

アセットトライ

AT ADMINISTRATION (CAYMAN) LIMITED
作成日：2012年10月31日

2012年9月運用報告書(2012年9月1日～2012年9月30日)

純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：7.68%】

	設定時 (1999/2/1)	2012年5月末	2012年6月末	2012年7月末	2012年8月末	2012年9月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	2,309,692	2,302,926	2,181,722	2,100,723	2,049,507
月次騰落率	—	11.48%	-0.29%	-5.26%	-3.71%	-2.44%
設定来騰落率	—	130.97%	130.29%	118.17%	110.07%	104.95%

各セクターごとの損益

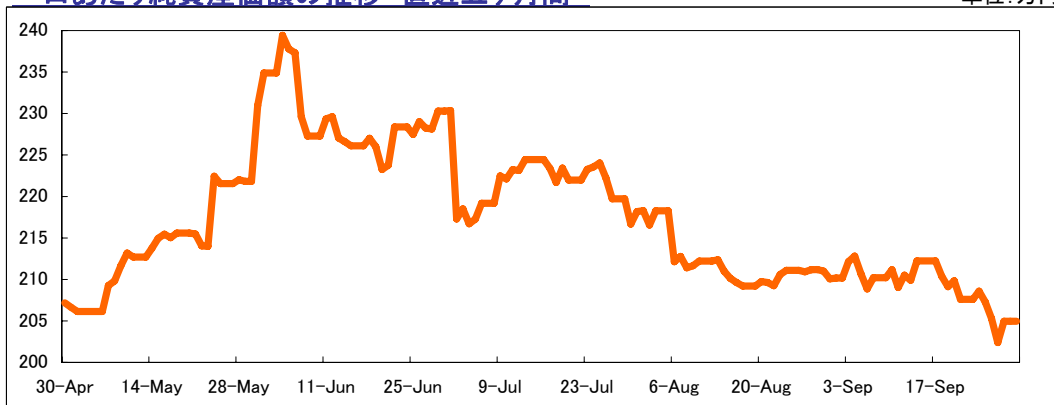
2012年9月の運用成績はマイナスとなり、アセットトライは前月比2.44%の損失となりました。

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。

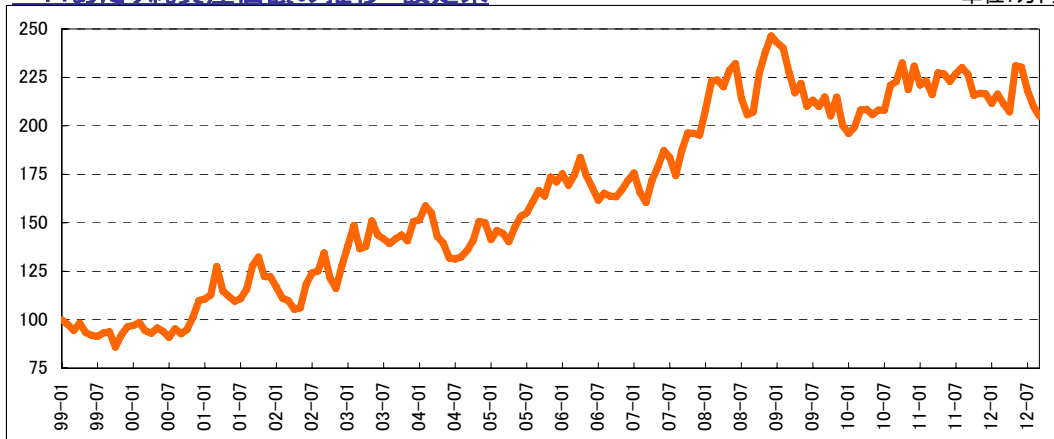
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

単位：万円



一口あたり純資産価額の推移 設定来

単位：万円



マーケット概要

為替相場は、前月から続くユーロ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つつ、次第にユーロ買いの動きも限定的となり、下旬にかけてはドル高傾向が強まりました。また、円相場は一時79円台前半への円安場面も見られましたが、円売りが続かず再び78円割れの円高地合となりました。

主要国の短期金利は、各国が金融緩和策をとり低水準での横ばい傾向が続くなか、特に米金融当局の追加緩和発表を受けてドル金利が低下しました。長期金利は、欧州中銀による問題債務国の国債買入れ方針発表と米国株を中心とした株高を背景に主要国では月前半に上昇しましたが、日米欧の金融緩和方針と、南欧の財政問題再燃が懸念され月後半は低下しました。

