

2013年6月運用報告書(2013年6月1日～2013年6月30日)

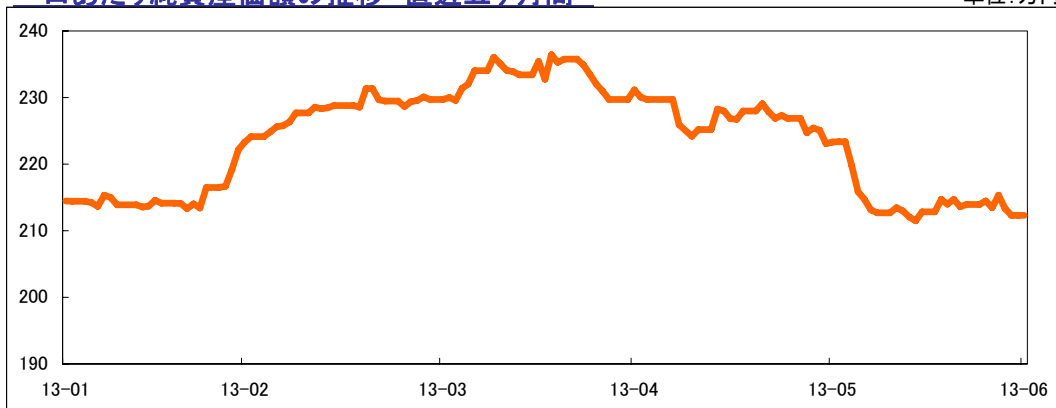
純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：7.79%】

	設定時 (1999/2/1)	2013年2月末	2013年3月末	2013年4月末	2013年5月末	2013年6月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	2,233,360	2,296,969	2,311,485	2,233,116	2,122,881
月次騰落率	—	4.13%	2.85%	0.63%	-3.39%	-4.94%
設定来騰落率	—	123.34%	129.70%	131.15%	123.31%	112.29%

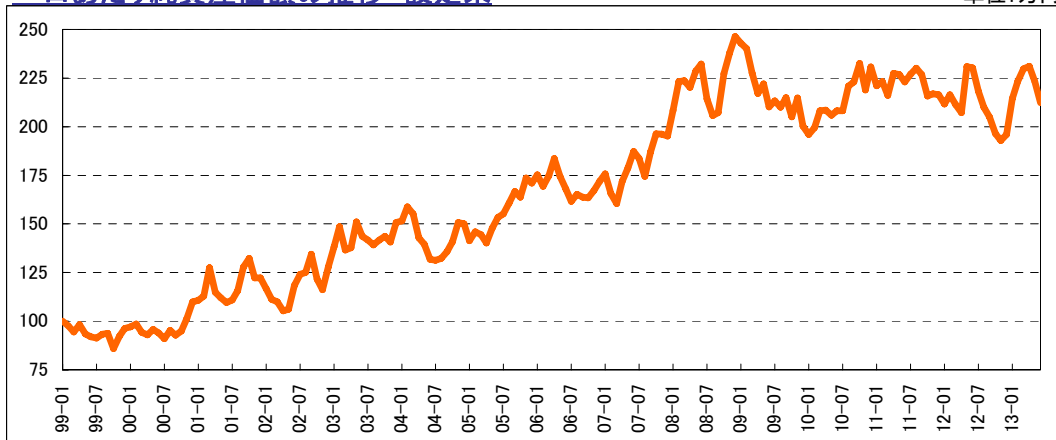
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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

2013年6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4.94%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、米ドルが対ユーロでドル安傾向となりました。英ポンドが反発に転じつつ豪ドルの下落も次第に鈍化、主要通貨のバランスがドル安に傾く中で、ドル円レートも当初の100.72円から、中旬にかけては93円台への円高傾向となりました。その後、米国の量的金融緩和からの方針転換の可能性が示されると、一転してドル高傾向へと転じ99円台で越月しました。

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、円、ドルが低水準での横ばい、スイスがマイナス金利維持となったものの、ユーロではわずかながら上昇傾向となりました。長期金利は、バーナンキFRB議長発言から米国の量的金融緩和が年内にも縮小される可能性が見込まれ、米国を中心に上昇傾向となりました。ただ、国内では横ばい推移となりました。

主要国の株価指数は、ほぼ全面安となりました。米国の量的金融緩和と早期縮小見通しから調整圧力が強まったものの、月末には米国の経済指標堅調を背景に切り返しました。新興国市場の下げが目立つなか、中国では成長鈍化と金融不安の強まりから株価が急落。国内では、欧米市場に先行して5月下旬に急落していたこともあり、おおむね横ばい推移となりました。

