

## 2013年8月運用報告書(2013年8月1日～2013年8月31日)

### 純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：6.98%】

	設定時 (1999/2/1)	2013年4月末	2013年5月末	2013年6月末	2013年7月末	2013年8月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	2,311,485	2,233,116	2,122,881	2,099,100	2,018,257
月次騰落率	—	0.63%	-3.39%	-4.94%	-1.12%	-3.85%
設定来騰落率	—	131.15%	123.31%	112.29%	109.91%	101.83%

### 各セクターごとの損益

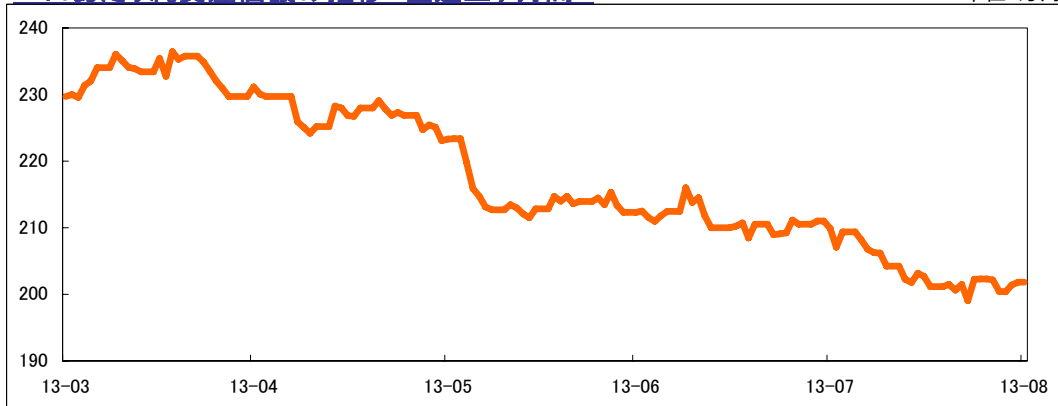
2013年8月の運用成績はマイナスとなり、アセットトライは前月比3.85%の損失となりました。

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。

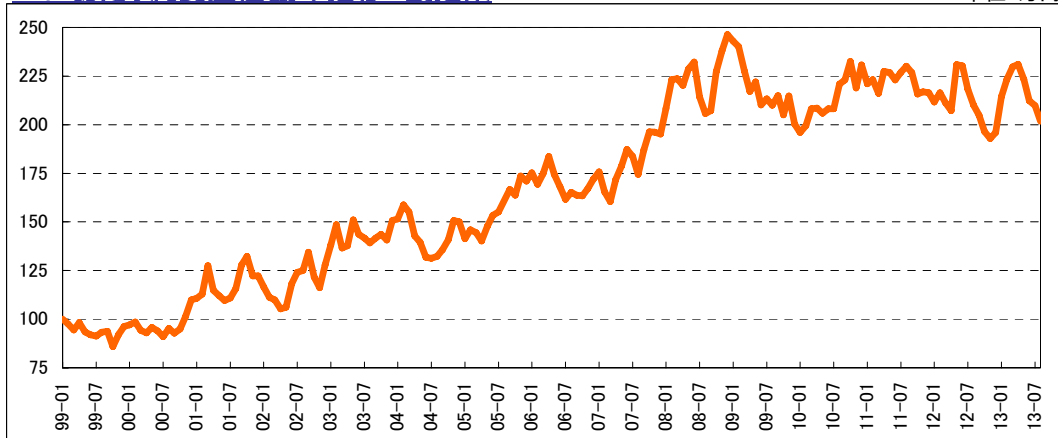
### 一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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、米ドルが対ユーロではほぼ横ばい傾向となりましたが、英ポンドなど旧英連邦系通貨は下落傾向と、ドル高とドル安が拮抗する、サマーマーケット特有の方向感を欠く展開となりました。ドル円レートは盆休期とあって実需取引も停滞し、95円台半ばから99円台後半での横ばい推移となる一方で、新興市場の下落もあって円の全面高傾向が強まる場面も見られました。

主要国の短期金利は、日米欧ともに低金利政策を維持していることから低水準での横ばい、スイスはマイナス金利を継続しました。主要国の長期金利は、米国が9月にも量的金融緩和を縮小する可能性から、米国で上昇し英国、ドイツも追随高。ただ、シリア情勢の緊張を背景に、米国金利は月末にかけて低下しました。国内では低水準での横ばいが警戒しました。

