

アセットトライ

AT ADMINISTRATION (CAYMAN) LIMITED
作成日：2016年2月29日

2016年1月運用報告書(2016年1月1日～2016年1月31日)

純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：5.43%】

	設定時 (1999/2/1)	2015年9月末	2015年10月末	2015年11月末	2015年12月末	2016年1月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	1,703,976	1,725,803	1,782,192	1,803,307	1,922,758
月次騰落率	—	1.99%	1.28%	3.27%	1.18%	6.62%
設定来騰落率	—	70.40%	72.58%	78.22%	80.33%	92.28%

各セクターごとの損益

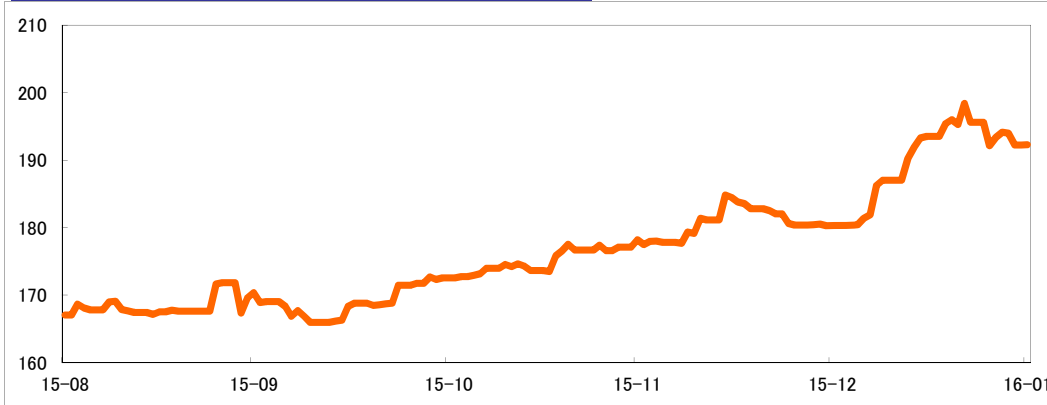
2016年1月の運用成績はプラスとなり、アセットトライは前月比6.62%の利益となりました。

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。

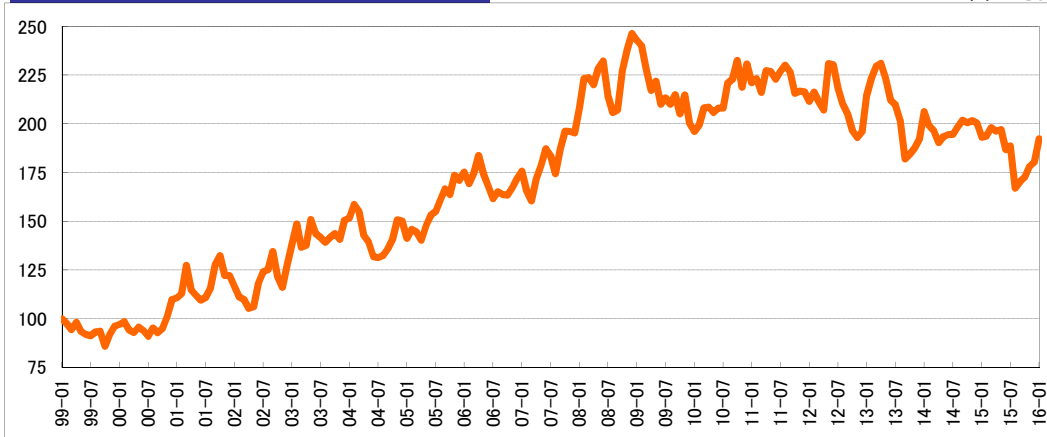
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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、米ドルが対円では120円での年明けとなり、当初は116円を割り込む円高場面も見られましたが、日銀への追加緩和期待が強まるにつれ円安方向に転換し、下旬の政策会合でマイナス金利の導入が決定されると121円を超える円安となりました。一方、ユーロは3月の追加緩和が見込まれる中であって方向感が定まらず、対ドルで1.07ドルを下値にほぼ横ばいの推移となりました。

主要国の短期金利は、ECBは金融政策を維持したものの追加緩和期待が強くユーロ圏ではマイナス金利を拡大、円は月末に日銀の追加緩和を受けて低下、ドルでは横ばいとなりました。長期金利は、年初から中国を起点として株式市場が連鎖的に急落し債券市場に資金が流入、さらに日銀、ECBの緩和姿勢や、米国の利上げペース鈍化予想もあって、全般に低下傾向となりました。