原油相場は、米国経済の堅調から需要の増加が見込まれ、ブレント原油は当初の100ドル水準から一時106ドル超えへ上昇しました。バーナンキFRB議長発言を受けて早期の量的金融緩和縮小見通しが強まると、株安とドル高を受けて100ドル水準へ下落する場面もありましたが、中東地域の情勢不安が下支え要因となり、おおむね100～105ドルで横ばい推移となりました。

金相場は、当初の1,390ドルから反発しましたが、1,423ドルで上昇は頭打ちとなり下落しました。更に1,320ドル割れを経て下落、下旬には1,200ドルを割り込む急落場面が見られました。米国市場では金ETFの持ち高を解消する動きが止まらず、9月にも量的金融緩和から脱却するとの見方もあって、欧州通貨を中心としたドル高傾向から調整地合いが強まりました。

大豆相場は、旧穀では1,500セント前半の横ばいから上放れ、1,564.50セントで越月しました。南米の出荷はストライキなどの不安が強く、足元では米国大豆のひっ迫感が強まり、月末にかけて上値を伸ばしました。一方で、新穀は作付面積が当初の計画から上方修正される見通しが強まったことから月間を通して下落傾向となるなど、限月で方向感の異なる推移となりました。

《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: 2013年6月30日時点)

評価日	2013/6/30
純資産価額	2,122,881

※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 = 純資産価額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)。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 ②	純資産価額 ③	取得口数 ④	評価額(時価) ⑤=①×④	評価損益 ⑥=⑤-②	損益率 ⑦=⑤÷②	年率 ⑧	
										②
1	AT9901	1999/2/1	173ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	2,122,881	1,122,881	212.29%	7.79%
2	AT9902	1999/3/1	172ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	2,175,475	1,175,475	217.55%	8.19%
3	AT9903	1999/4/1	171ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	2,246,513	1,246,513	224.65%	8.74%
4	AT9904	1999/5/6	170ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	2,161,249	1,161,249	216.12%	8.19%
5	AT9905	1999/6/1	169ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	2,272,762	1,272,762	227.28%	9.03%
6	AT9906	1999/7/1	168ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	2,309,412	1,309,412	230.94%	9.35%
7	AT9907	1999/8/2	167ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,324,219	1,324,219	232.42%	9.51%
8	AT9908	1999/9/1	166ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	2,275,579	1,275,579	227.56%	9.22%
9	AT9909	1999/10/1	165ヵ月	1,000,000	937,090	1,067,133	2,265,396	1,265,396	226.54%	9.20%
10	AT9910	1999/11/1	164ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,472,022	1,472,022	247.20%	10.77%
11	AT9911	1999/12/1	163ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,080	2,305,618	1,305,618	230.56%	9.61%
12	AT9912	2000/1/4	162ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	2,204,652	1,204,652	220.47%	8.92%
13	AT2001	2000/2/1	161ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	2,187,962	1,187,962	218.80%	8.85%
14	AT2002	2000/3/1	160ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	2,153,732	1,153,732	215.37%	8.65%
15	AT2003	2000/4/3	159ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	2,250,366	1,250,366	225.04%	9.43%
16	AT2004	2000/5/1	158ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	2,282,107	1,282,107	228.21%	9.73%
17	AT2005	2000/6/1	157ヵ月	1,000,000	957,390	1,044,506	2,217,361	1,217,361	221.74%	9.30%
18	AT2006	2000/7/1	156ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,413	2,259,048	1,259,048	225.90%	9.68%
19	AT2007	2000/8/1	155ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,812	2,334,769	1,334,769	233.48%	10.33%
20	AT2008	2000/9/1	154ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	2,227,131	1,227,131	222.71%	9.56%
21	AT2009	2000/10/1	153ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	2,287,835	1,287,835	228.78%	10.10%
22	AT2010	2000/11/1	152ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	2,237,646	1,237,646	223.76%	9.77%
