ドル割れへ下落しましたが、反発。下旬には高値1,675ドルへ上昇するなど、一転して堅調推移となりました。大手消費国インドでは、農繁期入りと現地通貨建て金価格の上昇により実需が減少。しかし、中国の現物実需が下支えとなり、米国の金融緩和観測からユーロ高が進展したこともあって、上値追いつ傾向となりました。

《投資家の皆様へ》1999年3月以降に追加出資された方は、取得口数が参加時期により異なりますので、別添の募集月別のアセットトライ評価額一覧表にてご自身の損益をご確認ください。

【お問合せ先】岡藤商事株式会社 コールセンター

フリーコール：0120-33-7639(受付時間：土日祝日を除く平日8:30～17:00)

E-mail：center@okato.co.jp Web site：http://www.shouhin-fund.com/index.html#assettry

◆当資料は金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。◆騰落率の数値は、運用開始日の1口当たりの純資産価額(¥1,000,000)を基準に算出しています。(小数点以下第3位を四捨五入)。◆当ファンドの運用成績は過去の実績に基づいたものであり、将来の運用成績を保証するものではありません。◆当ファンドの純資産価額は運用対象である商品、有価証券、通貨、金利等の先物取引や現物取引などの値動きの影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。◆当資料は当ファンドの受益者へ情報を提供することのみを目的としたものであり、ここに記載される商品の売却や購入について勧誘するものではありません。◆当ファンドは円建の積極運用追加型商品ファンドです。

■アセットトライ / 評価額一覧表(評価日: 2012年8月31日時点)

評価日	2012/8/31
純資産価値	2,100,723

※取得口数通知書内、記載の『契約コード』の上6桁をご覧ください。
 ※評価額(時価)⑤ = 純資産価値① × 取得口数④
 ※平均年率⑧ = 運用開始来騰落率 ÷ (運用日数 ÷ 365)

※損益率の数値は、運用開始日の純資産価値(¥1,000,000)を基準に算出しています。(小数点以下第3位を四捨五入)。運用実績は過去の
 実績であり将来の収益を示すものではありません。また一定の利回りを金融商品取引業者および営業者が保証しているものではありません。