主要国の株価指数は、全般に軟調となりました。年初からの中国株急落を受けて連鎖的な株安となり、世界経済の減速懸念が原油需要の鈍化見通しにつながると原油安からエネルギー資源関連銘柄の下落、オイルマネーの本国還流も圧迫となりました。ただ、月後半には原油価格の急反発や企業の決算発表で業績の見直し、日銀の追加緩和で先進国市場を中心に反発しました。

原油相場は、ブレントが年初から中国株の急落からの連鎖的な株安で世界経済の減速、石油需要鈍化が懸念され、当初の37ドル台から一時27.1ドルへ急落しました。米国の原油輸出解禁、制裁解除によるイラン産原油の輸出再開で供給過剰感も圧迫要因となっていました。月後半にOPECとロシアの協調減産への期待が強まると反発に転じ、月末には35ドルを回復しました。

金相場は、当初の1,064ドルから上昇傾向となり、下旬高値の1,127ドルを経て1,117ドルを越月しました。12月のFOMC(米連邦公開市場委員会)で、米国金融政策は引き締めへと方針を転換したものの、続く1月FOMCでは景況見通しを下方修正し、2016年の引き締めペースが当初見通しより鈍化するとの見方から、金に対する関心が高まりました。

トウモロコシ相場は、当初の350セント台の横ばいから、下旬には370セントへ水準を切り上げました。アルゼンチン産トウモロコシの輸出拡大と南米通貨安、中国の在庫放出見通しを受けた下げが一服し、南アフリカの干ばつによる減産や原油高から急反発。ただ、米国トウモロコシの在庫水準は高く輸出も低調であり、小麦価格も低迷していることから次第に伸び悩みました。

《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 / 評価額一覧表(評価日: 2016年1月31日時点)

