

アセットトライ

2015年9月運用報告書(2015年9月1日～2015年9月30日)

純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：4.22%】

	設定時 (1999/2/1)	2015年5月末	2015年6月末	2015年7月末	2015年8月末	2015年9月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	1,970,226	1,866,883	1,887,543	1,670,731	1,703,976
月次騰落率	—	0.38%	-5.25%	1.11%	-11.49%	1.99%
設定来騰落率	—	97.02%	86.69%	88.75%	67.07%	70.40%

各セクターごとの損益

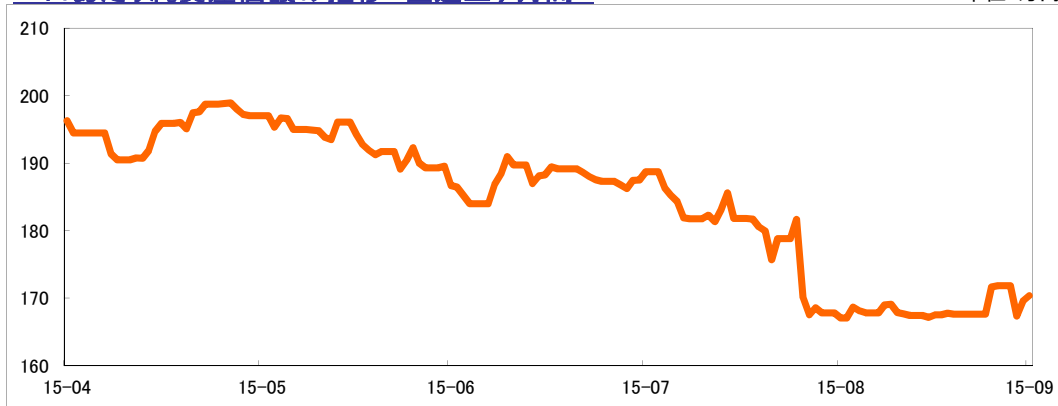
2015年9月の運用成績はプラスとなり、アセットトライは前月比1.99%の利益となりました。

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。

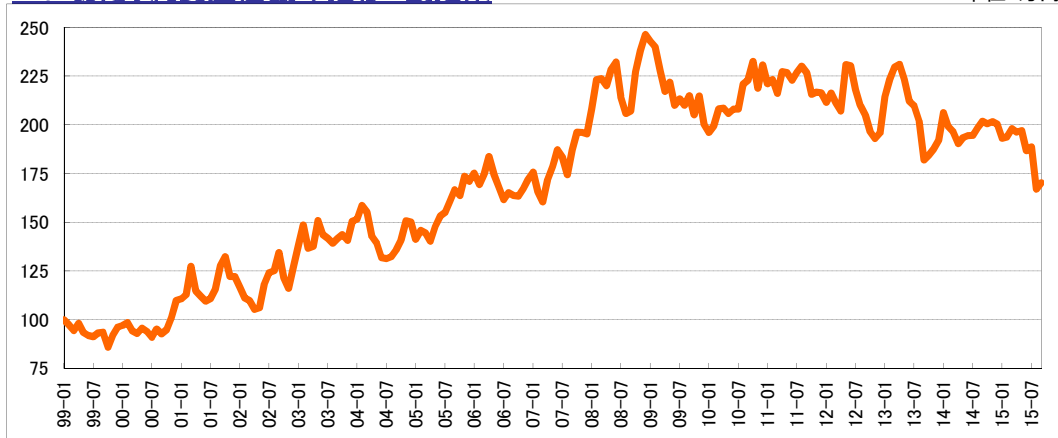
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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

米ドルは、対ユーロではほぼ横ばいとなり、概ね1ユーロ=1.10～1.13ドルで推移しました。ドルは対円でも方向感に乏しく、118.65～121.32円での横ばいとなりました。ただ、米国の金融引き締め見通しから高金利・資源国通貨の対ドルでの下落が続く、総じて円全面高の地合いとなりました。また、日本株下落による為替ヘッジの円買いが潜在し、円安の進展を抑えました。

主要国の短期金利は、ドル、円、ユーロとも金融政策が据え置きとなったことから横ばい、ユーロではマイナス金利が続きました。長期金利は、米FOMC(連邦公開市場委員会)前に上昇しましたが、利上げ見送りと株安から債券市場に資金が流入し、月末にかけては米、独とも利回り低下。国内では大手格付け会社の格下げの影響は限定的で、概ね横ばい推移となりました。

主要国の株価指数は、全般に軟調となりました。米国の利上げ見送りが下支えとなったものの、中国経済の減速を受けた石油など資源安から、資源関連企業の業績悪化見通しが上値を抑えました。月後半にはドイツ自動車大手VWが米国の排気ガス検査で不正を行っていた問題から、欧州の自動車産業に不安が広がったことも、欧州株を中心に圧迫となりました。

原油相場は、ブレントは8月の世界的な株価急落を受けた安値からの反発が一巡し、当初の53ドルから反落しました。世界経済の鈍化や、イランの輸出再開によって世界の石油需給は緩和状態が続くとの見通しが圧迫となる一方、石油企業の投資計画縮小や、米国の利上げ見送りでドル高が一服したことも下支えとなり、中旬以降は46～50ドルでの横ばいとなりました。

金相場は、当初1,134ドルから1,098ドルへ下落しましたが、反発して高値1,156ドルをつけた後、再び下落しました。米FOMC(連邦公開市場委員会)を経て、あらためて年内の利上げ実施が示されたことで株価が下落し、金も反発したものの、世界最大の資源商社グレンコアの株価下落やドイツ自動車大手VWのスクandalから不透明感が強まり、下落圧力を受けました。

トウモロコシ相場は、上旬の安値から反発となりました。当初は小麦の軟調に追従したものの、米国でトウモロコシの収穫が始まり、生産高見通しが引き下げられたことから反発しました。ただ、豊作見通しは変わらず需給にひっ迫感はなく、ドル高による輸出競争力の低下、原油価格低迷でエタノール向け需要の増加も見込みにくいことから、月後半は伸び悩みました。

《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」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