

2014年2月運用報告書(2014年2月1日～2014年2月28日)

純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：6.57%】

	設定時 (1999/2/1)	2013年10月末	2013年11月末	2013年12月末	2014年1月末	2014年2月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	1,844,524	1,876,570	1,922,585	2,062,577	1,990,617
月次騰落率	—	1.32%	1.74%	2.45%	7.28%	-3.49%
設定来騰落率	—	84.45%	87.66%	92.26%	106.26%	99.06%

各セクターごとの損益

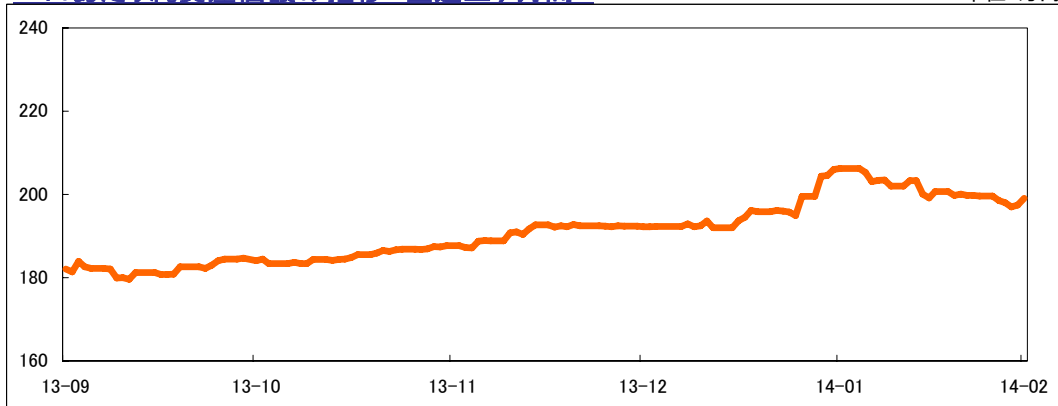
2014年2月の運用成績はマイナスとなり、アセットトライは前月比3.49%の損失となりました。

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。

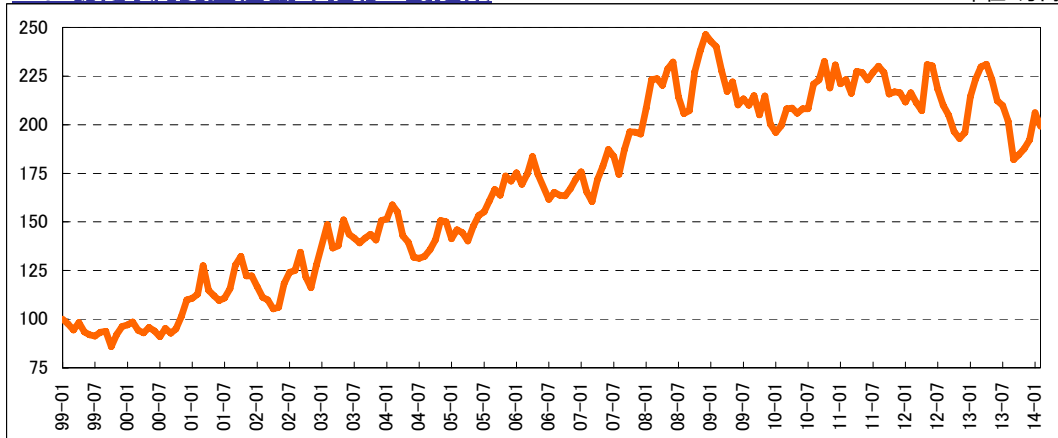
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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

為替相場では、米ドルは対ユーロではドル安傾向となりました。米国の金融緩和スタンスと対象的に、ユーロ圏ではドイツを中心に鉱工業生産が回復、デフレ圧力が懸念されながらもユーロ高ドル安が進展しました。一方、ドル円は102.82円を円安最大値としつつ、主要通貨に対しては円高傾向。日本市場では海外勢の株式市場でのヘッジ取引解消から円買い需要が残存したことも円高の背景となりました。

主要国の短期金利は、円、ドル、ユーロともに、横ばい推移となりました。長期金利は、米国で量的金融緩和の縮小が進められ米国株も堅調地合いを取り戻したものの、1月後半から続く新興国市場の金融不安を背景として、米国債をはじめ主要国の債券需要が強まったことから、米国、ドイツ、英国など主要国ではおおむね横ばい。国内でも低水準での横ばいを持続しました。