評価日	2016/1/31
純資産価額	1,922,758

※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	204ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,922,758	922,758	92.28%	5.42%
2	AT9902	1999/3/1	203ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	1,970,394	970,394	197.04%	5.73%
3	AT9903	1999/4/1	202ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	2,034,735	1,034,735	203.47%	6.14%
4	AT9904	1999/5/6	201ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	1,957,509	957,509	195.75%	5.71%
5	AT9905	1999/6/1	200ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	2,058,510	1,024,510	205.85%	6.35%
6	AT9906	1999/7/1	199ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	2,091,704	1,091,704	209.17%	6.58%
7	AT9907	1999/8/2	198ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,105,116	1,105,116	210.51%	6.69%
8	AT9908	1999/9/1	197ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	2,061,061	1,061,061	206.11%	6.46%
9	AT9909	1999/10/1	196ヵ月	1,000,000	937,900	1,067,133	2,051,838	1,051,838	205.18%	6.43%
10	AT9910	1999/11/1	195ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,238,986	1,238,986	223.90%	7.62%
11	AT9911	1999/12/1	194ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,080	2,088,269	1,088,269	208.83%	6.73%
12	AT9912	2000/1/4	193ヵ月	1,000,000	962,909	1,083,519	1,996,820	996,820	199.68%	6.19%
13	AT2001	2000/2/1	192ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	1,981,703	981,703	198.17%	6.13%
14	AT2002	2000/3/1	191ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	1,950,701	950,701	195.07%	5.97%
15	AT2003	2000/4/3	190ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	2,038,225	1,038,225	203.82%	6.55%
16	AT2004	2000/5/1	189ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	2,066,974	1,066,974	206.70%	6.77%
17	AT2005	2000/6/1	188ヵ月	1,000,000	957,390	1,044,506	2,008,332	1,008,332	200.83%	6.43%
18	AT2006	2000/7/1	187ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,143	2,046,089	1,046,089	204.61%	6.71%
19	AT2007	2000/8/1	186ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,812	2,114,672	1,114,672	211.47%	7.19%
20	AT2008	2000/9/1	185ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	2,017,180	1,017,180	201.72%	6.59%
21	AT2009	2000/10/1	184ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	2,072,162	1,072,162	207.22%	6.99%
22	AT2010	2000/11/1	183ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	2,026,704	1,026,704	202.67%	6.73%
23	AT2011	2000/12/1	182ヵ月	1,000,000	1,012,677	1,098,748	1,898,686	898,686	189.87%	5.92%
24	AT2012	2001/1/4	181ヵ月	1,000,000	1,099,531	1,090,478	1,748,706	748,706	174.87%	4.96%
25	AT2101	2001/2/1	180ヵ月	1,000,000	1,106,736	1,093,557	1,737,321	737,321	173.73%	4.91%
26	AT2102	2001/3/1	179ヵ月	1,000,000	1,128,441	1,088,178	1,703,905	703,905	170.39%	4.71%
27	AT2103	2001/4/2	178ヵ月	1,000,000	1,274,671	1,078,516	1,508,434	508,434	150.84%	3.42%
28	AT2104	2001/5/1	177ヵ月	1,000,000	1,148,518	1,067,687	1,674,120	674,120	167.41%	4.57%
29	AT2105	2001/6/1	176ヵ月	1,000,000	1,120,460	1,092,490	1,716,042	716,042	171.60%	4.88%
30	AT2106	2001/7/2	175ヵ月	1,000,000	1,095,410	1,091,290	1,755,285	755,285	175.53%	5.17%
31	AT2107	2001/8/1	174ヵ月	1,000,000	1,108,831	1,091,850	1,734,039	734,039	173.40%	5.06%
32	AT2108	2001/9/3	173ヵ月	1,000,000	1,156,883	1,064,391	1,662,014	662,014	166.20%	4.59%
33	AT2109	2001/10/1	172ヵ月	1,000,000	1,278,225	1,078,234	1,504,238	504,238	150.42%	3.52%
34	AT2110	2001/11/1	171ヵ月	1,000,000	1,323,490	1,075,578	1,452,793	452,793	145.28%	3.18%
35	AT2111	2001/12/3	170ヵ月	1,000,000	1,222,209	1,081,890	1,573,181	573,181	157.32%	4.04%
36	AT2112	2002/1/2	169ヵ月	1,000,000	1,221,883	1,081,840	1,573,600	573,600	157.36%	4.07%
37	AT2201	2002/2/1	168ヵ月	1,000,000	1,166,737	1,085,709	1,647,978	647,978	164.80%	4.63%
38	AT2202	2002/3/1	167ヵ月	1,000,000	1,111,645	1,089,567	1,729,649	729,649	172.96%	5.24%
39	AT2203	2002/4/1	166ヵ月	1,000,000	1,098,307	1,091,492	1,750,655	750,655	175.07%	5.42%
40	AT2204	2002/5/1	165ヵ月	1,000,000	1,053,547	1,094,914	1,825,031	825,031	182.50%	5.99%
41	AT2205	2002/6/3	164ヵ月	1,000,000	1,061,310	1,094,223	1,811,682	811,682	181.17%	5.93%
42	AT2206	2002/7/1	163ヵ月	1,000,000	1,182,603	1,084,592	1,625,868	625,868	162.59%	4.60%
43	AT2207	2002/8/1	162ヵ月	1,000,000	1,241,166	1,080,569	1,549,154	549,154	154.92%	4.06%
44	AT2208	2002/9/2	161ヵ月	1,000,000	1,251,288	1,079,176	1,536,622	536,622	153.66%	4.00%
45	AT2209	2002/10/1	160ヵ月	1,000,000	1,344,590	1,074,321	1,429,995	429,995	142.99%	3.22%
46	AT2210	2002/11/1	159ヵ月	1,000,000	1,216,142	1,082,272	1,581,030	581,030	158.10%	4.38%
47	AT2211	2002/12/2	158ヵ月	1,000,000	1,161,070	1,086,124	1,656,021	656,021	165.60%	4.98%
48	AT2212	2003/1/2	157ヵ月	1,000,000	1,278,691	1,078,049	1,503,690	503,690	150.37%	3.85%
49	AT2301	2003/2/3	156ヵ月	1,000,000	1,382,741	1,072,301	1,390,540	390,540	139.05%	3.00%
50	AT2302	2003/3/3	155ヵ月	1,000,000	1,485,812	1,073,032	1,294,077	294,077	129.41%	2.27%
51	AT2303	2003/4/1	154ヵ月	1,000,000	1,366,283	1,073,192	1,407,289	407,289	140.73%	3.17%
52	AT2304	2003/5/1	153ヵ月	1,000,000	1,377,293	1,072,601	1,396,039	396,039	139.60%	3.10%
53	AT2305	2003/6/2	152ヵ月	1,000,000	1,510,066	1,062,222	1,273,292	273,292	127.33%	2.16%
54	AT2306	2003/7/1	151ヵ月	1,000,000	1,436,823	1,069,579	1,338,199	338,199	133.82%	2.68%
55	AT2307	2003/8/1	150ヵ月	1,000,000	1,417,256	1,070,588	1,356,674	356,674	135.67%	2.85%
56	AT2308	2003/9/1	149ヵ月	1,000,000	1,392,804	1,071,796	1,380,494	380,494	138.05%	3.06%
57	AT2309	2003/10/1	148ヵ月	1,000,000	1,416,896	1,070,568	1,357,021	357,021	135.70%	2.89%
58	AT2310	2003/11/4	147ヵ月	1,000,000	1,436,951	1,069,517	1,338,079	338,079	133.81%	2.76%
59	AT2311	2003/12/1	146ヵ月	1,000,000	1,407,221	1,071,060	1,366,350	366,350	136.64%	3.01%
60	AT2312	2004/1/5	145ヵ月	1,000,000	1,506,668	1,063,716	1,276,165	276,165	127.62%	2.28%
61	AT2401	2004/2/2	144ヵ月	1,000,000	1,515,744	1,065,974	1,268,524	268,524	126.85%	2.24%
62	AT2402	2004/3/1	143ヵ月	1,000,000	1,587,195	1,030,042	1,211,418	211,418	121.14%	1.77%
63	AT2403	2004/4/1	142ヵ月	1,000,000	1,551,768	1,064,426	1,239,075	239,075	123.91%	2.02%
64	AT2404	2004/5/3	141ヵ月	1,000,000	1,429,064	1,069,758	1,345,465	345,465	134.55%	2.94%
65	AT2405	2004/6/1	140ヵ月	1,000,000	1,395,055	1,071,681	1,378,265	378,265	137.83%	3.24%
66	AT2406	2004/7/1	139ヵ月	1,000,000	1,318,409	1,075,849	1,458,390	458,390	145.84%	3.95%
67	AT2407	2004/8/2	138ヵ月	1,000,000	1,313,299	1,076,141	1,464,066	464,066	146.41%	4.03%
68	AT2408	2004/9/1	137ヵ月	1,000,000	1,323,594	1,075,518	1,452,678	452,678	145.27%	3.96%
69	AT2409	2004/10/1	136ヵ月	1,000,000	1,357,884	1,073,649	1,415,993	415,993	141.60%	3.67%
70	AT2410	2004/11/1	135ヵ月	1,000,000	1,408,023	1,072,151	1,365,571	365,571	136.56%	3.25%
71	AT2411	2004/12/1	134ヵ月	1,000,000	1,507,175	1,063,492	1,275,734	275,734	127.57%	2.47%
72	AT2412	2005/1/3	133ヵ月	1,000,000	1,500,722	1,066,345	1,281,220	281,220	128.12%	2.54%
73	AT2501	2005/2/1	132ヵ月	1,000,000	1,412,989	1,077,719	1,360,772	360,772	136.08%	3.28%
74	AT2502	2005/3/1	131ヵ月	1,000,000	1,459,169	1,085,321	1,317,706	317,706	131.77%	2.91%
75	AT2503	2005/4/1	130ヵ月	1,000,000	1,445,096	1,091,995	1,330,538	330,538	133.05%	3.05%