契約 コード	運用期間		運用開始時			評価日時点			
	運用開始日	期間(月)	投資単位	純資産価値	取得口数	評価額(時価)	評価損益	損益率	年率
			②	③	④	⑤=①×④	⑥=⑤-②	⑦=⑤÷②	⑧
1	AT9901	1999/2/1	163ヵ月	1,000,000	1,000,000	2,100,723	1,100,723	210.07%	8.10%
2	AT9902	1999/3/1	162ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	2,152,768	215.28%	8.53%
3	AT9903	1999/4/1	161ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	2,223,064	222.31%	9.11%
4	AT9904	1999/5/6	160ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	2,138,691	213.87%	8.53%
5	AT9905	1999/6/1	159ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	2,249,040	224.90%	9.42%
6	AT9906	1999/7/1	158ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	2,285,307	228.53%	9.75%
7	AT9907	1999/8/2	157ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,299,959	230.00%	9.93%
8	AT9908	1999/9/1	156ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	2,251,828	225.18%	9.62%
9	AT9909	1999/10/1	155ヵ月	1,000,000	937,090	1,067,133	2,241,750	224.18%	9.60%
10	AT9910	1999/11/1	154ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,446,220	244.62%	11.26%
11	AT9911	1999/12/1	153ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,800	2,281,553	228.16%	10.04%
12	AT9912	2000/1/4	152ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	2,181,640	218.16%	9.32%
13	AT2001	2000/2/1	151ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	2,165,124	216.51%	9.25%
14	AT2002	2000/3/1	150ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	2,131,252	213.13%	9.04%
15	AT2003	2000/4/3	149ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	2,226,877	222.69%	9.87%
16	AT2004	2000/5/1	148ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	2,258,287	225.83%	10.19%
17	AT2005	2000/6/1	147ヵ月	1,000,000	957,390	1,044,506	2,194,217	219.42%	9.74%
18	AT2006	2000/7/1	146ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,413	2,235,469	223.55%	10.15%
19	AT2007	2000/8/1	145ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,812	2,310,400	231.04%	10.84%
20	AT2008	2000/9/1	144ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	2,203,885	220.39%	10.03%
21	AT2009	2000/10/1	143ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	2,263,955	226.40%	10.60%
22	AT2010	2000/11/1	142ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	2,214,290	221.43%	10.25%
23	AT2011	2000/12/1	141ヵ月	1,000,000	1,012,677	1,087,481	2,074,424	207.44%	9.14%
24	AT2012	2001/1/4	140ヵ月	1,000,000	1,099,531	1,090,478	1,910,561	191.06%	7.80%
25	AT2101	2001/2/1	139ヵ月	1,000,000	1,106,736	1,090,357	1,898,122	189.81%	7.75%
26	AT2102	2001/3/1	138ヵ月	1,000,000	1,128,441	1,086,718	1,861,614	186.16%	7.48%
27	AT2103	2001/4/2	137ヵ月	1,000,000	1,274,671	1,078,451	1,648,050	164.80%	5.67%
28	AT2104	2001/5/1	136ヵ月	1,000,000	1,148,518	1,070,687	1,829,072	182.91%	7.31%
29	AT2105	2001/6/1	135ヵ月	1,000,000	1,120,460	1,082,490	1,874,874	187.49%	7.77%
30	AT2106	2001/7/2	134ヵ月	1,000,000	1,095,410	1,091,290	1,917,750	191.78%	8.21%
31	AT2107	2001/8/1	133ヵ月	1,000,000	1,108,831	1,091,850	1,894,537	189.45%	8.06%
32	AT2108	2001/9/3	132ヵ月	1,000,000	1,156,883	1,064,391	1,815,846	181.58%	7.41%
33	AT2109	2001/10/1	131ヵ月	1,000,000	1,278,225	1,078,234	1,643,467	164.35%	5.89%
34	AT2110	2001/11/1	130ヵ月	1,000,000	1,323,490	1,055,578	1,587,260	158.73%	5.42%
35	AT2111	2001/12/3	129ヵ月	1,000,000	1,222,209	1,081,890	1,718,790	171.88%	6.68%
36	AT2112	2002/1/2	128ヵ月	1,000,000	1,221,883	1,081,808	1,719,248	171.92%	6.74%
37	AT2201	2002/2/1	127ヵ月	1,000,000	1,166,737	1,085,091	1,800,510	180.05%	7.56%
38	AT2202	2002/3/1	126ヵ月	1,000,000	1,111,645	1,089,567	1,889,741	188.97%	8.46%
39	AT2203	2002/4/1	125ヵ月	1,000,000	1,098,307	1,091,492	1,912,691	191.27%	8.75%
40	AT2204	2002/5/1	124ヵ月	1,000,000	1,053,547	1,094,917	1,993,951	199.40%	9.61%
41	AT2205	2002/6/3	123ヵ月	1,000,000	1,061,310	1,092,231	1,979,366	197.94%	9.55%
42	AT2206	2002/7/1	122ヵ月	1,000,000	1,182,603	1,085,592	1,776,354	177.64%	7.63%
43	AT2207	2002/8/1	121ヵ月	1,000,000	1,241,166	1,080,594	1,692,539	169.25%	6.86%
44	AT2208	2002/9/2	120ヵ月	1,000,000	1,251,288	1,079,176	1,678,847	167.88%	6.78%
45	AT2209	2002/10/1	119ヵ月	1,000,000	1,344,590	1,074,321	1,562,351	156.24%	5.67%
