

アセットライ

AT ADMINISTRATION (CAYMAN) LIMITED
作成日：2015年11月30日

2015年10月運用報告書(2015年10月1日～2015年10月31日)

純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：4.33%】

	設定時 (1999/2/1)	2015年6月末	2015年7月末	2015年8月末	2015年9月末	2015年10月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	1,866,883	1,887,543	1,670,731	1,703,976	1,725,803
月次騰落率	—	-5.25%	1.11%	-11.49%	1.99%	1.28%
設定来騰落率	—	86.69%	88.75%	67.07%	70.40%	72.58%

各セクターごとの損益

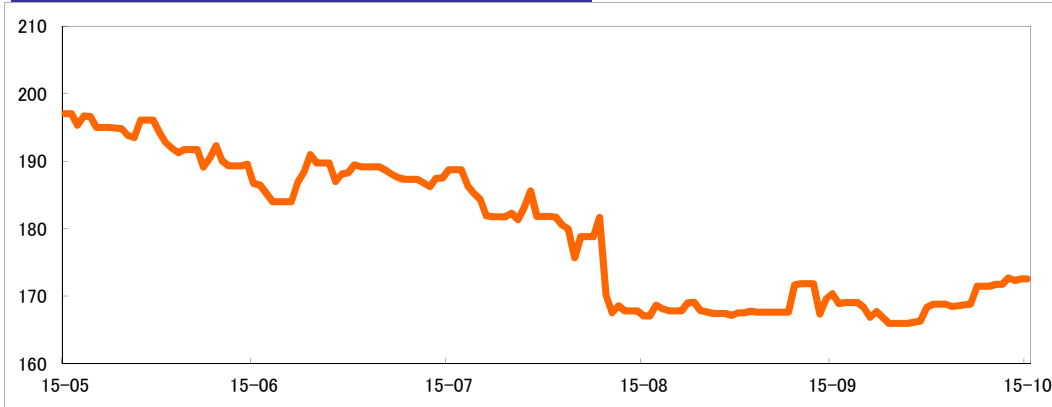
2015年10月の運用成績はプラスとなり、アセットライは前月比1.28%の利益となりました。

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。

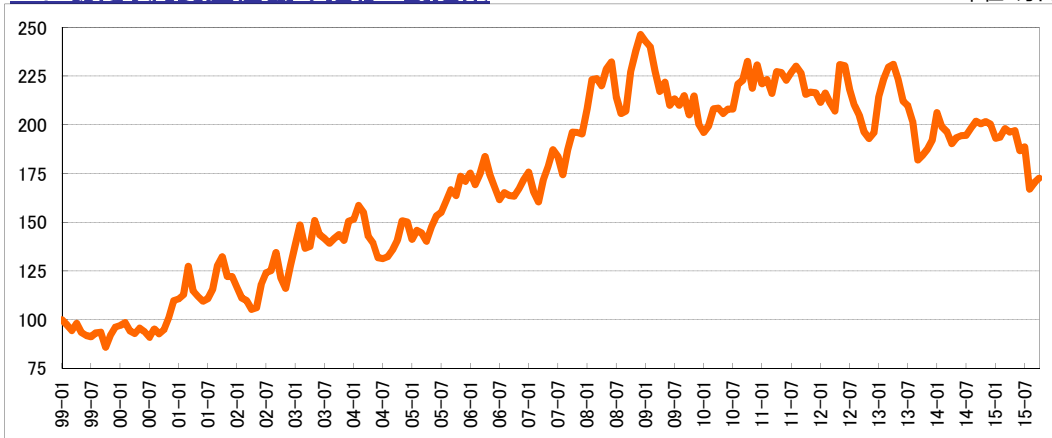
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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一時下落する場面も見られ、1ユーロ=1.15ドルに接近しました。しかし、欧州の追加緩和見通しと米国の利上げ開始見通しからドル高へと転じ、一時は1.09ドルまで上昇しました。また、対円では118円までの円高を経て再び、日銀の追加緩和に対する見方が強まると、経済対策が新たに発表されたことを受けて、121円超えまで円安が進みました。

主要国の短期金利は、ECB総裁が追加緩和を示唆したことからユーロではマイナス幅をわずかに拡大、円、ドルでは低水準での横ばいが続きました。長期金利は、ECBの追加緩和見込みからドイツ債では利回りが低下傾向。米国債利回りはおおむね横ばいだったものの、FOMCを経て12月利上げが意識されると月末には上昇しました。国内は低水準で概ね横ばい推移となりました。