主要国の株価指数は、おおむね横ばいから弱含みとなりました。米国の経済指標は堅調となりましたが、量的金融緩和縮小の見通しから米国株は軟調。日本や欧州など先進国市場も米国株に追随し、月末はシリア情勢の緊張からリスク資産の解消が進んだことが圧迫となりました。新興市場は通貨安・株安傾向となったものの、中国株は成長鈍化懸念が後退し堅調となりました。

原油相場は、ブレント原油は7月から続く106～110ドルのレンジから115ドル前後へと水準を切り上げました。米国集積地での原油在庫減少傾向や、リビアからの輸出減少で欧州地域の原油需給が逼迫気味となり上昇。更に月末にかけてはシリアに対する米国の軍事介入が懸念されたことから一時117.34ドルへの急伸を経て、113ドル台で越月しました。

金相場は当初の1,322ドルから上昇傾向となりました。ほぼ一貫して上昇傾向をたどり、下旬には1,430ドル超えの高値まで上昇しました。米国市場で続いていた金ETFの持ち高解消が一巡。9月の量的金融緩和縮小見通しを背景にゼロ金利誘導の長期化も見込まれ、新興市場の株式市場が調整色を強める中で米国株も軟調地合となり、金を安値で買い戻す動きが活発化しました。

大豆相場は月間を通して上昇傾向となりました。7月は米国産地の天候が順調となり下落傾向となっていました。米農務省が米国大豆の生産高を作付け遅れの影響などから下方修正したことから反発。さらに8月は産地の広い範囲で高温乾燥気候に見舞われ、ちょうど単収を決定付ける時期に重なったことで一段の生産下方修正懸念が強まり、月末にかけて上値を伸ばしました。

《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: 2013年8月31日時点)