46	AT2210	2002/11/1	118ヵ月	1,000,000	1,216,142	1,082,272	1,727,365	172.74%	7.39%
47	AT2211	2002/12/2	117ヵ月	1,000,000	1,161,070	1,086,127	1,809,298	180.93%	8.29%
48	AT2212	2003/1/2	116ヵ月	1,000,000	1,278,691	1,078,209	1,642,868	164.29%	6.65%
49	AT2301	2003/2/3	115ヵ月	1,000,000	1,382,741	1,072,301	1,519,244	151.92%	5.41%
50	AT2302	2003/3/3	114ヵ月	1,000,000	1,485,812	1,073,032	1,413,853	141.39%	4.35%
51	AT2303	2003/4/1	113ヵ月	1,000,000	1,366,283	1,073,191	1,537,544	153.75%	5.70%
52	AT2304	2003/5/1	112ヵ月	1,000,000	1,377,293	1,072,601	1,525,253	152.53%	5.62%
53	AT2305	2003/6/2	111ヵ月	1,000,000	1,510,066	1,062,222	1,391,144	139.11%	4.22%
54	AT2306	2003/7/1	110ヵ月	1,000,000	1,436,823	1,065,979	1,462,059	146.21%	5.03%
55	AT2307	2003/8/1	109ヵ月	1,000,000	1,417,256	1,070,588	1,482,244	148.22%	5.30%
56	AT2308	2003/9/1	108ヵ月	1,000,000	1,392,804	1,071,797	1,508,268	150.83%	5.64%
57	AT2309	2003/10/1	107ヵ月	1,000,000	1,416,896	1,070,578	1,482,623	148.26%	5.41%
58	AT2310	2003/11/4	106ヵ月	1,000,000	1,436,951	1,069,517	1,461,928	146.19%	5.22%
59	AT2311	2003/12/1	105ヵ月	1,000,000	1,407,221	1,070,620	1,492,815	149.28%	5.63%
60	AT2312	2004/1/5	104ヵ月	1,000,000	1,506,668	1,066,371	1,394,283	139.43%	4.55%
61	AT2401	2004/2/2	103ヵ月	1,000,000	1,515,744	1,065,974	1,385,935	138.59%	4.49%
62	AT2402	2004/3/1	102ヵ月	1,000,000	1,587,195	1,060,042	1,323,543	132.35%	3.80%
63	AT2403	2004/4/1	101ヵ月	1,000,000	1,551,768	1,064,426	1,353,760	135.38%	4.20%
64	AT2404	2004/5/3	100ヵ月	1,000,000	1,429,064	1,069,758	1,469,997	147.00%	5.63%
65	AT2405	2004/6/1	99ヵ月	1,000,000	1,395,055	1,071,687	1,505,833	150.58%	6.13%
66	AT2406	2004/7/1	98ヵ月	1,000,000	1,318,409	1,075,849	1,593,375	159.34%	7.26%
67	AT2407	2004/8/2	97ヵ月	1,000,000	1,313,299	1,076,141	1,599,576	159.96%	7.41%
68	AT2408	2004/9/1	96ヵ月	1,000,000	1,323,594	1,075,518	1,587,134	158.71%	7.33%
69	AT2409	2004/10/1	95ヵ月	1,000,000	1,357,884	1,073,643	1,547,054	154.71%	6.90%
70	AT2410	2004/11/1	94ヵ月	1,000,000	1,408,223	1,071,025	1,491,964	149.20%	6.28%
71	AT2411	2004/12/1	93ヵ月	1,000,000	1,507,175	1,066,349	1,393,812	139.38%	5.08%
72	AT2412	2005/1/3	92ヵ月	1,000,000	1,500,722	1,066,345	1,399,806	139.98%	5.21%
73	AT2501	2005/2/1	91ヵ月	1,000,000	1,412,989	1,070,719	1,486,721	148.67%	6.42%
74	AT2502	2005/3/1	90ヵ月	1,000,000	1,459,169	1,068,321	1,439,669	143.97%	5.85%
75	AT2503	2005/4/1	89ヵ月	1,000,000	1,445,096	1,069,995	1,453,689	145.37%	6.11%
76	AT2504	2005/5/2	88ヵ月	1,000,000	1,402,509	1,071,300	1,497,830	149.78%	6.78%
77	AT2505	2005/6/1	87ヵ月	1,000,000	1,478,317	1,076,444	1,421,021	142.10%	5.80%
78	AT2506	2005/7/1	86ヵ月	1,000,000	1,532,845	1,065,381	1,370,471	137.05%	5.16%
79	AT2507	2005/8/1	85ヵ月	1,000,000	1,551,175	1,064,672	1,354,277	135.43%	5.00%
80	AT2508	2005/9/1	84ヵ月	1,000,000	1,607,807	1,062,195	1,306,576	130.66%	4.38%
81	AT2509	2005/10/3	83ヵ月	1,000,000	1,666,428	1,060,085	1,260,612	126.06%	3.76%
82	AT2510	2005/11/1	82ヵ月	1,000,000	1,637,800	1,061,057	1,282,648	128.26%	4.13%
83	AT2511	2005/12/1	81ヵ月	1,000,000	1,735,801	1,057,102	1,210,230	121.02%	3.11%
84	AT2512	2006/1/2	80ヵ月	1,000,000	1,710,516	1,058,618	1,228,120	122.81%	3.42%
85	AT2601	2006/2/1	79ヵ月	1,000,000	1,752,235	1,057,099	1,198,880	119.89%	3.02%
86	AT2602	2006/3/1	78ヵ月	1,000,000	1,693,853	1,059,370	1,240,203	124.02%	3.69%
87	AT2603	2006/4/1	77ヵ月	1,000,000	1,677,442	1,057,265	1,202,170	120.22%	3.15%
88	AT2604	2006/5/1	76ヵ月	1,000,000	1,837,261	1,054,288	1,143,398	114.34%	2.26%
89	AT2605	2006/6/1	75ヵ月	1,000,000	1,744,468	1,057,320	1,204,218	120.42%	3.26%
90	AT2606	2006/7/1	74ヵ月	1,000,000	1,680,813	1,059,950	1,249,825	124.98%	4.05%
91	AT2607	2006/8/1	73ヵ月	1,000,000	1,616,044	1,061,795	1,299,916	129.99%	4.92%
92	AT2608	2006/9/1	72ヵ月	1,000,000	1,652,891	1,060,500	1,270,937	127.09%	4.51%
93	AT2609	2006/10/1	71ヵ月	1,000,000	1,637,067	1,061,048	1,283,222	128.32%	4.78%
94	AT2610	2006/11/1	70ヵ月	1,000,000	1,634,198	1,061,192	1,285,474	128.55%	4.89%
95	AT2611	2006/12/1	69ヵ月	1,000,000	1,671,404	1,059,829	1,256,860	125.69%	4.46%
96	AT2612	2007/1/1	68ヵ月	1,000,000	1,719,181	1,058,672	1,221,931	122.19%	3.91%
97	AT2701	2007/2/1	67ヵ月	1,000,000	1,756,711	1,059,245	1,195,826	119.58%	3.51%
101	AT-201203	2012/							

