

# アセットライ

AT ADMINISTRATION (CAYMAN) LIMITED

作成日：2015年3月31日

## 2015年2月運用報告書(2015年2月1日～2015年2月28日)

### 純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：5.84%】

	設定時 (1999/2/1)	2014年10月末	2014年11月末	2014年12月末	2015年1月末	2015年2月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	2,005,781	2,016,730	2,004,358	1,931,325	1,938,896
月次騰落率	—	-0.67%	0.55%	-0.61%	-3.64%	0.39%
設定来騰落率	—	100.58%	101.67%	100.44%	93.13%	93.89%

### 各セクターごとの損益

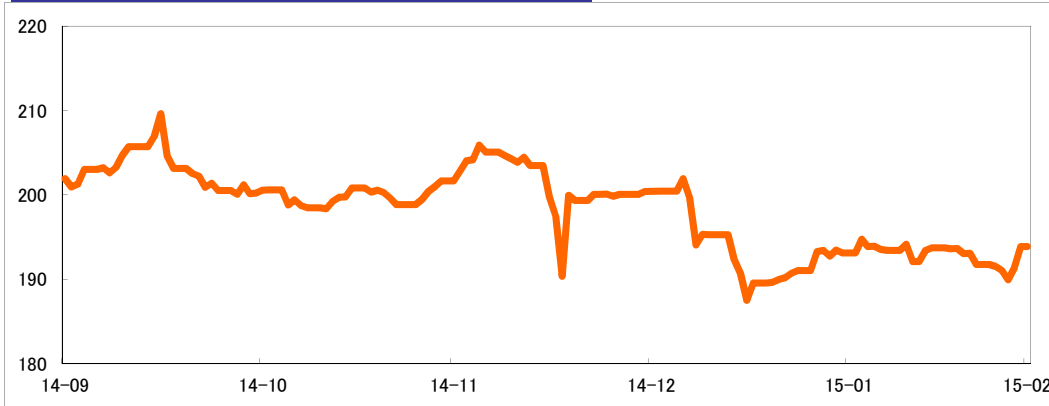
2015年2月の運用成績はプラスとなり、アセットライは前月比0.39%の利益となりました。

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。

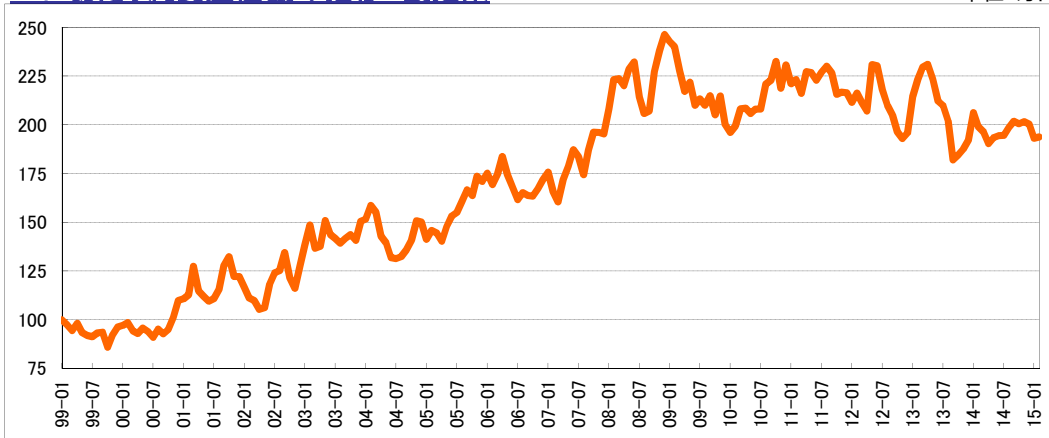
### 一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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ドル高基調を維持しつつ上旬の上昇場面も限定され、下旬には1ユーロ=1.11ドル台まで下落しました。ギリシャ財政問題は金融支援延長でも不透明感が残り、ドル高ユーロ安の流れが続きました。また、円相場は117円台半ばより円安傾向となりましたが、エネルギー価格の下落による貿易収支赤字の改善から、120円台半ばへの円安にとどまりました。

主要国の短期金利は、円、ドル、ユーロともに低水準での横ばい推移となりました。長期金利は、米国では時期について見解が分かれるものの利上げ見通しから上昇傾向となり、英国も追随しました。一方、量的緩和を導入したユーロ圏ではドイツ5年債がマイナス金利を拡大するなど低水準を維持。国内では月前半に小幅上昇したものの、後半は横ばいとなりました。