評価日	2013/8/31
純資産価額	2,018,257

※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	純資産価額	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	175ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	2,018,257	1,018,257	201.83%	6.98%
2	AT9902	1999/3/1	174ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	2,068,259	1,068,259	206.83%	7.36%
3	AT9903	1999/4/1	173ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	2,135,796	1,135,796	213.58%	7.87%
4	AT9904	1999/5/6	172ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	2,054,734	1,054,734	205.47%	7.35%
5	AT9905	1999/6/1	171ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	2,160,751	1,160,751	216.08%	8.14%
6	AT9906	1999/7/1	170ヵ月	1,000,000	919,200	1,087,867	2,195,595	1,195,595	219.56%	8.43%
7	AT9907	1999/8/2	169ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,209,672	1,209,672	220.97%	8.58%
8	AT9908	1999/9/1	168ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	2,163,430	1,163,430	216.34%	8.30%
9	AT9909	1999/10/1	167ヵ月	1,000,000	937,090	1,067,133	2,153,748	1,153,748	215.37%	8.28%
10	AT9910	1999/11/1	166ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,350,191	1,350,191	235.02%	9.75%
11	AT9911	1999/12/1	165ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,080	2,191,988	1,191,988	219.20%	8.66%
12	AT9912	2000/1/4	164ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	2,095,998	1,095,998	209.60%	8.01%
13	AT2001	2000/2/1	163ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	2,080,130	1,080,130	208.01%	7.95%
14	AT2002	2000/3/1	162ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	2,047,588	1,047,588	204.76%	7.75%
15	AT2003	2000/4/3	161ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	2,139,459	1,139,459	213.95%	8.49%
16	AT2004	2000/5/1	160ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	2,169,636	1,169,636	216.96%	8.76%
17	AT2005	2000/6/1	159ヵ月	1,000,000	957,390	1,044,506	2,108,081	1,108,081	210.81%	8.36%
18	AT2006	2000/7/1	158ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,143	2,147,714	1,147,714	214.77%	8.71%
19	AT2007	2000/8/1	157ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,531	2,219,703	1,219,703	221.97%	9.32%
20	AT2008	2000/9/1	156ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	2,117,369	1,117,369	211.74%	8.59%
21	AT2009	2000/10/1	155ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	2,175,081	1,175,081	217.51%	9.09%
22	AT2010	2000/11/1	154ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	2,127,365	1,127,365	212.74%	8.78%
23	AT2011	2000/12/1	153ヵ月	1,000,000	1,012,677	1,098,748	1,992,990	992,990	199.30%	7.78%
24	AT2012	2001/1/4	152ヵ月	1,000,000	1,099,531	1,090,478	1,835,560	835,560	183.56%	6.59%
25	AT2101	2001/2/1	151ヵ月	1,000,000	1,106,736	1,090,357	1,823,610	823,610	182.36%	6.54%
26	AT2102	2001/3/1	150ヵ月	1,000,000	1,128,441	1,086,178	1,788,534	788,534	178.85%	6.30%
27	AT2103	2001/4/2	149ヵ月	1,000,000	1,274,671	1,078,456	1,583,354	583,354	158.34%	4.69%
28	AT2104	2001/5/1	148ヵ月	1,000,000	1,148,518	1,070,687	1,757,270	757,270	175.73%	6.13%
29	AT2105	2001/6/1	147ヵ月	1,000,000	1,120,460	1,092,490	1,801,274	801,274	180.13%	6.54%
30	AT2106	2001/7/2	146ヵ月	1,000,000	1,095,410	1,091,290	1,842,466	842,466	184.25%	6.92%
31	AT2107	2001/8/1	145ヵ月	1,000,000	1,108,831	1,090,185	1,820,165	820,165	182.02%	6.78%
32	AT2108	2001/9/3	144ヵ月	1,000,000	1,156,883	1,064,391	1,744,563	744,563	174.46%	6.20%
33	AT2109	2001/10/1	143ヵ月	1,000,000	1,278,225	1,078,234	1,578,951	578,951	157.90%	4.85%
34	AT2110	2001/11/1	142ヵ月	1,000,000	1,323,490	1,075,578	1,524,950	524,950	152.50%	4.43%
35	AT2111	2001/12/3	141ヵ月	1,000,000	1,222,209	1,081,190	1,651,317	651,317	165.13%	5.54%
36	AT2112	2002/1/2	140ヵ月	1,000,000	1,221,883	1,081,808	1,651,757	651,757	165.18%	5.58%
37	AT2201	2002/2/1	139ヵ月	1,000,000	1,166,737	1,085,709	1,729,829	729,829	172.98%	6.30%
38	AT2202	2002/3/1	138ヵ月	1,000,000	1,111,645	1,099,567	1,815,557	815,557	181.56%	7.08%
39	AT2203	2002/4/1	137ヵ月	1,000,000	1,098,307	1,091,049	1,837,606	837,606	183.76%	7.33%
40	AT2204	2002/5/1	136ヵ月	1,000,000	1,053,547	1,094,917	1,915,677	915,677	191.57%	8.07%
41	AT2205	2002/6/3	135ヵ月	1,000,000	1,061,310	1,094,223	1,901,664	901,664	190.17%	8.01%
42	AT2206	2002/7/1	134ヵ月	1,000,000	1,182,603	1,084,592	1,706,621	706,621	170.66%	6.32%
43	AT2207	2002/8/1	133ヵ月	1,000,000	1,241,166	1,080,594	1,626,097	626,097	162.61%	5.64%
44	AT2208	2002/9/2	132ヵ月	1,000,000	1,251,288	1,079,176	1,612,942	612,942	161.29%	5.57%
45	AT2209	2002/10/1	131ヵ月	1,000,000	1,344,590	1,074,321	1,501,020	501,020	150.10%	4.59%
46	AT2210	2002/11/1	130ヵ月	1,000,000	1,216,142	1,082,272	1,659,556	659,556	165.96%	6.08%
47	AT2211	2002/12/2	129ヵ月	1,000,000	1,161,070	1,086,124	1,738,272	738,272	173.83%	6.86%
48	AT2212	2003/1/2	128ヵ月	1,000,000	1,278,691	1,078,375	1,578,375	578,375	157.84%	5.42%
49	AT2301	2003/2/3	127ヵ月	1,000,000	1,382,741	1,072,301	1,459,605	459,605	145.96%	4.34%
50	AT2302	2003/3/3	126ヵ月	1,000,000	1,485,812	1,073,032	1,358,351	358,351	135.84%	3.41%
51	AT2303	2003/4/1	125ヵ月	1,000,000	1,366,283	1,073,192	1,477,186	477,186	147.72%	4.58%
52	AT2304	2003/5/1	124ヵ月	1,000,000	1,377,293	1,072,601	1,465,377	465,377	146.54%	4.50%
53	AT2305	2003/6/2	123ヵ月	1,000,000	1,310,066	1,062,222	1,336,534	336,534	133.65%	3.28%
54	AT2306	2003/7/1	122ヵ月	1,000,000	1,436,823	1,069,579	1,404,664	404,664	140.47%	3.98%
55	AT2307	2003/8/1	121ヵ月	1,000,000	1,417,256	1,070,588	1,424,057	424,057	142.41%	4.20%
56	AT2308	2003/9/1	120ヵ月	1,000,000	1,392,004	1,071,797	1,449,060	449,060	144.91%	4.49%
57	AT2309	2003/10/1	119ヵ月	1,000,000	1,416,896	1,070,578	1,424,421	424,421	142.44%	4.28%
58	AT2310	2003/11/4	118ヵ月	1,000,000	1,436,951	1,069,517	1,404,539	404,539	140.45%	4.11%
59	AT2311	2003/12/1	117ヵ月	1,000,000	1,407,221	1,070,620	1,434,213	434,213	143.42%	4.45%
60	AT2312	2004/1/5	116ヵ月	1,000,000	1,506,668	1,063,716	1,339,549	339,549	133.95%	3.51%