「アセットトライ」に係る手数料等について

参加手数料：申込金額の2.10%（消費税含む。）

解約手数料：解約金額の1.0%（解約時にお客様が受け取る実際の受領金額は、営業者指定銀行における海外送金手数料及びお客様受取銀行における事務手数料が解約償還金額から控除された金額となります。）

管理料：純資産価額の年率1.5%

先物投資顧問料：運用委託額の年率2.0%

成功報酬：運用収益の20%

先物取引手数料：（海外先物取引/海外先渡取引）原則として1枚（往復）当たり上限15米ドル
（外国為替取引）原則として百万米ドル（又は外貨の相当額）に対して上限15米ドル

業務代行報酬：純資産価額の年率0.15%

その他費用（実費）：初期費用、送金銀行に対する手数料、先物運用会社の会計監査費用、営業者及び先物運用会社の期中管理に係る費用、営業者の登録に係る費用、期中に於ける弁護士・税理士費用（ケイマン諸島に於ける弁護士費用を含む。）、関係会社及び先物運用会社のシリーズA株式に係る計算・会計事務に関わる費用、営業者株式の信託会社に対する受託費用・本商品ファンド継続販売のための書面に係る企画・改訂・印刷費用等

管理料、先物投資顧問料、成功報酬、先物取引手数料、業務代行報酬及びその他費用については、事前に計算できないため、当ファンドに係る手数料等の総額または上限額を表示することはできません。

「アセットトライ」に係るリスクと留意点

当ファンドは、先物市場等の値動きにより、大きな収益を得る可能性がある反面、投資元本を割り込む損害を受ける可能性もあるハイリスク・ハイリターンの商品です。投資する商品は多岐にわたり、各々の商品に対して買いのポジションも売りのポジションも持つため、先物市場又は外国為替市場等の特定の指標の値動きが先物運用顧問会社の判断と異なる場合は損失が発生することがあります。当ファンドは元本や収益が保証されているものではありません。資産の一部が外貨建てで運用されるため、為替の変動により収益・損失が増減することがあります。預金保険の適用はありません。当ファンドでは、1口当たりの純資産価額が700,000円を下回った場合には繰上げ償還することがあります。クーリング・オフの適用はありません。投資家が取得する商品ファンド関連受益権は、相続、遺贈、破産その他これらに準ずる場合または金融商品取引業者が転売する場合を除き、第三者には直接譲渡できません。契約締結前交付書面を十分にお読みいただき、当ファンドの特徴とリスクの内容をご理解下さい。

金融商品取引業者の概要

商号：岡藤商事株式会社

登録番号：関東財務局長（金商）第2608号

本店所在地：大阪府大阪市中央区本町3-2-11

加入している金融商品取引業協会：一般社団法人第二種金融商品取引業協会