主要国の株価指数は、全般に堅調となりました。米国では雇用の改善で早期利上げ観測が強まったものの、インフレ率の低さから慎重な見方も強く、NYダウは最高値を更新。欧州ではギリシャに対する金融支援の延長決定で当面の不安要素が後退すると、英FT100指数、独DAX指数でも過去最高値を更新し、日本株も日経平均株価が2000年以来の高値となりました。

原油相場は、ブレントは石油関連の開発計画の見直し相次いでいるほか、米国の石油掘削リグ稼働数減少や製油所ストライキもあって、当初の52ドル台から上昇、月半ばには60ドルを回復しました。ただ、米国内の原油在庫は過去最高水準に達しており、欧州や中国では経済成長鈍化が引き続き懸念されることから、月後半は60ドル前後での横ばいとなりました。

金相場は、1,285ドルを高値に下落し、下旬には1,190ドルまで下落しました。旧正月連休を経て、アジアの現物実需の買いから反発し1,212ドルで越月しました。ギリシャ財政の不透明感で現物資産としての関心が下支えとなる一方で、米国の金融緩和引締めが2015年の年央から後半に見込まれるためドル高から上値は重く、前月に続いて調整色の強い展開となりました。

大豆相場は、当初の960セント前後から1,035セントへ月間を通して上昇傾向となりました。1月の下落に対し、米国の寒波による飼料向け大豆粕需要増加期待や、米農務省が今年の米国大豆作付面積を前年比減と予想したことからの反発。南米では収穫が本格化しているものの、ブラジルではトラック業者のストライキで輸出への不安が強まり、一段高となりました。

《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: 2015年2月28日時点)

評価日	2015/2/28	※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)
純資産価額	1,938,896	