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	純資産価額	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	115ヵ月	1,000,000	1,515,744	0.659742	1,331,528	331,528	133.15%	3.46%
62	AT2402	2004/3/1	114ヵ月	1,000,000	1,587,195	0.630042	1,271,586	271,586	127.16%	2.86%
63	AT2403	2004/4/1	113ヵ月	1,000,000	1,551,768	0.644426	1,300,617	300,617	130.06%	3.19%
64	AT2404	2004/5/3	112ヵ月	1,000,000	1,429,064	0.699758	1,412,291	412,291	141.23%	4.41%
65	AT2405	2004/6/1	111ヵ月	1,000,000	1,395,055	0.716817	1,446,720	446,720	144.67%	4.83%
66	AT2406	2004/7/1	110ヵ月	1,000,000	1,318,409	0.758489	1,530,825	530,825	153.08%	5.79%
67	AT2407	2004/8/2	109ヵ月	1,000,000	1,313,299	0.761441	1,536,783	536,783	153.68%	5.90%
68	AT2408	2004/9/1	108ヵ月	1,000,000	1,323,594	0.755518	1,524,829	524,829	152.48%	5.83%
69	AT2409	2004/10/1	107ヵ月	1,000,000	1,427,884	0.736439	1,486,323	486,323	148.63%	5.45%
70	AT2410	2004/11/1	106ヵ月	1,000,000	1,408,023	0.710215	1,433,396	433,396	143.34%	4.90%
71	AT2411	2004/12/1	105ヵ月	1,000,000	1,507,175	0.663492	1,339,097	339,097	133.91%	3.87%
72	AT2412	2005/1/3	104ヵ月	1,000,000	1,500,722	0.666345	1,344,855	344,855	134.49%	3.98%
73	AT2501	2005/2/1	103ヵ月	1,000,000	1,412,989	0.707719	1,428,358	428,358	142.84%	4.99%
74	AT2502	2005/3/1	102ヵ月	1,000,000	1,459,169	0.685321	1,383,153	383,153	138.32%	4.50%
75	AT2503	2005/4/1	101ヵ月	1,000,000	1,445,096	0.691995	1,396,623	396,623	139.66%	4.71%
76	AT2504	2005/5/2	100ヵ月	1,000,000	1,402,509	0.713007	1,439,031	439,031	143.90%	5.26%
77	AT2505	2005/6/1	99ヵ月	1,000,000	1,478,317	0.676444	1,365,237	365,237	136.52%	4.42%
78	AT2506	2005/7/1	98ヵ月	1,000,000	1,532,845	0.652381	1,316,732	316,732	131.67%	3.87%
79	AT2507	2005/8/1	97ヵ月	1,000,000	1,551,175	0.644672	1,301,113	301,113	130.11%	3.72%
80	AT2508	2005/9/1	96ヵ月	1,000,000	1,607,807	0.621965	1,255,285	255,285	125.53%	3.19%
81	AT2509	2005/10/3	95ヵ月	1,000,000	1,666,428	0.600085	1,211,125	211,125	121.11%	2.66%
82	AT2510	2005/11/1	94ヵ月	1,000,000	1,637,800	0.610575	1,232,297	232,297	123.23%	2.96%
83	AT2511	2005/12/1	93ヵ月	1,000,000	1,738,801	0.576102	1,162,721	162,721	116.27%	2.10%
84	AT2512	2006/1/2	92ヵ月	1,000,000	1,710,516	0.584618	1,179,909	179,909	117.99%	2.35%
85	AT2601	2006/2/1	91ヵ月	1,000,000	1,752,235	0.570699	1,151,817	151,817	115.18%	2.00%
86	AT2602	2006/3/1	90ヵ月	1,000,000	1,693,853	0.590370	1,191,518	191,518	119.15%	2.55%
87										

## 「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