

# アセットライ

AT ADMINISTRATION (CAYMAN) LIMITED

作成日：2016年7月29日

## 2016年6月運用報告書(2016年6月1日～2016年6月30日)

### 純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：6.02%】

	設定時 (1999/2/1)	2016年2月末	2016年3月末	2016年4月末	2016年5月末	2016年6月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	2,010,526	2,016,900	2,036,006	2,013,765	2,048,388
月次騰落率	—	4.56%	0.32%	0.95%	-1.09%	1.72%
設定来騰落率	—	101.05%	101.69%	103.60%	101.38%	104.84%

### 各セクターごとの損益

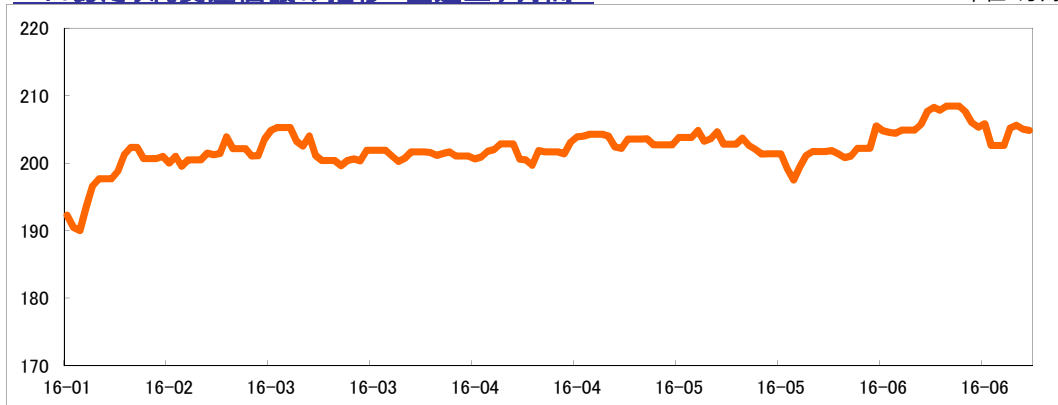
2016年6月の運用成績はプラスとなり、アセットライは前月比1.72%の利益となりました。

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。

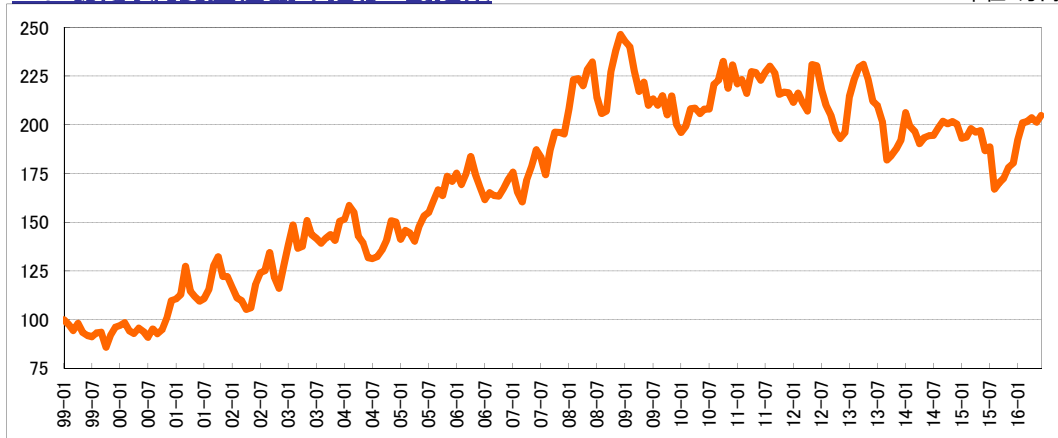
### 一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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、15日の米FOMCの利上げ見送りでドル安となったものの、23日の英国国民投票で予想外にEU離脱が決定すると一転して英ポンド安ユーロ安ドル高となりました。ドル円は当初の110円からの円高傾向が日銀の金融政策維持で加速。英国のEU離脱決定で欧州通貨が売られると一時99.08円へ急速な円高となりましたが、月末にかけては103円を回復しました。

主要国の短期金利は、ドル、円は多少の振れがあるもののおおむね横ばい。ユーロは若干のマイナス幅拡大となりました。長期金利は全般に低下傾向。英国国民投票に対し残留優勢との見方から一時的に上昇する場面もありましたが、EU離脱決定後は債券市場への資金流入で利回りは低下し、米国債、英国債で過去最低。ドイツ債の一部や国内ではマイナス幅が拡大しました。