主要国の株価指数は、新興国の金融不安を背景とした急落が月初で一巡、米国株主導で反発しました。米国の経済指標は寒波の影響もあって強弱が交じる結果となったものの、月末にはS&P500指数で過去最高値を更新。欧州株も追随高となりました。ただ、日本株は中国の経済成長鈍化懸念や、円高もあって反発力が弱く、日経平均株価は15,000円が抵抗となりました。

原油相場は、ブレントが当初の105ドル台から上昇、一時110ドルを上回りました。当初はイランからの原油輸出再開や、新興国経済の成長鈍化による需要抑制見通しが圧迫となったものの、米国では寒波で需要が増加、パイプライン稼働による在庫の移動も進んだことからWTI主導で原油の国際価格が上昇。月末にかけてはウクライナの情勢不安も上昇要因となりました。

金相場は1,240ドルから下値を切り上げ、下旬の1,345ドルへの上昇を経て1,325ドルで越月しました。米国金融政策では、政策金利のゼロ金利誘導の継続を確認したこともあり、上昇傾向を維持。米国市場を中心に株価が堅調な足取りを見せる一方で、投資家の金に対する関心が戻り、ETFの購入が次第に活発化したことも、上昇の背景となりました。

大豆相場は、当初の1,280セント水準から上昇傾向となりました。南米の新穀出回りの時期を迎えたものの、ブラジルでは干ばつで生産高の下方修正と米国大豆の輸出増加が見込まれたほか、今年の米国大豆作付面積が拡大してもひっ迫感の強い状態が続くとの見通しが示されたことから上昇。月末にはウクライナ情勢の不安から穀物全体が上昇すると見られ、1,400セントを上回りました。

《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: 2014年2月28日時点)