主要国の株価指数は、四半期決算発表シーズンを迎え、主要企業の業績にはばらつきがみられるものの、新興国経済への不安が一服、TPPの大筋合意や、ECB総裁が追加緩和の可能性を示唆したことを支援に全般に堅調となりました。FOMCで12月利上げの可能性は上値を抑えましたが、米国経済の強さが意識され反落は限定的なものにとどまりました。

原油相場は、ブレントは当初の48ドル水準から、石油業界の投資縮小の一方、2016年の石油需要増加が見込まれ、一時54ドルへ急上昇しました。しかし、足元の需給は緩和しており、非加盟国も交えたOPECの専門家会議で減産協議が無かったとされたことやドル高から47ドル割れへ下落。月末には米国内の石油製品在庫減少を受けたWTI高に追随し50ドルへ反発しました。

金相場は当初の1,114ドルから1,190ドルへと上昇しましたが、再び下落しました。FOMCを経て、あらためて年内の米国利上げの可能性が示されたことから、ユーロ等主要通貨に対してドルが強含む動きとなりました。1,180ドル越えからはアジア実需も停滞する一方、短期的に投機買いが蓄積された反動で、強い下落圧力を受けました。

大豆相場は、米国での収穫進展が上値を抑える一方で、中国向け輸出成約の好調が下支えとなり、当初は880セント前後の保合となりました。米国の生産高予想が下方修正されると上昇し920セントに迫りました。しかし、中国経済の減速の影響が懸念されるほか、ブラジルでは過去最大の生産が見込まれ、世界需給は緩和傾向にあることから、月初の水準へ反落し越月しました。

《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10月31日時点)