主要国の株価指数は、ユーロ圏の債務問題対応進展と米国の追加金融緩和策発表を背景として月前半はほぼ全面高となりました。しかし、領土問題を発端とした日中関係の悪化で両国経済への影響が懸念されアジア市場主導で上値が重くなり、欧州でもドイツの景気後退懸念や南欧の財政緊縮への反対なども不安材料となったことから、月後半には全般に反落しました。

原油相場は、当初の95ドル水準から中東地域の情勢不安や、米国の追加緩和期待で上昇し、13日の米金融当局による量的金融緩和第3弾(QE3)決定後には一時100ドル台となりました。しかし、原油高の経済への悪影響が懸念され米国の戦略備蓄放出の可能性示唆で急落、中国経済の成長減速で需要伸び悩みも見込まれ、月末にかけては90ドル台前半で推移しました。

金相場は当初の1,660ドルからほぼ一貫して上昇傾向を辿りました。中旬には高値1,785ドル超えへと上昇。米国金融政策で不動産担保債権の購入による追加緩和策の導入が決定されたことを受けて先行きの景気拡大見通しが強まり、続いて日銀が追加緩和を実施したこともあって、急速に下値を切り上げました。ただ、金価格の上昇から実需も減少し、上昇速度も次第に鈍化しました。

《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9月30日時点)