主要国の株価指数は23日の英国国民投票を控える不透明感や、世界経済成長の減速見通しが上値抑制となる一方、米FOMCの利上げ見送りから反発もみられました。予想外のEU離脱決定では全般に急落しましたが、米国株が反発、英国株も追加緩和示唆から急反発し月初の水準を回復。一方でドイツ株、フランス株の反発は限定的、日本株は円高もあって水準を切り下げました。

原油相場は、ブレントは当初の50ドルから52.86ドルへ上昇しました。2日に開かれたOPEC総会で生産目標が棚上げされたほか、米国の石油掘削リグ稼働数増加で増産が見込まれ46ドル台へ反落。FOMCの利上げ見送りで51ドルへ反発したものの、23日の英国国民投票でEU離脱派が勝利し世界経済への不透明感が強まったことが上値を抑え、46～51ドルでの推移となりました。

金相場は、当初の1,210ドル水準から急伸しました。月初に発表された米国雇用指標が弱く米国の利上げ観測が後退、ドル安を支援に一時1,300ドルを達成。23日の英国国民投票に向けて残留に楽観的な見方から1,260ドル割れへ反落しましたが、予想外のEU離脱派勝利を受けリスク回避の金買いで急伸し、一時の1,350ドル超えを経て1,320ドル水準で越月しました。

トウモロコシ相場は、当初の404セントから上昇しました。ブラジル産地の干ばつによる減産見通しや、ラニーニャ現象発生予想による米国産地の高温乾燥懸念での上昇は440セントに届かず一服。英国国民投票を巡る金融市場全体のリスクオフや米国産地の乾燥改善から反落すると、月末には米国トウモロコシ作付面積上方修正発表を受けて360セント割れへ急落しました。

《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 法人事業部投資商品課

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6月30日時点)