23	AT2011	2000/12/1	151ヵ月	1,000,000	1,012,677	1,098,748	2,096,304	1,096,304	209.63%	8.71%
24	AT2012	2001/1/4	150ヵ月	1,000,000	1,099,531	1,090,978	1,930,713	930,713	193.07%	7.44%
25	AT2101	2001/2/1	149ヵ月	1,000,000	1,106,736	1,090,357	1,918,143	918,143	191.81%	7.39%
26	AT2102	2001/3/1	148ヵ月	1,000,000	1,128,441	1,086,178	1,881,250	881,250	188.13%	7.14%
27	AT2103	2001/4/2	147ヵ月	1,000,000	1,274,671	1,078,456	1,665,434	665,434	166.54%	5.43%
28	AT2104	2001/5/1	146ヵ月	1,000,000	1,148,518	1,070,687	1,848,364	848,364	184.84%	6.97%
29	AT2105	2001/6/1	145ヵ月	1,000,000	1,120,460	1,092,490	1,894,650	894,650	189.47%	7.40%
30	AT2106	2001/7/2	144ヵ月	1,000,000	1,095,410	1,091,290	1,937,978	937,978	193.80%	7.81%
31	AT2107	2001/8/1	143ヵ月	1,000,000	1,108,831	1,090,185	1,914,520	914,520	191.45%	7.67%
32	AT2108	2001/9/3	142ヵ月	1,000,000	1,156,883	1,084,391	1,834,999	834,999	183.50%	7.05%
33	AT2109	2001/10/1	141ヵ月	1,000,000	1,278,225	1,078,234	1,660,801	660,801	166.08%	5.62%
34	AT2110	2001/11/1	140ヵ月	1,000,000	1,323,490	1,075,578	1,604,002	604,002	160.40%	5.18%
35	AT2111	2001/12/3	139ヵ月	1,000,000	1,222,209	1,081,910	1,736,920	736,920	173.69%	6.36%
36	AT2112	2002/1/2	138ヵ月	1,000,000	1,221,883	1,081,808	1,737,382	737,382	173.74%	6.41%
37	AT2201	2002/2/1	137ヵ月	1,000,000	1,166,737	1,085,709	1,819,502	819,502	181.95%	7.18%
38	AT2202	2002/3/1	136ヵ月	1,000,000	1,111,645	1,099,567	1,909,673	909,673	190.97%	8.02%
39	AT2203	2002/4/1	135ヵ月	1,000,000	1,098,307	1,091,049	1,932,866	932,866	193.29%	8.29%
40	AT2204	2002/5/1	134ヵ月	1,000,000	1,053,547	1,053,474	2,014,983	1,014,983	201.50%	9.08%
41	AT2205	2002/6/3	133ヵ月	1,000,000	1,061,310	1,042,231	2,000,244	1,000,244	200.02%	9.02%
42	AT2206	2002/7/1	132ヵ月	1,000,000	1,182,603	1,045,592	1,795,091	795,091	179.51%	7.22%
43	AT2207	2002/8/1	131ヵ月	1,000,000	1,241,166	1,080,594	1,710,392	710,392	171.04%	6.50%
44	AT2208	2002/9/2	130ヵ月	1,000,000	1,251,288	1,079,916	1,696,555	696,555	169.66%	6.43%
45	AT2209	2002/10/1	129ヵ月	1,000,000	1,344,590	1,074,371	1,578,831	578,831	157.88%	5.38%
46	AT2210	2002/11/1	128ヵ月	1,000,000	1,216,142	1,022,272	1,745,585	745,585	174.56%	6.99%
47	AT2211	2002/12/2	127ヵ月	1,000,000	1,161,070	1,086,124	1,828,382	828,382	182.84%	7.82%
48	AT2212	2003/1/2	126ヵ月	1,000,000	1,278,691	1,078,209	1,660,196	660,196	166.02%	6.29%
49	AT2301	2003/2/3	125ヵ月	1,000,000	1,382,741	1,072,301	1,535,269	535,269	153.53%	5.14%
50	AT2302	2003/3/3	124ヵ月	1,000,000	1,485,812	1,073,032	1,428,766	428,766	142.88%	4.15%
51	AT2303	2003/4/1	123ヵ月	1,000,000	1,366,283	1,073,192	1,553,762	553,762	155.38%	5.40%
52	AT2304	2003/5/1	122ヵ月	1,000,000	1,377,293	1,072,601	1,541,341	541,341	154.13%	5.32%
53	AT2305	2003/6/2	121ヵ月	1,000,000	1,510,066	1,062,222	1,405,818	405,818	140.58%	4.02%
54	AT2306	2003/7/1	120ヵ月	1,000,000	1,436,823	1,069,579	1,477,480	477,480	147.75%	4.77%
55	AT2307	2003/8/1	119ヵ月	1,000,000	1,417,256	1,070,588	1,497,879	497,879	149.79%	5.02%
56	AT2308	2003/9/1	118ヵ月	1,000,000	1,392,804	1,071,976	1,524,177	524,177	152.42%	5.33%
57	AT2309	2003/10/1	117ヵ月	1,000,000	1,416,896	1,070,568	1,498,261	498,261	149.83%	5.11%
58	AT2310	2003/11/4	116ヵ月	1,000,000	1,436,951	1,069,517	1,477,348	477,348	147.73%	4.94%
59	AT2311	2003/12/1	115ヵ月	1,000,000	1,407,221	1,070,620	1,508,561	508,561	150.86%	5.30%
60	AT2312	2004/1/5	114ヵ月	1,000,000	1,506,668	1,063,716	1,408,990	408,990	140.90%	4.30%