評価日	2012/9/30
純資産価値	2,049,507 ...①

※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	164ヵ月	1,000,000	1,000,000	2,049,507	1,049,507	204.95%	7.68%
2	AT9902	1999/3/1	163ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	2,100,283	210.03%	8.09%
3	AT9903	1999/4/1	162ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	2,168,866	216.89%	8.65%
4	AT9904	1999/5/6	161ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	2,086,549	208.65%	8.09%
5	AT9905	1999/6/1	160ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	2,194,208	219.42%	8.95%
6	AT9906	1999/7/1	159ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,667	2,229,591	222.95%	9.27%
7	AT9907	1999/8/2	158ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,243,886	224.39%	9.44%
8	AT9908	1999/9/1	157ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	2,196,928	219.69%	9.14%
9	AT9909	1999/10/1	156ヵ月	1,000,000	937,090	1,067,133	2,187,096	218.71%	9.12%
10	AT9910	1999/11/1	155ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,386,581	238.66%	10.73%
11	AT9911	1999/12/1	154ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,800	2,225,928	222.59%	9.54%
12	AT9912	2000/1/4	153ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	2,128,451	212.85%	8.84%
13	AT2001	2000/2/1	152ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	2,112,338	211.23%	8.78%
14	AT2002	2000/3/1	151ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	2,079,292	207.93%	8.57%
15	AT2003	2000/4/3	150ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	2,172,586	217.26%	9.37%
16	AT2004	2000/5/1	149ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	2,203,230	220.32%	9.68%
17	AT2005	2000/6/1	148ヵ月	1,000,000	957,390	1,044,506	2,140,722	214.07%	9.24%
18	AT2006	2000/7/1	147ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,413	2,180,968	218.10%	9.63%
19	AT2007	2000/8/1	146ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,982	2,254,072	225.41%	10.30%
20	AT2008	2000/9/1	145ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	2,150,154	215.02%	9.51%
21	AT2009	2000/10/1	144ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	2,208,759	220.88%	10.07%
22	AT2010	2000/11/1	143ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	2,160,305	216.03%	9.73%
23	AT2011	2000/12/1	142ヵ月	1,000,000	1,012,677	997,481	2,023,849	202.38%	8.65%
24	AT2012	2001/1/4	141ヵ月	1,000,000	1,099,531	909,478	1,863,981	186.40%	7.35%
25	AT2101	2001/2/1	140ヵ月	1,000,000	1,106,736	903,557	1,851,846	185.18%	7.30%
26	AT2102	2001/3/1	139ヵ月	1,000,000	1,128,441	886,878	1,816,228	181.62%	7.04%
27	AT2103	2001/4/2	138ヵ月	1,000,000	1,274,671	784,516	1,607,871	160.78%	5.28%
28	AT2104	2001/5/1	137ヵ月	1,000,000	1,148,518	870,687	1,784,479	178.45%	6.86%
29	AT2105	2001/6/1	136ヵ月	1,000,000	1,120,460	892,490	1,829,164	182.92%	7.31%
30	AT2106	2001/7/2	135ヵ月	1,000,000	1,095,410	912,900	1,870,994	187.10%	7.74%
31	AT2107	2001/8/1	134ヵ月	1,000,000	1,108,831	901,850	1,848,347	184.83%	7.59%
32	AT2108	2001/9/3	133ヵ月	1,000,000	1,156,883	864,391	1,771,575	177.16%	6.96%
33	AT2109	2001/10/1	132ヵ月	1,000,000	1,278,225	782,334	1,603,399	160.34%	5.48%
34	AT2110	2001/11/1	131ヵ月	1,000,000	1,323,490	755,578	1,548,562	154.86%	5.02%
35	AT2111	2001/12/3	130ヵ月	1,000,000	1,222,209	818,190	1,676,886	167.69%	6.24%
36	AT2112	2002/1/2	129ヵ月	1,000,000	1,221,883	818,408	1,677,332	167.73%	6.30%
37	AT2201	2002/2/1	128ヵ月	1,000,000	1,166,737	857,091	1,756,614	175.66%	7.09%
38	AT2202	2002/3/1	127ヵ月	1,000,000	1,111,645	899,567	1,843,668	184.37%	7.96%
39	AT2203	2002/4/1	126ヵ月	1,000,000	1,098,307	910,492	1,866,059	186.61%	8.24%
40	AT2204	2002/5/1	125ヵ月	1,000,000	1,053,547	949,174	1,945,338	194.53%	9.07%
41	AT2205	2002/6/3	124ヵ月	1,000,000	1,061,310	942,231	1,931,109	193.11%	9.00%
42	AT2206	2002/7/1	123ヵ月	1,000,000	1,182,603	845,592	1,733,046	173.30%	7.14%
43	AT2207	2002/8/1	122ヵ月	1,000,000	1,241,166	805,694	1,651,275	165.13%	6.40%
44	AT2208	2002/9/2	121ヵ月	1,000,000	1,251,288	799,176	1,637,916	163.79%	6.32%
45	AT2209	2002/10/1	120ヵ月	1,000,000	1,344,590	743,721	1,524,261	152.43%	5.24%
46	AT2210	2002/11/1	119ヵ月	1,000,000	1,216,142	822,272	1,685,252	168.53%	6.91%
47	AT2211	2002/12/2	118ヵ月	1,000,000	1,161,070	861,274	1,765,187	176.52%	7.78%
48	AT2212	2003/1/2	117ヵ月	1,000,000	1,278,691	782,049	1,602,814	160.28%	6.18%
49	AT2301	2003/2/3	116ヵ月	1,000,000	1,382,741	723,201	1,482,205	148.22%	4.99%
50	AT2302	2003/3/3	115ヵ月	1,000,000	1,485,812	673,032	1,379,383	137.94%	3.95%
51	AT2303	2003/4/1	114ヵ月	1,000,000	1,366,283	731,912	1,500,058	150.01%	5.26%
52	AT2304	2003/5/1	113ヵ月	1,000,000	1,377,293	726,601	1,488,067	148.81%	5.18%
53	AT2305	2003/6/2	112ヵ月	1,000,000	1,510,066	662,222	1,357,228	135.72%	3.82%
54	AT2306	2003/7/1	111ヵ月	1,000,000	1,436,823	695,979	1,426,413	142.64%	4.60%
55	AT2307	2003/8/1	110ヵ月	1,000,000	1,417,256	705,588	1,446,107	144.61%	4.86%
56	AT2308	2003/9/1	109ヵ月	1,000,000	1,392,804	717,976	1,471,496	147.15%	5.19%
57	AT2309	2003/10/1	108ヵ月	1,000,000	1,416,896	705,768	1,446,476	144.65%	4.96%
58	AT2310	2003/11/4	107ヵ月	1,000,000	1,436,951	695,917	1,426,286	142.63%	4.78%
59	AT2311	2003/12/1	106ヵ月	1,000,000	1,407,221	710,620	1,456,420	145.64%	5.16%
60	AT2312	2004/1/5	105ヵ月	1,000,000	1,506,668	663,716	1,360,290	136.03%	4.11%