評価日	2014/2/28
純資産価額	1,990,617

※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	181ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	990,617	199.06%	6.57%	
2	AT9902	1999/3/1	180ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	2,039,934	203.99%	6.93%	
3	AT9903	1999/4/1	179ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	2,106,546	210.56%	7.41%	
4	AT9904	1999/5/6	178ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	2,026,595	202.66%	6.92%	
5	AT9905	1999/6/1	177ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	2,131,160	213.12%	7.66%	
6	AT9906	1999/7/1	176ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	2,165,526	216.55%	7.94%	
7	AT9907	1999/8/2	175ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,179,411	217.94%	8.08%	
8	AT9908	1999/9/1	174ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	2,133,802	213.38%	7.82%	
9	AT9909	1999/10/1	173ヵ月	1,000,000	937,090	1,067,133	2,124,253	212.43%	7.79%	
10	AT9910	1999/11/1	172ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,318,005	231.80%	9.19%	
11	AT9911	1999/12/1	171ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,080	2,161,969	216.20%	8.15%	
12	AT9912	2000/1/4	170ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	2,067,293	206.73%	7.53%	
13	AT2001	2000/2/1	169ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	2,051,643	205.16%	7.46%	
14	AT2002	2000/3/1	168ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	2,019,546	201.95%	7.28%	
15	AT2003	2000/4/3	167ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	2,110,159	211.02%	7.97%	
16	AT2004	2000/5/1	166ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	2,139,923	213.99%	8.24%	
17	AT2005	2000/6/1	165ヵ月	1,000,000	957,390	1,045,066	2,079,211	207.92%	7.85%	
18	AT2006	2000/7/1	164ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,143	2,118,301	211.83%	8.18%	
19	AT2007	2000/8/1	163ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,812	2,189,304	218.93%	8.75%	
20	AT2008	2000/9/1	162ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	2,088,372	208.84%	8.06%	
21	AT2009	2000/10/1	161ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	2,145,293	214.53%	8.53%	
22	AT2010	2000/11/1	160ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	2,098,231	209.82%	8.23%	
23	AT2011	2000/12/1	159ヵ月	1,000,000	1,012,677	1,098,748	2,196,696	219.67%	7.29%	
24	AT2012	2001/1/4	158ヵ月	1,000,000	1,099,531	1,090,478	2,181,422	218.14%	6.15%	
25	AT2101	2001/2/1	157ヵ月	1,000,000	1,106,736	1,093,557	2,198,635	219.86%	6.10%	
26	AT2102	2001/3/1	156ヵ月	1,000,000	1,128,441	1,086,178	2,164,040	216.40%	5.87%	
27	AT2103	2001/4/2	155ヵ月	1,000,000	1,274,616	1,078,456	2,156,670	215.67%	4.35%	
28	AT2104	2001/5/1	154ヵ月	1,000,000	1,148,518	1,070,687	2,133,204	213.32%	5.71%	
29	AT2105	2001/6/1	153ヵ月	1,000,000	1,120,460	1,089,249	2,176,605	217.66%	6.09%	
30	AT2106	2001/7/2	152ヵ月	1,000,000	1,095,410	1,091,290	2,181,234	218.12%	6.45%	
31	AT2107	2001/8/1	151ヵ月	1,000,000	1,108,831	1,090,185	2,195,237	219.52%	6.32%	
32	AT2108	2001/9/3	150ヵ月	1,000,000	1,156,883	1,086,439	2,170,671	217.07%	5.76%	
33	AT2109	2001/10/1	149ヵ月	1,000,000	1,278,225	1,078,234	2,155,327	215.53%	4.49%	
34	AT2110	2001/11/1	148ヵ月	1,000,000	1,323,490	1,054,066	2,150,066	215.01%	4.09%	
35	AT2111	2001/12/3	147ヵ月	1,000,000	1,222,200	1,081,890	2,162,702	216.27%	5.13%	
36	AT2112	2002/1/2	146ヵ月	1,000,000	1,221,883	1,081,848	2,169,136	216.91%	5.17%	
37	AT2201	2002/2/1	145ヵ月	1,000,000	1,166,737	1,085,709	2,170,139	217.01%	5.84%	
38	AT2202	2002/3/1	144ヵ月	1,000,000	1,111,645	1,089,567	2,190,693	219.07%	6.58%	
39	AT2203	2002/4/1	143ヵ月	1,000,000	1,098,307	1,091,049	2,181,440	218.14%	6.81%	
40	AT2204	2002/5/1	142ヵ月	1,000,000	1,053,547	1,094,971	2,189,441	218.94%	7.51%	
41	AT2205	2002/6/3	141ヵ月	1,000,000	1,061,310	1,094,231	2,187,621	218.76%	7.45%	
42	AT2206	2002/7/1	140ヵ月	1,000,000	1,182,603	1,084,592	2,168,249	216.83%	5.85%	
43	AT2207	2002/8/1	139ヵ月	1,000,000	1,241,166	1,080,594	2,160,828	216.08%	5.21%	
44	AT2208	2002/9/2	138ヵ月	1,000,000	1,251,288	1,079,176	2,159,853	215.99%	5.14%	
45	AT2209	2002/10/1	137ヵ月	1,000,000	1,344,590	1,074,321	2,149,463	214.95%	4.21%	
46	AT2210	2002/11/1	136ヵ月	1,000,000	1,216,142	1,082,272	2,163,828	216.38%	5.62%	
47	AT2211	2002/12/2	135ヵ月	1,000,000	1,161,070	1,086,127	2,174,466	217.45%	6.35%	
48	AT2212	2003/1/2	134ヵ月	1,000,000	1,278,691	1,078,209	2,156,760	215.67%	4.98%	
49	AT2301	2003/2/3	133ヵ月	1,000,000	1,382,741	1,072,301	2,149,616	214.96%	3.97%	
50	AT2302	2003/3/3	132ヵ月	1,000,000	1,485,812	1,067,302	2,139,748	213.97%	3.09%	
51	AT2303	2003/4/1	131ヵ月	1,000,000	1,366,283	1,073,192	2,145,956	214.57%	4.18%	
52	AT2304	2003/5/1	130ヵ月	1,000,000	1,377,293	1,072,061	2,144,309	214.43%	4.11%	
53	AT2305	2003/6/2	129ヵ月	1,000,000	1,510,066	1,062,222	2,138,230	213.82%	2.96%	
54	AT2306	2003/7/1	128ヵ月	1,000,000	1,436,823	1,069,579	2,138,427	213.84%	3.61%	
55	AT2307	2003/8/1	127ヵ月	1,000,000	1,417,256	1,070,558	2,140,555	214.04%	3.82%	
56	AT2308	2003/9/1	126ヵ月	1,000,000	1,392,804	1,071,797	2,142,915	214.29%	4.09%	
57	AT2309	2003/10/1	125ヵ月	1,000,000	1,416,896	1,070,578	2,140,913	214.09%	3.89%	
58	AT2310	2003/11/4	124ヵ月	1,000,000	1,436,951	1,069,517	2,138,504	213.85%	3.73%	
59	AT2311	2003/12/1	123ヵ月	1,000,000	1,407,221	1,071,062	2,141,572	214.16%	4.04%	
60	AT2312	2004/1/5	122ヵ月	1,000,000	1,506,668	1,066,316	2,132,204	213.22%	3.16%	
61	AT2401	2004/2/2	121ヵ月	1,000,000	1,515,744	1,065,974	2,131,293	213.33%	3.11%	
62	AT2402	2004/3/1	120ヵ月	1,000,000	1,587,195	1,063,042	2,125,172	212.52%	2.54%	
63	AT2403	2004/4/1	119ヵ月	1,000,000	1,551,768	1,064,426	2,128,805	212.80%	2.85%	
64	AT2404	2004/5/3	118ヵ月	1,000,000	1,429,064	1,069,758	2,139,950	213.90%	3.99%	
65	AT2405	2004/6/1	117ヵ月	1,000,000	1,395,055	1,071,681	2,142,908	214.29%	4.38%	
66	AT2406	2004/7/1	116ヵ月	1,000,000	1,318,409	1,075,849	2,150,861	215.09%	5.27%	
67	AT2407	2004/8/2	115ヵ月	1,000,000	1,313,299	1,076,141	2,151,737	215.17%	5.38%	
68	AT2408	2004/9/1	114ヵ月	1,000,000	1,323,594	1,075,518	2,150,946	215.39%	5.30%	
69	AT2409	2004/10/1	113ヵ月	1,000,000	1,357,884	1,076,439	2,146,967	214.60%	4.95%	
70	AT2410	2004/11/1	112ヵ月	1,000,000	1,408,023	1,071,025	2,141,766	214.38%	4.43%	