	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	193ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,938,896	938,896	93.89%	5.84%
2	AT9902	1999/3/1	192ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	1,986,932	986,932	198.69%	6.16%
3	AT9903	1999/4/1	191ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	2,051,813	1,051,813	205.18%	6.60%
4	AT9904	1999/5/6	190ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	1,973,939	973,939	197.39%	6.15%
5	AT9905	1999/6/1	189ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	2,075,787	1,075,787	207.58%	6.83%
6	AT9906	1999/7/1	188ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	2,109,260	1,109,260	210.93%	7.08%
7	AT9907	1999/8/2	187ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,122,784	1,122,784	212.28%	7.20%
8	AT9908	1999/9/1	186ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	2,078,360	1,078,360	207.84%	6.95%
9	AT9909	1999/10/1	185ヵ月	1,000,000	937,090	1,067,133	2,069,059	1,069,059	206.91%	6.93%
10	AT9910	1999/11/1	184ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,052,778	1,194,016	225.78%	8.20%
11	AT9911	1999/12/1	183ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,080	2,105,796	1,105,796	210.58%	7.25%
12	AT9912	2000/1/4	182ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	2,013,580	1,013,580	201.36%	6.68%
13	AT2001	2000/2/1	181ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	1,998,336	998,336	199.83%	6.62%
14	AT2002	2000/3/1	180ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	1,967,073	967,073	196.71%	6.44%
15	AT2003	2000/4/3	179ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	2,055,332	1,055,332	205.53%	7.07%
16	AT2004	2000/5/1	178ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	2,084,322	1,084,322	208.43%	7.31%
17	AT2005	2000/6/1	177ヵ月	1,000,000	957,390	1,045,066	2,025,188	1,025,188	202.52%	6.95%
18	AT2006	2000/7/1	176ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,143	2,063,262	1,063,262	206.33%	7.25%
19	AT2007	2000/8/1	175ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,812	2,132,421	1,132,421	213.24%	7.76%
20	AT2008	2000/9/1	174ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	2,034,111	1,034,111	203.41%	7.13%
21	AT2009	2000/10/1	173ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	2,089,554	1,089,554	208.96%	7.55%
22	AT2010	2000/11/1	172ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	2,043,714	1,043,714	204.37%	7.28%
23	AT2011	2000/12/1	171ヵ月	1,000,000	1,012,677	1,097,481	1,914,622	914,622	191.46%	6.42%
24	AT2012	2001/1/4	170ヵ月	1,000,000	1,099,531	1,090,478	1,763,383	763,383	176.34%	5.39%
25	AT2101	2001/2/1	169ヵ月	1,000,000	1,106,736	1,090,557	1,751,903	751,903	175.19%	5.34%
26	AT2102	2001/3/1	168ヵ月	1,000,000	1,128,441	1,086,178	1,718,206	718,206	171.82%	5.13%
27	AT2103	2001/4/2	167ヵ月	1,000,000	1,274,617	1,078,456	1,521,094	521,094	152.11%	3.74%
28	AT2104	2001/5/1	166ヵ月	1,000,000	1,148,518	1,076,687	1,688,171	688,171	168.82%	4.97%
29	AT2105	2001/6/1	165ヵ月	1,000,000	1,120,460	1,089,249	1,730,445	730,445	173.04%	5.31%
30	AT2106	2001/7/2	164ヵ月	1,000,000	1,095,410	1,091,290	1,770,018	770,018	177.00%	5.63%
31	AT2107	2001/8/1	163ヵ月	1,000,000	1,108,831	1,091,850	1,748,593	748,593	174.86%	5.51%
32	AT2108	2001/9/3	162ヵ月	1,000,000	1,156,883	1,086,439	1,675,964	675,964	167.60%	5.01%
33	AT2109	2001/10/1	161ヵ月	1,000,000	1,278,225	1,072,334	1,516,864	516,864	151.69%	3.85%
34	AT2110	2001/11/1	160ヵ月	1,000,000	1,323,490	1,064,987	1,464,987	464,987	146.50%	3.49%
35	AT2111	2001/12/3	159ヵ月	1,000,000	1,222,209	1,081,890	1,586,385	586,385	158.64%	4.42%
36	AT2112	2002/1/2	158ヵ月	1,000,000	1,221,883	1,081,848	1,586,807	586,807	158.68%	4.46%
37	AT2201	2002/2/1	157ヵ月	1,000,000	1,166,737	1,085,091	1,661,810	661,810	166.18%	5.06%
38	AT2202	2002/3/1	156ヵ月	1,000,000	1,111,645	1,089,567	1,744,166	744,166	174.42%	5.72%
39	AT2203	2002/4/1	155ヵ月	1,000,000	1,098,307	1,094,042	1,765,349	765,349	176.53%	5.92%
40	AT2204	2002/5/1	154ヵ月	1,000,000	1,053,547	1,049,174	1,840,349	840,349	184.03%	6.54%
41	AT2205	2002/6/3	153ヵ月	1,000,000	1,061,310	1,042,231	1,826,887	826,887	182.69%	6.48%
42	AT2206	2002/7/1	152ヵ月	1,000,000	1,182,603	1,045,592	1,639,514	639,514	163.95%	5.05%
43	AT2207	2002/8/1	151ヵ月	1,000,000	1,241,166	1,080,694	1,562,156	562,156	156.22%	4.47%
44	AT2208	2002/9/2	150ヵ月	1,000,000	1,251,288	1,079,176	1,549,519	549,519	154.95%	4.39%
45	AT2209	2002/10/1	149ヵ月	1,000,000	1,344,590	1,074,321	1,441,997	441,997	144.20%	3.56%
46	AT2210	2002/11/1	148ヵ月	1,000,000	1,216,142	1,082,272	1,594,299	594,299	159.43%	4.82%
47	AT2211	2002/12/2	147ヵ月	1,000,000	1,161,070	1,086,124	1,669,920	669,920	166.99%	5.47%
48	AT2212	2003/1/2	146ヵ月	1,000,000	1,278,691	1,078,209	1,516,311	516,311	151.63%	4.24%
49	AT2301	2003/2/3	145ヵ月	1,000,000	1,382,741	1,072,320	1,402,211	402,211	140.22%	3.33%
50	AT2302	2003/3/3	144ヵ月	1,000,000	1,485,812	1,067,303	1,304,939	304,939	130.49%	2.54%
51	AT2303	2003/4/1	143ヵ月	1,000,000	1,366,283	1,073,192	1,419,101	419,101	141.91%	3.51%
52	AT2304	2003/5/1	142ヵ月	1,000,000	1,377,293	1,072,601	1,407,756	407,756	140.78%	3.44%
53	AT2305	2003/6/2	141ヵ月	1,000,000	1,510,066	1,062,222	1,283,979	283,979	128.40%	2.42%
54	AT2306	2003/7/1	140ヵ月	1,000,000	1,436,823	1,069,579	1,349,430	349,430	134.94%	2.99%
55	AT2307	2003/8/1	139ヵ月	1,000,000	1,417,256	1,075,588	1,368,061	368,061	136.81%	3.18%
56	AT2308	2003/9/1	138ヵ月	1,000,000	1,392,804	1,071,797	1,392,080	392,080	139.21%	3.41%
57	AT2309	2003/10/1	137ヵ月	1,000,000	1,416,896	1,075,768	1,368,410	368,410	136.84%	3.23%
58	AT2310	2003/11/4	136ヵ月	1,000,000	1,436,951	1,069,517	1,349,310	349,310	134.93%	3.08%
59	AT2311	2003/12/1	135ヵ月	1,000,000	1,407,221	1,071,062	1,377,818	377,818	137.78%	3.36%
60	AT2312	2004/1/5	134ヵ月	1,000,000	1,506,668	1,063,716	1,286,876	286,876	128.69%	2.57%
61	AT2401	2004/2/2	133ヵ月	1,000,000	1,515,744	1,065,972	1,279,171	279,171	127.92%	2.52%
62	AT2402	2004/3/1	132ヵ月	1,000,000	1,587,195	1,063,042	1,221,585	221,585	122.16%	2.01%
63	AT2403	2004/4/1	131ヵ月	1,000,000	1,551,768	1,064,426	1,249,474	249,474	124.95%	2.28%
64	AT2404	2004/5/3	130ヵ月	1,000,000	1,429,064	1,069,758	1,356,757	356,757	135.68%	3.29%
65	AT2405	2004/6/1	129ヵ月	1,000,000	1,395,055	1,071,681	1,389,833	389,833	138.98%	3.63%
66	AT2406	2004/7/1	128ヵ月	1,000,000	1,318,409	1,075,849	1,470,631	470,631	147.06%	4.41%
67	AT2407	2004/8/2	127ヵ月	1,000,000	1,313,299	1,076,141	1,476,354	476,354	147.64%	4.50%
68	AT2408	2004/9/1	126ヵ月	1,000,000	1,323,594	1,075,518	1,464,870	464,870	146.49%	4.43%
69	AT2409	2004/10/1	125ヵ月	1,000,000	1,357,884	1,076,439	1,427,878	427,878	142.79%	4.11%
70	AT2410	2004/11/1	124ヵ月	1,000,000	1,408,023	1,071,025	1,377,033	377,033	137.70%	3.65%