評価日		2016/6/30		※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。							
純資産価額		2,048,388		※平均年率⑧=運用開始来騰落率÷(運用日数÷365)							
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	209ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	2,048,388	1,048,388	204.84%	6.02%	
2	AT9902	1999/3/1	208ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	2,099,136	1,099,136	209.91%	6.34%	
3	AT9903	1999/4/1	207ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	2,167,682	1,167,682	216.77%	6.76%	
4	AT9904	1999/5/6	206ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	2,085,410	1,085,410	208.54%	6.32%	
5	AT9905	1999/6/1	205ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	2,193,010	1,193,010	219.30%	6.98%	
6	AT9906	1999/7/1	204ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	2,228,373	1,228,373	222.83%	7.22%	
7	AT9907	1999/8/2	203ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,242,661	1,242,661	224.27%	7.34%	
8	AT9908	1999/9/1	202ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	2,195,728	1,195,728	219.57%	7.10%	
9	AT9909	1999/10/1	201ヵ月	1,000,000	937,900	1,067,133	2,185,902	1,185,902	218.59%	7.08%	
10	AT9910	1999/11/1	200ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,385,278	1,385,278	238.53%	8.31%	
11	AT9911	1999/12/1	199ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,080	2,224,713	1,224,713	222.47%	7.38%	
12	AT9912	2000/1/4	198ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	2,127,289	1,127,289	212.73%	6.83%	
13	AT2001	2000/2/1	197ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	2,111,185	1,111,185	211.12%	6.77%	
14	AT2002	2000/3/1	196ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	2,078,157	1,078,157	207.82%	6.60%	
15	AT2003	2000/4/3	195ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	2,171,399	1,171,399	217.14%	7.20%	
16	AT2004	2000/5/1	194ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	2,202,027	1,202,027	220.20%	7.43%	
17	AT2005	2000/6/1	193ヵ月	1,000,000	957,390	1,045,506	2,139,553	1,139,553	213.96%	7.08%	
18	AT2006	2000/7/1	192ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,143	2,179,777	1,179,777	217.98%	7.37%	
19	AT2007	2000/8/1	191ヵ月	1,000,000	909,246	1,098,812	2,252,841	1,252,841	225.28%	7.87%	
20	AT2008	2000/9/1	190ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	2,148,980	1,148,980	214.90%	7.25%	
21	AT2009	2000/10/1	189ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	2,207,553	1,207,553	220.76%	7.66%	
22	AT2010	2000/11/1	188ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	2,159,125	1,159,125	215.91%	7.40%	
23	AT2011	2000/12/1	187ヵ月	1,000,000	1,012,677	1,087,481	2,022,744	1,022,744	202.27%	6.56%	
24	AT2012	2001/1/4	186ヵ月	1,000,000	1,099,531	1,090,947	1,862,963	862,963	186.30%	5.57%	
25	AT2101	2001/2/1	185ヵ月	1,000,000	1,106,736	1,090,357	1,850,835	850,835	185.08%	5.52%	
26	AT2102	2001/3/1	184ヵ月	1,000,000	1,128,441	1,086,176	1,815,236	815,236	181.52%	5.31%	
27	AT2103	2001/4/2	183ヵ月	1,000,000	1,274,671	1,078,451	1,606,993	606,993	160.70%	3.98%	
28	AT2104	2001/5/1	182ヵ月	1,000,000	1,148,518	1,076,687	1,783,504	783,504	178.35%	5.16%	
29	AT2105	2001/6/1	181ヵ月	1,000,000	1,120,460	1,092,490	1,828,165	828,165	182.82%	5.49%	
30	AT2106	2001/7/2	180ヵ月	1,000,000	1,095,410	1,091,290	1,869,973	869,973	187.00%	5.80%	
31	AT2107	2001/8/1	179ヵ月	1,000,000	1,108,831	1,090,185	1,847,338	847,338	184.73%	5.68%	
32	AT2108	2001/9/3	178ヵ月	1,000,000	1,156,883	1,086,391	1,770,608	770,608	177.06%	5.19%	
33	AT2109	2001/10/1	177ヵ月	1,000,000	1,278,225	1,072,334	1,602,523	602,523	160.25%	4.08%	
34	AT2110	2001/11/1	176ヵ月	1,000,000	1,323,490	1,055,578	1,547,716	547,716	154.77%	3.73%	
35	AT2111	2001/12/3	175ヵ月	1,000,000	1,222,209	1,081,190	1,675,970	675,970	167.60%	4.63%	
36	AT2112	2002/1/2	174ヵ月	1,000,000	1,221,883	1,081,408	1,676,417	676,417	167.64%	4.66%	
37	AT2201	2002/1/1	173ヵ月	1,000,000	1,166,737	1,085,091	1,755,654	755,654	175.57%	5.24%	
38	AT2202	2002/3/1	172ヵ月	1,000,000	1,111,645	1,089,567	1,842,662	842,662	184.27%	5.87%	
39	AT2203	2002/4/1	171ヵ月	1,000,000	1,098,307	1,091,492	1,865,040	865,040	186.50%	6.07%	
40	AT2204	2002/5/1	170ヵ月	1,000,000	1,053,547	1,094,914	1,944,276	944,276	194.43%	6.66%	