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	
71	AT2411	2004/12/1	111ヵ月	1,000,000	1,507,175	1,066,349	1,320,758	320.758	3.47%	
72	AT2412	2005/1/3	110ヵ月	1,000,000	1,500,722	1,066,635	1,326,437	326.437	3.56%	
73	AT2501	2005/2/1	109ヵ月	1,000,000	1,412,989	1,070,719	1,408,797	408.797	4.50%	
74	AT2502	2005/3/1	108ヵ月	1,000,000	1,459,169	1,068,521	1,364,211	364.211	4.04%	
75	AT2503	2005/4/1	107ヵ月	1,000,000	1,445,096	1,069,195	1,377,497	377.497	4.23%	
76	AT2504	2005/5/2	106ヵ月	1,000,000	1,402,509	1,071,307	1,419,323	419.323	4.74%	
77	AT2505	2005/6/1	105ヵ月	1,000,000	1,478,317	1,067,644	1,346,540	346.540	3.96%	
78	AT2506	2005/7/1	104ヵ月	1,000,000	1,532,845	1,065,281	1,298,640	298.640	3.44%	
79	AT2507	2005/8/1	103ヵ月	1,000,000	1,551,175	1,064,672	1,283,295	283.295	3.30%	
80	AT2508	2005/9/1	102ヵ月	1,000,000	1,607,807	1,062,195	1,238,094	238.094	2.80%	
81	AT2509	2005/10/3	101ヵ月	1,000,000	1,666,428	1,060,085	1,194,539	194.539	2.31%	
82	AT2510	2005/11/1	100ヵ月	1,000,000	1,637,800	1,061,075	1,215,420	215.420	2.58%	
83	AT2511	2005/12/1	99ヵ月	1,000,000	1,735,801	1,057,102	1,146,798	146.798	1.78%	
84	AT2512	2006/1/2	98ヵ月	1,000,000	1,710,516	1,058,418	1,163,750	163.750	2.00%	
85	AT2601	2006/2/1	97ヵ月	1,000,000	1,752,235	1,057,069	1,136,043	136.043	1.68%	
86	AT2602	2006/3/1	96ヵ月	1,000,000	1,693,853	1,059,070	1,175,200	175.200	2.19%	
87	AT2603	2006/4/1	95ヵ月	1,000,000	1,747,442	1,057,265	1,139,160	139.160	1.76%	
88	AT2604	2006/5/1	94ヵ月	1,000,000	1,837,261	1,054,288	1,083,468	83.468	1.06%	
89	AT2605	2006/6/1	93ヵ月	1,000,000	1,744,468	1,053,240	1,141,101	141.101	1.42%	
90	AT2606	2006/7/1	92ヵ月	1,000,000	1,680,813	1,051,950	1,184,317	184.317	1.80%	
91	AT2607	2006/8/1	91ヵ月	1,000,000	1,616,044	1,051,795	1,231,783	231.783	3.06%	
92	AT2608	2006/9/1	90ヵ月	1,000,000	1,652,891	1,050,500	1,204,323	204.323	2.72%	
93	AT2609	2006/10/1	89ヵ月	1,000,000	1,637,067	1,051,048	1,215,964	215.964	2.91%	
94	AT2610	2006/11/1	88ヵ月	1,000,000	1,634,198	1,051,192	1,218,098	218.098	2.97%	
95	AT2611	2006/12/1	87ヵ月	1,000,000	1,671,404	1,051,984</				

「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2.16%（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