

2012年12月運用報告書(2012年12月1日～2012年12月31日)

純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：6.90%】

	設定時 (1999/2/1)	2012年8月末	2012年9月末	2012年10月末	2012年11月末	2012年12月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	2,100,723	2,049,507	1,965,212	1,929,301	1,960,211
月次騰落率	—	-3.71%	-2.44%	-4.11%	-1.83%	1.60%
設定来騰落率	—	110.07%	104.95%	96.52%	92.93%	96.02%

各セクターごとの損益

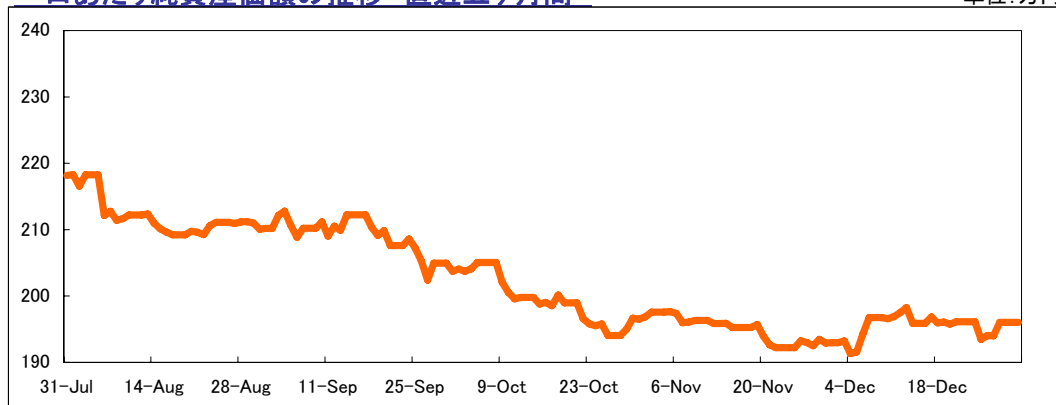
2012年12月の運用成績はプラスとなり、アセットトライは前月比1.60%の利益となりました。

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。

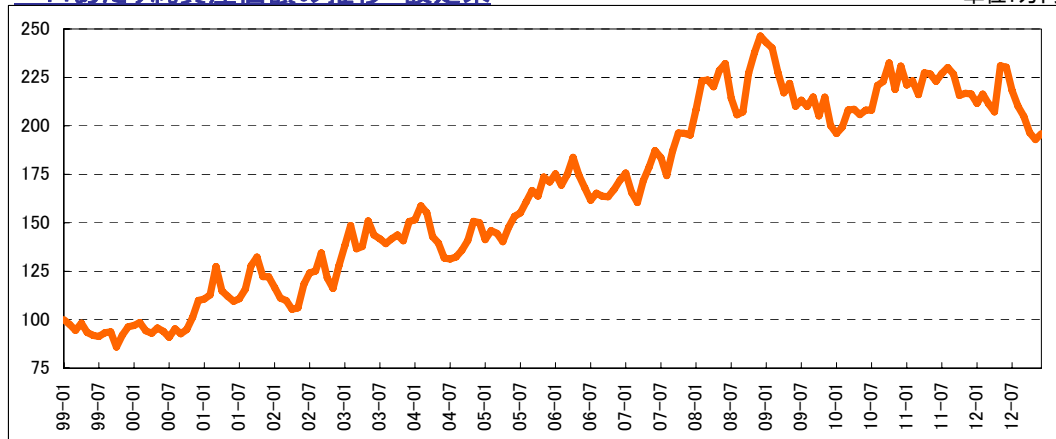
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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、米ドルが対ユーロでは当初の1.2983ドルから1.3200ドル水準へ、ドル安傾向となりました。また、円相場は当初の82.35円から11月と同様に円全面安の傾向となり、一時は87円に接近する場面も見られました。自民党への政権交替から、日銀による追加的な金融緩和と見通しが強まったことや、エネルギー輸入増加と輸出減少による貿易収支の赤字化が円安の背景となりました。

主要国の短期金利は、日米欧ともに金融緩和策を維持するなか、低水準での横ばい推移、スイスでは一部でマイナス金利となりました。長期金利は、米金融当局が国債の買い入れ継続を発表し、日銀も資産買い入れ枠拡大を発表するなかでも、債券市場から株式市場への資金流出が強まり、金利は上昇傾向を維持。日本10年債では、9月以来の水準まで上昇しました。