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	
61	AT2401	2004/2/2	104ヵ月	1,000,000	1,515,744	0.659742	1,352,145	352.145	135.21%	4.06%
62	AT2402	2004/3/1	103ヵ月	1,000,000	1,587,195	0.630042	1,291,275	291.275	129.13%	3.39%
63	AT2403	2004/4/1	102ヵ月	1,000,000	1,551,768	0.644426	1,320,755	320.755	132.08%	3.77%
64	AT2404	2004/5/3	101ヵ月	1,000,000	1,429,064	0.699758	1,434,158	434.158	143.42%	5.15%
65	AT2405	2004/6/1	100ヵ月	1,000,000	1,395,055	0.716817	1,469,121	469.121	146.91%	5.63%
66	AT2406	2004/7/1	99ヵ月	1,000,000	1,318,409	0.758489	1,554,528	554.528	155.45%	6.72%
67	AT2407	2004/8/2	98ヵ月	1,000,000	1,313,299	0.761441	1,560,578	560.578	156.06%	6.86%
68	AT2408	2004/9/1	97ヵ月	1,000,000	1,323,594	0.755518	1,548,439	548.439	154.84%	6.78%
69	AT2409	2004/10/1	96ヵ月	1,000,000	1,357,884	0.736439	1,509,336	509.336	150.93%	6.36%
70	AT2410	2004/11/1	95ヵ月	1,000,000	1,408,223	0.710215	1,455,590	455.590	145.56%	5.75%
71	AT2411	2004/12/1	94ヵ月	1,000,000	1,507,175	0.663492	1,359,831	359.831	135.98%	4.59%
72	AT2412	2005/1/3	93ヵ月	1,000,000	1,500,722	0.666345	1,365,678	365.678	136.57%	4.72%
73	AT2501	2005/2/1	92ヵ月	1,000,000	1,412,989	0.707719	1,450,475	450.475	145.05%	5.87%
74	AT2502	2005/3/1	91ヵ月	1,000,000	1,459,169	0.685321	1,404,570	404.570	140.46%	5.33%
75	AT2503	2005/4/1	90ヵ月	1,000,000	1,445,096	0.691995	1,418,248	418.248	141.82%	5.57%
76	AT2504	2005/5/2	89ヵ月	1,000,000	1,402,509	0.713007	1,461,312	461.312	146.13%	6.21%
77	AT2505	2005/6/1	88ヵ月	1,000,000	1,478,317	0.676444	1,386,376	386.376	138.64%	5.26%
78	AT2506	2005/7/1	87ヵ月	1,000,000	1,532,845	0.652381	1,337,059	337.059	133.71%	4.64%
79	AT2507	2005/8/1	86ヵ月	1,000,000	1,551,175	0.644672	1,321,259	321.259	132.13%	4.48%
80	AT2508	2005/9/1	85ヵ月	1,000,000	1,607,807	0.621965	1,274,721	274.721	127.47%	3.88%
81	AT2509	2005/10/3	84ヵ月	1,000,000	1,666,428	0.600085	1,229,878	229.878	122.99%	3.28%
82	AT2510	2005/11/1	83ヵ月	1,000,000	1,637,800	0.610575	1,251,377	251.377	125.14%	3.63%
83	AT2511	2005/12/1	82ヵ月	1,000,000	1,735,801	0.576102	1,180,725	180.725	118.07%	2.64%
84	AT2512	2006/1/2	81ヵ月	1,000,000	1,710,516	0.584618	1,198,178	198.178	119.82%	2.93%
85	AT2601	2006/2/1	80ヵ月	1,000,000	1,752,235	0.570699	1,169,651	169.651	116.97%	2.54%
86	AT2602	2006/3/1	79ヵ月	1,000,000	1,693,853	0.590370	1,209,967	209.967	121.00%	3.19%
87	AT2603	2006/4/1	78ヵ月	1,000,000	1,747,442	0.572265	1,172,861	172.861	117.29%	2.66%
88	AT2604	2006/5/1	77ヵ月	1,000,000	1,837,261	0.544288	1,115,522	115.522	111.55%	1.80%
89	AT2605	2006/6/1	76ヵ月	1,000,000	1,744,468	0.573240	1,174,859	174.859	117.49%	2.76%
90	AT2606	2006/7/1	75ヵ月	1,000,000	1,680,813	0.594950	1,219,354	219.354	121.94%	3.51%
91	AT2607	2006/8/1	74ヵ月	1,000,000	1,616,044	0.618795	1,268,224	268.224	126.82%	4.35%
92	AT2608	2006/9/1	73ヵ月	1,000,000	1,652,891	0.605000	1,239,951	239.951	124.00%	3.94%
93	AT2609	2006/10/1	72ヵ月	1,000,000	1,637,067	0.6108				

「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