評価日	2015/10/31
純資産価額	1,725,803 ...①

※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	201カ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,725,803	725,803	172.58%	4.33%
2	AT9902	1999/3/1	200カ月	1,000,000	975,824	1,024,775	1,768,559	768,559	172.86%	4.61%
3	AT9903	1999/4/1	199カ月	1,000,000	944,967	1,058,238	1,826,310	826,310	182.63%	4.98%
4	AT9904	1999/5/6	198カ月	1,000,000	982,246	1,018,074	1,756,995	756,995	175.70%	4.58%
5	AT9905	1999/6/1	197カ月	1,000,000	934,053	1,070,603	1,847,649	847,649	184.76%	5.16%
6	AT9906	1999/7/1	196カ月	1,000,000	919,230	1,087,867	1,877,444	877,444	187.74%	5.37%
7	AT9907	1999/8/2	195カ月	1,000,000	913,373	1,094,842	1,889,481	889,481	188.95%	5.47%
8	AT9908	1999/9/1	194カ月	1,000,000	932,896	1,071,930	1,849,940	849,940	184.99%	5.25%
9	AT9909	1999/10/1	193カ月	1,000,000	937,900	1,067,133	1,841,661	841,661	184.17%	5.23%
10	AT9910	1999/11/1	192カ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,009,638	1,009,638	200.96%	6.31%
11	AT9911	1999/12/1	191カ月	1,000,000	920,742	1,086,080	1,874,360	874,360	187.44%	5.49%
12	AT9912	2000/1/4	190カ月	1,000,000	962,909	1,083,519	1,927,279	927,279	192.73%	5.00%
13	AT2001	2000/2/1	189カ月	1,000,000	970,254	1,030,657	1,778,710	778,710	177.87%	4.94%
14	AT2002	2000/3/1	188カ月	1,000,000	985,675	1,014,533	1,750,884	750,884	175.09%	4.79%
15	AT2003	2000/4/3	187カ月	1,000,000	943,349	1,060,053	1,829,442	829,442	182.94%	5.32%
16	AT2004	2000/5/1	186カ月	1,000,000	930,228	1,075,005	1,855,246	855,246	185.52%	5.51%
17	AT2005	2000/6/1	185カ月	1,000,000	957,390	1,044,506	1,802,611	802,611	180.26%	5.20%
18	AT2006	2000/7/1	184カ月	1,000,000	939,723	1,064,143	1,836,501	836,501	183.65%	5.45%
19	AT2007	2000/8/1	183カ月	1,000,000	909,246	1,099,812	1,898,058	898,058	189.81%	5.88%
20	AT2008	2000/9/1	182カ月	1,000,000	953,190	1,049,108	1,810,553	810,553	181.06%	5.34%
21	AT2009	2000/10/1	181カ月	1,000,000	927,899	1,077,703	1,859,903	859,903	185.99%	5.70%
22	AT2010	2000/11/1	180カ月	1,000,000	948,711	1,054,061	1,819,101	819,101	181.91%	5.46%
23	AT2011	2000/12/1	179カ月	1,000,000	1,012,677	1,098,748	1,704,197	704,197	170.42%	4.72%
24	AT2012	2001/1/4	178カ月	1,000,000	1,099,531	1,090,478	1,569,579	569,579	156.96%	3.84%
25	AT2101	2001/2/1	177カ月	1,000,000	1,106,736	1,093,557	1,559,361	559,361	155.94%	3.79%
26	AT2102	2001/3/1	176カ月	1,000,000	1,128,441	1,088,178	1,529,368	529,368	152.94%	3.61%
27	AT2103	2001/4/2	175カ月	1,000,000	1,274,671	1,078,456	1,353,920	353,920	135.39%	2.43%
28	AT2104	2001/5/1	174カ月	1,000,000	1,148,518	1,070,687	1,502,634	502,634	150.26%	3.46%
29	AT2105	2001/6/1	173カ月	1,000,000	1,120,460	1,092,490	1,540,261	540,261	154.03%	3.74%
30	AT2106	2001/7/2	172カ月	1,000,000	1,095,410	1,091,290	1,575,485	575,485	157.55%	4.01%
31	AT2107	2001/8/1	171カ月	1,000,000	1,108,831	1,091,850	1,556,415	556,415	155.64%	3.90%
32	AT2108	2001/9/3	170カ月	1,000,000	1,156,883	1,064,391	1,491,768	491,768	149.18%	3.47%
33	AT2109	2001/10/1	169カ月	1,000,000	1,278,225	1,078,234	1,350,154	350,154	135.02%	2.48%
34	AT2110	2001/11/1	168カ月	1,000,000	1,323,490	1,075,578	1,303,978	303,978	130.40%	2.17%
35	AT2111	2001/12/3	167カ月	1,000,000	1,222,209	1,081,890	1,412,034	412,034	141.20%	2.96%
36	AT2112	2002/1/2	166カ月	1,000,000	1,221,883	1,081,840	1,412,410	412,410	141.24%	2.98%
37	AT2201	2002/2/1	165カ月	1,000,000	1,166,737	1,085,709	1,479,170	479,170	147.92%	3.48%
38	AT2202	2002/3/1	164カ月	1,000,000	1,111,645	1,089,567	1,552,475	552,475	155.25%	4.04%
39	AT2203	2002/4/1	163カ月	1,000,000	1,098,307	1,091,492	1,571,329	571,329	157.13%	4.20%
40	AT2204	2002/5/1	162カ月	1,000,000	1,053,547	1,094,914	1,638,087	638,087	163.81%	4.72%
41	AT2205	2002/6/3	161カ月	1,000,000	1,061,310	1,094,223	1,626,105	626,105	162.61%	4.66%
42	AT2206	2002/7/1	160カ月	1,000,000	1,182,603	1,045,592	1,459,325	459,325	145.93%	3.44%
43	AT2207	2002/8/1	159カ月	1,000,000	1,241,166	1,080,569	1,390,469	390,469	139.05%	2.94%
44	AT2208	2002/9/2	158カ月	1,000,000	1,251,288	1,079,176	1,379,220	379,220	137.92%	2.88%
45	AT2209	2002/10/1	157カ月	1,000,000	1,344,590	1,074,321	1,283,515	283,515	128.35%	2.17%
46	AT2210	2002/11/1	156カ月	1,000,000	1,216,142	1,082,272	1,419,079	419,079	141.91%	3.22%
47	AT2211	2002/12/2	155カ月	1,000,000	1,161,070	1,086,124	1,486,389	486,389	148.64%	3.76%
48	AT2212	2003/1/2	154カ月	1,000,000	1,278,691	1,078,049	1,349,662	349,662	134.97%	2.72%
49	AT2301	2003/2/3	153カ月	1,000,000	1,382,741	1,073,201	1,248,102	248,102	124.81%	1.94%
50	AT2302	2003/3/3	152カ月	1,000,000	1,485,812	1,073,032	1,161,520	161,520	116.15%	1.27%
51	AT2303	2003/4/1	151カ月	1,000,000	1,366,283	1,073,192	1,263,135	263,135	126.31%	2.09%
52	AT2304	2003/5/1	150カ月	1,000,000	1,377,293	1,072,061	1,253,038	253,038	125.30%	2.02%
53	AT2305	2003/6/2	149カ月	1,000,000	1,510,066	1,062,222	1,442,864	442,864	144.29%	1.15%
54	AT2306	2003/7/1	148カ月	1,000,000	1,436,823	1,069,579	1,201,122	201,122	120.11%	1.63%
55	AT2307	2003/8/1	147カ月	1,000,000	1,417,256	1,070,588	1,217,705	217,705	121.77%	1.78%
56	AT2308	2003/9/1	146カ月	1,000,000	1,392,804	1,071,796	1,239,085	239,085	123.91%	1.96%
57	AT2309	2003/10/1	145カ月	1,000,000	1,416,896	1,070,568	1,218,016	218,016	121.80%	1.87%
58	AT2310	2003/11/4	144カ月	1,000,000	1,436,951	1,069,597	1,201,015	201,015	120.10%	1.60%
59	AT2311	2003/12/1	143カ月	1,000,000	1,407,221	1,071,062	1,226,390	226,390	122.64%	1.90%
60	AT2312	2004/1/5	142カ月	1,000,000	1,506,668	1,063,716	1,145,443	145,443	114.54%	1.23%
61	AT2401	2004/2/2	141カ月	1,000,000	1,515,744	1,069,742	1,138,584	138,584	113.86%	1.18%
62	AT2402	2004/3/1	140カ月	1,000,000	1,587,195	1,063,042	1,087,328	87,328	108.73%	0.75%
63	AT2403	2004/4/1	139カ月	1,000,000	1,551,768	1,064,426	1,112,152	112,152	111.22%	0.97%
64	AT2404	2004/5/3	138カ月	1,000,000	1,429,064	1,069,758	1,207,644	207,644	120.76%	1.80%
65	AT2405	2004/6/1	137カ月	1,000,000	1,395,059	1,071,687	1,237,084	237,084	123.71%	2.08%
66	AT2406	2004/7/1	136カ月	1,000,000	1,318,409	1,075,849	1,309,002	309,002	130.90%	2.72%
67	AT2407	2004/8/2	135カ月	1,000,000	1,313,299	1,076,141	1,314,097	314,097	131.41%	2.79%
68	AT2408	2004/9/1	134カ月	1,000,000	1,323,584	1,075,518	1,303,875	303,875	130.39%	2.72%
69	AT2409	2004/10/1	133カ月	1,000,000	1,357,884	1,073,643	1,270,948	270,948	127.09%	2.44%
70	AT2410	2004/11/1	132カ月	1,000,000	1,408,023	1,072,015	1,225,691	225,691	122.57%	2.05%
71	AT2411	2004/12/1	131カ月	1,000,000	1,507,175	1,066,342	1,145,056	145,056	114.51%	1.33%
72	AT2412	2005/1/3	130カ月	1,000,000	1,500,722	1,066,345	1,149,980	149,980	115.00%	1.38%
73	AT2501	2005/2/1	129カ月	1,000,000	1,412,989	1,070,719	1,221,383	221,383	122.14%	2.06%
74	AT2502	2005/3/1	128カ月	1,000,000	1,459,169	1,068,521	1,182,729	182,729	118.27%	1.71%
75	AT2503	2005/4/1	127カ月	1,000,000	1,445,096	1,069,195	1,194,247	194,247	119.42%	1.83%