主要国の株価指数は、米国は「財政の崖」問題、欧州は成長減速懸念でほぼ横ばい推移となる一方、日本株主導でアジア株が上昇しました。国内では16日の衆院総選挙で政権交代が実現、安倍自民党総裁が日銀に大幅な金融緩和を求めたほか、貿易収支赤字が続いていることから円安が進展。輸出関連銘柄主導で株価が大幅高となり、中国株も追随高となりました。

原油相場は、ブレント原油が当初のイスラエルなど中東情勢の不安を背景とした110ドル水準から、ユーロ圏の景気下振れリスクが指摘されると106ドル台へ下落しました。米国では「財政の崖」回避への与野党協議が難航し不透明感が残しながらも、日本株を中心としたアジア地域の株式市場の上昇が石油需要の増加期待につながり、月末には111ドルへ上昇しました。

金相場は、当初の1,713.50ドルから、高値1,723ドルを経て1,635ドルまで下落するなど地合の悪化が目立ち、11月に続いて短期買いポジションの利益確定のための売りが先行しました。米国での個人消費の強さを確認し景気拡大見通しが強まった反面、2013年年初に期限を迎える「財政の崖」に対する対応が不透明感を残し、積極的な買いが手控えられました。

《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12月31日時点)

評価日	2012/12/31
純資産価値	1,960,211

※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	167ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,960,211	960,211	196.02%	6.90%
2	AT9902	1999/3/1	166ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	2,008,775	1,008,775	200.88%	7.28%
3	AT9903	1999/4/1	165ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	2,074,369	1,074,369	207.44%	7.81%
4	AT9904	1999/5/6	164ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	1,995,639	995,639	199.56%	7.28%
5	AT9905	1999/6/1	163ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	2,098,607	1,098,607	209.86%	8.08%
6	AT9906	1999/7/1	162ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	2,132,448	1,132,448	213.24%	8.38%
7	AT9907	1999/8/2	161ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,146,121	1,146,121	214.61%	8.53%
8	AT9908	1999/9/1	160ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	2,101,208	1,101,208	210.12%	8.25%
9	AT9909	1999/10/1	159ヵ月	1,000,000	937,090	1,067,133	2,091,805	1,091,805	209.18%	8.23%
10	AT9910	1999/11/1	158ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,282,599	1,282,599	228.26%	9.73%
11	AT9911	1999/12/1	157ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,800	2,128,945	1,128,945	212.89%	8.62%
12	AT9912	2000/1/4	156ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	2,035,716	1,035,716	203.57%	7.96%
13	AT2001	2000/2/1	155ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	2,020,305	1,020,305	202.03%	7.89%
14	AT2002	2000/3/1	154ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	1,988,698	988,698	198.87%	7.70%
15	AT2003	2000/4/3	153ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	2,077,927	1,077,927	207.79%	8.45%
16	AT2004	2000/5/1	152ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	2,107,236	1,107,236	210.72%	8.73%
17	AT2005	2000/6/1	151ヵ月	1,000,000	957,390	1,044,506	2,047,452	1,047,452	204.75%	8.32%
18	AT2006	2000/7/1	150ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,143	2,085,944	1,085,944	208.59%	8.68%
19	AT2007	2000/8/1	149ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,982	2,155,863	1,155,863	215.59%	9.30%
20	AT2008	2000/9/1	148ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	2,056,473	1,056,473	205.65%	8.56%
21	AT2009	2000/10/1	147ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	2,112,525	1,112,525	211.25%	9.07%
22	AT2010	2000/11/1	146ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,601	2,066,181	1,066,181	206.62%	8.76%
23	AT2011	2000/12/1	145ヵ月	1,000,000	1,012,677	0,987,481	1,935,671	935,671	193.57%	7.74%
24	AT2012	2001/1/4	144ヵ月	1,000,000	1,099,531	0,909,478	1,782,768	782,768	178.28%	6.52%