41	AT2205	2002/6/3	169ヵ月	1,000,000	1,061,310	1,094,223	1,930,054	930,054	193.01%	6.60%	
42	AT2206	2002/7/1	168ヵ月	1,000,000	1,182,603	1,084,592	1,732,100	732,100	173.21%	5.23%	
43	AT2207	2002/8/1	167ヵ月	1,000,000	1,241,166	1,080,694	1,650,373	650,373	165.04%	4.67%	
44	AT2208	2002/9/2	166ヵ月	1,000,000	1,251,288	1,079,176	1,637,022	637,022	163.70%	4.60%	
45	AT2209	2002/10/1	165ヵ月	1,000,000	1,344,590	1,073,721	1,523,429	523,429	152.34%	3.80%	
46	AT2210	2002/11/1	164ヵ月	1,000,000	1,216,142	1,022,712	1,684,332	684,332	168.43%	5.00%	
47	AT2211	2002/12/2	163ヵ月	1,000,000	1,161,070	1,086,124	1,764,223	764,223	176.42%	5.62%	
48	AT2212	2003/1/2	162ヵ月	1,000,000	1,278,691	1,078,209	1,601,939	601,939	160.19%	4.46%	
49	AT2301	2003/2/3	161ヵ月	1,000,000	1,382,741	1,072,301	1,481,396	481,396	148.14%	3.59%	
50	AT2302	2003/3/3	160ヵ月	1,000,000	1,485,812	1,067,302	1,378,630	378,630	137.86%	2.84%	
51	AT2303	2003/4/1	159ヵ月	1,000,000	1,366,283	1,073,912	1,499,239	499,239	149.92%	3.76%	
52	AT2304	2003/5/1	158ヵ月	1,000,000	1,377,293	1,076,061	1,487,254	487,254	148.73%	3.70%	
53	AT2305	2003/6/2	157ヵ月	1,000,000	1,510,066	1,066,222	1,356,487	356,487	135.65%	2.72%	
54	AT2306	2003/7/1	156ヵ月	1,000,000	1,436,823	1,069,579	1,425,635	425,635	142.56%	3.27%	
55	AT2307	2003/8/1	155ヵ月	1,000,000	1,417,256	1,070,588	1,445,317	445,317	144.53%	3.45%	
56	AT2308	2003/9/1	154ヵ月	1,000,000	1,392,804	1,071,796	1,470,693	470,693	147.07%	3.67%	
57	AT2309	2003/10/1	153ヵ月	1,000,000	1,416,896	1,070,568	1,445,686	445,686	144.57%	3.49%	
58	AT2310	2003/11/4	152ヵ月	1,000,000	1,436,951	1,069,517	1,425,508	425,508	142.55%	3.36%	
59	AT2311	2003/12/1	151ヵ月	1,000,000	1,407,221	1,071,620	1,455,625	455,625	145.56%	3.62%	
60	AT2312	2004/1/5	150ヵ月	1,000,000	1,506,668	1,066,316	1,359,547	359,547	135.95%	2.87%	
61	AT2401	2004/2/2	149ヵ月	1,000,000	1,515,744	1,065,972	1,351,407	351,407	135.14%	2.83%	
62	AT2402	2004/3/1	148ヵ月	1,000,000	1,587,195	1,063,002	1,290,570	290,570	129.06%	2.35%	
63	AT2403	2004/4/1	147ヵ月	1,000,000	1,551,768	1,064,426	1,320,034	320,034	132.00%	2.61%	
64	AT2404	2004/5/3	146ヵ月	1,000,000	1,429,064	1,069,758	1,433,375	433,375	143.34%	3.56%	
65	AT2405	2004/6/1	145ヵ月	1,000,000	1,395,055	1,068,171	1,468,319	468,319	146.83%	3.87%	
66	AT2406	2004/7/1	144ヵ月	1,000,000	1,318,409	1,075,849	1,553,679	553,679	155.37%	4.61%	
67	AT2407	2004/8/2	143ヵ月	1,000,000	1,313,299	1,076,141	1,559,726	559,726	155.97%	4.69%	
68	AT2408	2004/9/1	142ヵ月	1,000,000	1,323,594	1,075,518	1,547,594	547,594	154.76%	4.63%	
69	AT2409	2004/10/1	141ヵ月	1,000,000	1,357,884	1,073,439	1,508,512	508,512	150.85%	4.33%	
70	AT2410	2004/11/1	140ヵ月	1,000,000	1,408,023	1,072,015	1,454,795	454,795	145.48%	3.90%	
71	AT2411	2004/12/1	139ヵ月	1,000,000	1,507,175	1,066,349	1,359,089	359,089	135.91%	3.10%	
72	AT2412	2005/1/3	138ヵ月	1,000,000	1,500,722	1,066,345	1,364,933	364,933	136.49%	3.17%	
73	AT2501	2005/2/1	137ヵ月	1,000,000	1,412,989	1,070,719	1,449,683	449,683	144.97%	3.94%	
74	AT2502	2005/3/1	136ヵ月	1,000,000	1,459,169	1,068,321	1,403,803	403,803	140.38%	3.56%	
75	AT2503	2005/4/1	135ヵ月	1,000,000	1,445,096	1,069,195	1,417,474	417,474	141.75%	3.71%	
76	AT2504	2005/5/2	134ヵ月	1,000,000	1,402,509	1,071,307	1,460,514	460,514	146.05%	4.12%	
77	AT2505	2005/6/1	133ヵ月	1,000,000	1,478,317	1,076,444	1,385,619	385,619	138.56%	3.48%	
78	AT2506	2005/7/1	132ヵ月	1,000,000	1,532,845	1,065,281	1,336,329	336,329	133.63%	3.06%	
79	AT2507	2005/8/1	131ヵ月	1,000,000	1,551,175	1,064,672	1,320,538	320,538	132.05%	2.93%	
80	AT2508	2005/9/1	130ヵ月	1,000,000	1,607,807	1,062,195	1,274,025	274,025	127.40%	2.53%	

※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	
81	AT2509	2005/10/3	129ヵ月	1,000,000	1,666,428	1,600,000	1,229,206	229,206	122.92%	2.13%
82	AT2510	2005/11/1	128ヵ月	1,000,000	1,637,800	1,601,075	1,250,694	250,694	125.07%	2.35%
83	AT2511	2005/12/1	127ヵ月	1,000,000	1,735,801	1,578,102	1,180,080	180,080	118.01%	1.70%
84	AT2512	2006/1/2	126ヵ月	1,000,000	1,710,516	1,584,618	1,197,524	197,524	119.75%	1.88%
85	AT2601	2006/2/1	125ヵ月	1,000,000	1,752,235	1,570,699	1,169,012	169,012	116.90%	1.62%
86	AT2602	2006/3/1	124ヵ月	1,000,000	1,693,853	1,590,370	1,209,306	209,306	120.93%	2.02%
87	AT2603	2006/4/1	123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