※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
71	AT2411	2004/12/1	123ヵ月	1,000,000	1,507,175	1,663,492	1,286,441	286,441	128.64%	2.79%
72	AT2412	2005/1/3	122ヵ月	1,000,000	1,500,722	1,666,345	1,291,973	291,973	129.20%	2.87%
73	AT2501	2005/2/1	121ヵ月	1,000,000	1,412,989	1,707,719	1,372,933	372,933	137.22%	3.69%
74	AT2502	2005/3/1	120ヵ月	1,000,000	1,459,169	1,685,521	1,328,766	328,766	132.88%	3.29%
75	AT2503	2005/4/1	119ヵ月	1,000,000	1,445,096	1,691,995	1,341,706	341,706	134.17%	3.44%
76	AT2504	2005/5/2	118ヵ月	1,000,000	1,402,509	1,713,007	1,382,446	382,446	138.24%	3.89%
77	AT2505	2005/6/1	117ヵ月	1,000,000	1,478,317	1,676,444	1,311,554	311,554	131.16%	3.19%
78	AT2506	2005/7/1	116ヵ月	1,000,000	1,532,845	1,652,381	1,264,898	264,898	126.49%	2.74%
79	AT2507	2005/8/1	115ヵ月	1,000,000	1,551,175	1,644,672	1,249,951	249,951	125.00%	2.61%
80	AT2508	2005/9/1	114ヵ月	1,000,000	1,607,807	1,621,965	1,205,925	205,925	120.59%	2.17%
81	AT2509	2005/10/3	113ヵ月	1,000,000	1,666,428	1,600,085	1,163,502	163,502	116.35%	1.74%
82	AT2510	2005/11/1	112ヵ月	1,000,000	1,637,800	1,610,575	1,183,841	183,841	118.38%	1.97%
83	AT2511	2005/12/1	111ヵ月	1,000,000	1,735,801	1,576,102	1,117,001	117,001	111.70%	1.26%
84	AT2512	2006/1/2	110ヵ月	1,000,000	1,710,516	1,584,618	1,133,513	133,513	113.35%	1.46%
85	AT2601	2006/2/1	109ヵ月	1,000,000	1,752,235	1,570,699	1,106,526	106,526	110.65%	1.17%
86	AT2602	2006/3/1	108ヵ月	1,000,000	1,693,853	1,590,370	1,144,666	144,666		

## 「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