25	AT2101	2001/2/1	143ヵ月	1,000,000	1,106,736	0,903,557	1,771,162	771,162	177.12%	6.47%
26	AT2102	2001/3/1	142ヵ月	1,000,000	1,128,441	0,886,718	1,737,095	737,095	173.71%	6.22%
27	AT2103	2001/4/2	141ヵ月	1,000,000	1,274,671	0,784,516	1,537,816	537,816	153.78%	4.57%
28	AT2104	2001/5/1	140ヵ月	1,000,000	1,148,518	0,870,687	1,706,730	706,730	170.67%	6.05%
29	AT2105	2001/6/1	139ヵ月	1,000,000	1,120,460	0,892,490	1,749,468	749,468	174.95%	6.46%
30	AT2106	2001/7/2	138ヵ月	1,000,000	1,095,410	0,912,900	1,789,476	789,476	178.95%	6.86%
31	AT2107	2001/8/1	137ヵ月	1,000,000	1,108,831	0,901,850	1,767,816	767,816	176.78%	6.72%
32	AT2108	2001/9/3	136ヵ月	1,000,000	1,156,883	0,864,391	1,694,388	694,388	169.44%	6.12%
33	AT2109	2001/10/1	135ヵ月	1,000,000	1,278,225	0,782,334	1,533,539	533,539	153.35%	4.74%
34	AT2110	2001/11/1	134ヵ月	1,000,000	1,323,490	0,755,578	1,481,092	481,092	148.11%	4.30%
35	AT2111	2001/12/3	133ヵ月	1,000,000	1,222,209	0,818,190	1,603,825	603,825	160.38%	5.44%
36	AT2112	2002/1/2	132ヵ月	1,000,000	1,221,883	0,818,408	1,604,252	604,252	160.43%	5.49%
37	AT2201	2002/2/1	131ヵ月	1,000,000	1,166,737	0,857,091	1,680,079	680,079	168.01%	6.23%
38	AT2202	2002/3/1	130ヵ月	1,000,000	1,111,645	0,899,567	1,763,341	763,341	176.33%	7.04%
39	AT2203	2002/4/1	129ヵ月	1,000,000	1,098,307	0,910,492	1,784,756	784,756	178.48%	7.29%
40	AT2204	2002/5/1	128ヵ月	1,000,000	1,053,547	0,949,174	1,860,581	860,581	186.06%	8.06%
41	AT2205	2002/6/3	127ヵ月	1,000,000	1,061,310	0,942,231	1,846,971	846,971	184.70%	7.99%
42	AT2206	2002/7/1	126ヵ月	1,000,000	1,182,603	0,845,592	1,657,538	657,538	165.75%	6.25%
43	AT2207	2002/8/1	125ヵ月	1,000,000	1,241,166	0,805,694	1,579,330	579,330	157.93%	5.56%
44	AT2208	2002/9/2	124ヵ月	1,000,000	1,251,288	0,799,176	1,566,553	566,553	156.66%	5.48%
45	AT2209	2002/10/1	123ヵ月	1,000,000	1,344,590	0,743,721	1,457,850	457,850	145.79%	4.46%
46	AT2210	2002/11/1	122ヵ月	1,000,000	1,216,142	0,822,272	1,611,826	611,826	161.18%	6.01%
47	AT2211	2002/12/2	121ヵ月	1,000,000	1,161,070	0,861,274	1,688,278	688,278	168.83%	6.82%
48	AT2212	2003/1/2	120ヵ月	1,000,000	1,278,691	0,782,049	1,532,981	532,981	153.30%	5.33%
49	AT2301	2003/2/3	119ヵ月	1,000,000	1,382,741	0,723,201	1,417,626	417,626	141.76%	4.21%
50	AT2302	2003/3/3	118ヵ月	1,000,000	1,485,812	0,673,032	1,319,284	319,284	131.93%	3.24%
51	AT2303	2003/4/1	117ヵ月	1,000,000	1,366,283	0,731,912	1,434,701	434,701	143.47%	4.45%
52	AT2304	2003/5/1	116ヵ月	1,000,000	1,377,293	0,726,601	1,423,232	423,232	142.32%	4.37%
53	AT2305	2003/6/2	115ヵ月	1,000,000	1,510,066	0,662,222	1,298,094	298,094	129.81%	3.11%
54	AT2306	2003/7/1	114ヵ月	1,000,000	1,436,823	0,695,979	1,364,265	364,265	136.43%	3.83%
55	AT2307	2003/8/1	113ヵ月	1,000,000	1,417,256	0,705,588	1,383,101	383,101	138.31%	4.06%
56	AT2308	2003/9/1	112ヵ月	1,000,000	1,392,804	0,717,976	1,407,384	407,384	140.74%	4.36%
57	AT2309	2003/10/1	111ヵ月	1,000,000	1,416,896	0,705,768	1,383,454	383,454	138.35%	4.14%
58	AT2310	2003/11/4	110ヵ月	1,000,000	1,436,951	0,695,917	1,364,144	364,144	136.41%	3.97%
59	AT2311	2003/12/1	109ヵ月	1,000,000	1,407,221	0,710,620	1,392,965	392,965	139.30%	4.32%
60	AT2312	2004/1/5	108ヵ月	1,000,000	1,506,668	0,663,716	1,301,023	301,023	130.10%	3.34%