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	
76	AT2504	2005/5/2	126カ月	1,000,000	1,402,509	1,713,007	1,230,509	230,509	123.05%	2.19%
77	AT2505	2005/6/1	125カ月	1,000,000	1,478,317	1,674,444	1,167,409	167,409	116.74%	1.61%
78	AT2506	2005/7/1	124カ月	1,000,000	1,532,845	1,652,831	1,125,881	125,881	112.59%	1.22%
79	AT2507	2005/8/1	123カ月	1,000,000	1,551,175	1,644,672	1,112,576	112,576	111.26%	1.10%
80	AT2508	2005/9/1	122カ月	1,000,000	1,607,807	1,621,965	1,073,389	73,389	107.34%	0.72%
81	AT2509	2005/10/3	121カ月	1,000,000	1,666,428	1,600,085	1,035,628	35,628	103.56%	0.35%
82	AT2510	2005/11/1	120カ月	1,000,000	1,637,800	1,610,575	1,053,732	53,732	105.37%	0.54%
83	AT2511	2005/12/1	119カ月	1,000,000	1,735,801	1,576,102	994,238	-7,622	99.42%	-0.06%
84	AT2512	2006/1/2	118カ月	1,000,000	1,710,516	1,584,618	1,006,935	8,935	100.89%	0.09%
85	AT2601	2006/2/1	117カ月	1,000,000	1,752,235	1,570,969	984,914	-15,086	98.49%	-0.15%
86	AT2602	2006/3/1	116カ月	1,000,000	1,693,853	1,590,730	1,018,862	18,862	101.89%	0.19%
87	AT2603	2006/4/1								

「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