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	129ヵ月	1,000,000	1,402,509	1,713,007	1,370,939	370,939	137.09%	3.45%
77	AT2505	2005/6/1	128ヵ月	1,000,000	1,478,317	1,676,444	1,300,638	300,638	130.06%	2.82%
78	AT2506	2005/7/1	127ヵ月	1,000,000	1,532,845	1,652,381	1,254,370	254,370	125.44%	2.40%
79	AT2507	2005/8/1	126ヵ月	1,000,000	1,551,175	1,644,672	1,239,548	239,548	123.95%	2.28%
80	AT2508	2005/9/1	125ヵ月	1,000,000	1,607,807	1,621,965	1,195,888	195,888	119.59%	1.88%
81	AT2509	2005/10/3	124ヵ月	1,000,000	1,666,428	1,600,085	1,153,818	153,818	115.38%	1.49%
82	AT2510	2005/11/1	123ヵ月	1,000,000	1,637,800	1,605,075	1,173,987	173,987	117.40%	1.70%
83	AT2511	2005/12/1	122ヵ月	1,000,000	1,735,801	1,576,102	1,107,704	107,704	110.77%	1.08%
84	AT2512	2006/1/2	121ヵ月	1,000,000	1,710,516	1,584,618	1,124,078	124,078	112.41%	1.23%
85	AT2601	2006/2/1	120ヵ月	1,000,000	1,752,235	1,570,969	1,097,316	97,316	109.73%	0.97%
86	AT2602	2006/3/1	119ヵ月	1,000						

「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