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	107ヵ月	1,000,000	1,515,744	0,659,742	1,293,233	293,233	129.32%	3.29%
62	AT2402	2004/3/1	106ヵ月	1,000,000	1,587,195	0,630,042	1,235,015	235,015	123.50%	2.66%
63	AT2403	2004/4/1	105ヵ月	1,000,000	1,551,768	0,644,426	1,263,210	263,210	126.32%	3.01%
64	AT2404	2004/5/3	104ヵ月	1,000,000	1,429,064	0,699,758	1,371,673	371,673	137.17%	4.28%
65	AT2405	2004/6/1	103ヵ月	1,000,000	1,395,055	0,716,817	1,405,112	405,112	140.51%	4.72%
66	AT2406	2004/7/1	102ヵ月	1,000,000	1,318,409	0,758,489	1,486,798	486,798	148.68%	5.72%
67	AT2407	2004/8/2	101ヵ月	1,000,000	1,313,299	0,761,441	1,492,585	492,585	149.26%	5.85%
68	AT2408	2004/9/1	100ヵ月	1,000,000	1,323,594	0,755,518	1,480,974	480,974	148.10%	5.77%
69	AT2409	2004/10/1	99ヵ月	1,000,000	1,357,884	0,736,439	1,443,575	443,575	144.36%	5.37%
70	AT2410	2004/11/1	98ヵ月	1,000,000	1,408,223	0,710,215	1,392,171	392,171	139.22%	4.80%
71	AT2411	2004/12/1	97ヵ月	1,000,000	1,507,175	0,663,492	1,300,584	300,584	130.62%	3.72%
72	AT2412	2005/1/3	96ヵ月	1,000,000	1,500,722	0,666,345	1,306,176	306,176	130.62%	3.82%
73	AT2501	2005/2/1	95ヵ月	1,000,000	1,412,989	0,707,719	1,387,278	387,278	138.73%	4.89%
74	AT2502	2005/3/1	94ヵ月	1,000,000	1,459,169	0,685,321	1,343,373	343,373	134.34%	4.38%
75	AT2503	2005/4/1	93ヵ月	1,000,000	1,445,096	0,691,995	1,356,456	356,456	135.65%	4.59%
76	AT2504	2005/5/2	92ヵ月	1,000,000	1,402,509	0,713,007	1,397,644	397,644	139.76%	5.18%
77	AT2505	2005/6/1	91ヵ月	1,000,000	1,478,317	0,676,444	1,325,972	325,972	132.60%	4.29%
78	AT2506	2005/7/1	90ヵ月	1,000,000	1,532,845	0,652,381	1,278,804	278,804	127.88%	3.71%
79	AT2507	2005/8/1	89ヵ月	1,000,000	1,551,175	0,644,672	1,263,693	263,693	126.37%	3.55%
80	AT2508	2005/9/1	88ヵ月	1,000,000	1,607,807	0,621,965	1,219,182	219,182	121.92%	2.99%
81	AT2509	2005/10/3	87ヵ月	1,000,000	1,666,428	0,600,085	1,176,293	176,293	117.63%	2.43%
82	AT2510	2005/11/1	86ヵ月	1,000,000	1,637,800	0,610,575	1,196,855	196,855	119.69%	2.74%
83	AT2511	2005/12/1	85ヵ月	1,000,000	1,735,801	0,576,102	1,129,281	129,281	112.93%	1.82%
84	AT2512	2006/1/2	84ヵ月	1,000,000	1,710,516	0,584,618	1,145,974	145,974	114.60%	2.08%
85	AT2601	2006/2/1	83ヵ月	1,000,000	1,752,235	0,570,699	1,118,690	118,690	111.87%	1.72%
86	AT2602	2006/3/1	82ヵ月	1,000,000	1,693,853	0,590,370	1,157,249	157,249	115.72%	2.30%

「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