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 ②	純資産価額 ③	取得口数 ④	評価額(時価) ⑤=①×④	評価損益 ⑥=⑤-②	損益率 ⑦=⑤÷②	年率 ⑧	
										②
61	AT2401	2004/2/2	113ヵ月	1,000,000	1,515,744	0.659742	1,400,553	400,553	140.06%	4.25%
62	AT2402	2004/3/1	112ヵ月	1,000,000	1,587,195	0.630042	1,337,504	337,504	133.75%	3.61%
63	AT2403	2004/4/1	111ヵ月	1,000,000	1,551,768	0.644426	1,368,039	368,039	136.80%	3.98%
64	AT2404	2004/5/3	110ヵ月	1,000,000	1,429,064	0.699758	1,485,502	485,502	148.55%	5.29%
65	AT2405	2004/6/1	109ヵ月	1,000,000	1,395,055	0.716817	1,521,717	521,717	152.17%	5.74%
66	AT2406	2004/7/1	108ヵ月	1,000,000	1,318,409	0.758489	1,610,181	610,181	161.02%	6.78%
67	AT2407	2004/8/2	107ヵ月	1,000,000	1,313,299	0.761441	1,616,448	616,448	161.64%	6.91%
68	AT2408	2004/9/1	106ヵ月	1,000,000	1,323,594	0.755518	1,603,874	603,874	160.39%	6.83%
69	AT2409	2004/10/1	105ヵ月	1,000,000	1,357,884	0.736439	1,563,372	563,372	156.34%	6.44%
70	AT2410	2004/11/1	104ヵ月	1,000,000	1,408,023	0.710215	1,507,701	507,701	150.77%	5.86%
71	AT2411	2004/12/1	103ヵ月	1,000,000	1,507,175	0.663492	1,408,514	408,514	140.85%	4.76%
72	AT2412	2005/1/3	102ヵ月	1,000,000	1,500,722	0.666345	1,414,571	414,571	141.46%	4.88%
73	AT2501	2005/2/1	101ヵ月	1,000,000	1,412,989	0.707719	1,502,403	502,403	150.24%	5.97%
74	AT2502	2005/3/1	100ヵ月	1,000,000	1,459,169	0.685321	1,454,854	454,854	145.49%	5.45%
75	AT2503	2005/4/1	99ヵ月	1,000,000	1,445,096	0.691995	1,469,023	469,023	146.90%	5.68%
76	AT2504	2005/5/2	98ヵ月	1,000,000	1,402,509	0.713007	1,513,629	513,629	151.36%	6.28%
77	AT2505	2005/6/1	97ヵ月	1,000,000	1,476,317	0.676444	1,436,010	436,010	143.60%	5.39%
78	AT2506	2005/7/1	96ヵ月	1,000,000	1,532,845	0.652381	1,384,927	384,927	138.49%	4.81%
79	AT2507	2005/8/1	95ヵ月	1,000,000	1,551,175	0.644672	1,368,561	368,561	136.86%	4.65%
80	AT2508	2005/9/1	94ヵ月	1,000,000	1,607,807	0.621965	1,320,357	320,357	132.04%	4.09%
81	AT2509	2005/10/3	93ヵ月	1,000,000	1,666,428	0.600085	1,273,909	273,909	127.39%	3.53%
82	AT2510	2005/11/1	92ヵ月	1,000,000	1,637,800	0.610575	1,296,178	296,178	129.62%	3.86%
83	AT2511	2005/12/1	91ヵ月	1,000,000	1,735,801	0.576102	1,222,995	222,995	122.30%	2.94%
84	AT2512	2006/1/2	90ヵ月	1,000,000	1,710,516	0.584618	1,241,074	241,074	124.11%	3.21%
85	AT2601	2006/2/1	89ヵ月	1,000,000	1,752,235	0.570699	1,211,526	211,526	121.15%	2.85%

「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：東京都中央区新川2-12-16

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