

アセットライ

AT ADMINISTRATION (CAYMAN) LIMITED
作成日：2016年8月31日

2016年7月運用報告書(2016年7月1日～2016年7月31日)

純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：5.97%】

	設定時 (1999/2/1)	2016年3月末	2016年4月末	2016年5月末	2016年6月末	2016年7月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	2,016,900	2,036,006	2,013,765	2,048,388	2,044,770
月次騰落率	—	0.32%	0.95%	-1.09%	1.72%	-0.18%
設定来騰落率	—	101.69%	103.60%	101.38%	104.84%	104.48%

各セクターごとの損益

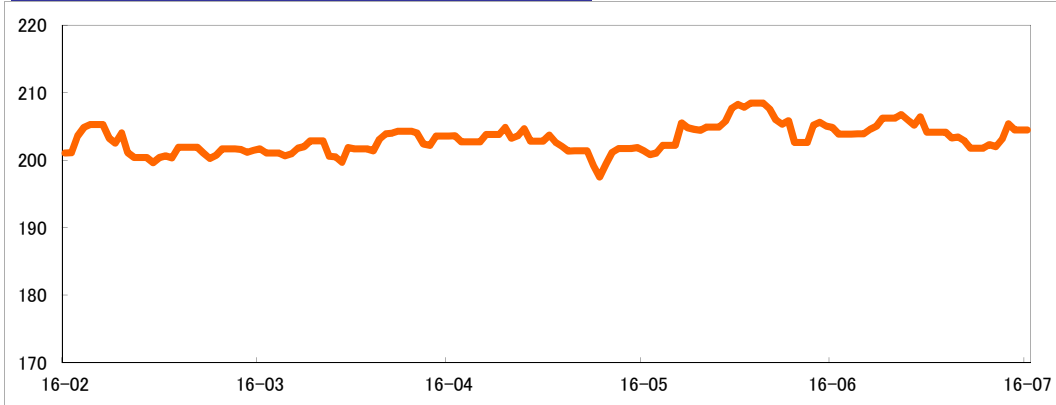
2016年7月の運用成績はマイナスとなり、アセットライは前月比0.18%の損失となりました。

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。

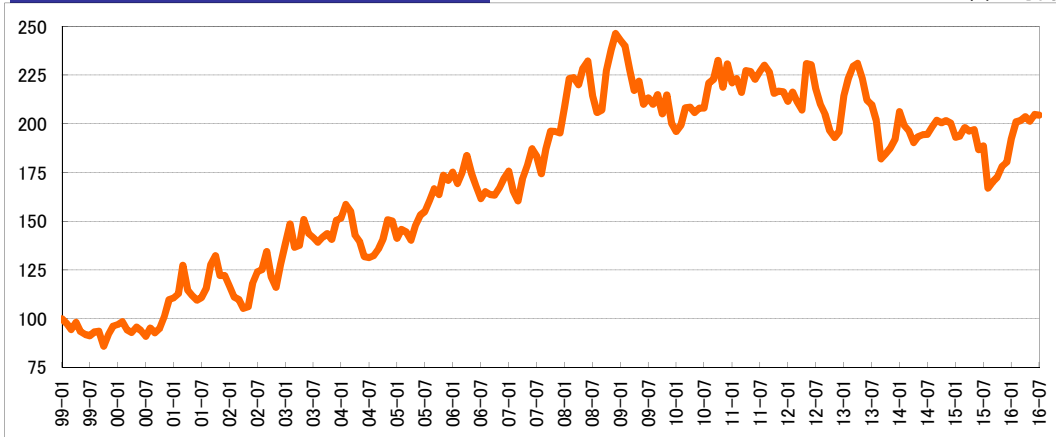
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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

ドル円は、当初の102円台から英国のEU離脱決定を受けた欧州通貨安円高で100円に接近。米国経済指標堅調で早期利上げが意識され、日銀の追加緩和期待もあって円安に転じ一時107円半ばを付けたが、月末の日銀会合では小規模な追加緩和にとどまったことで再度102円へ円高となりました。ユーロは6月の英国EU離脱を受けたユーロ安から下旬には反発しました。

主要国の短期金利は、年内利上げが意識されるドルで上昇傾向、円、ユーロはマイナス圏で概ね横ばいとなりました。長期金利は、英国EU離脱を受けた債券市場への資金流入が上旬で一服。欧米株式市場の堅調もあって中旬には上昇に転じましたが、米国の利上げ先送りから伸び悩みました。国内では過去最低を更新したものの、日銀追加緩和決定後はマイナス利回りが縮小しました。

主要国の株価指数は、全般に堅調となりました。英国のEU離脱決定を受けた混乱が一服。四半期決算シーズンを迎えるなかで、米国株主導で上昇し、NYダウでは過去最高値を更新、英FT100も年初来高値を更新。ただ、月末にかけては原油安を受けたエネルギー関連銘柄の下げに圧迫されました。日本株は荒い為替市場の動きを受けつつ、概ね横ばいで推移しました。

原油相場は、ブレントが当初の50ドル水準から月間を通して下落傾向となり、月末には一時42ドルを割り込みました。6月にかけての原油価格の上昇で米国の石油掘削リグ稼働数が増加に転じ、OPECの生産も高い水準を維持しているなかで、英国のEU離脱で世界経済の成長見通しが下方修正され、米国のガソリン需要も停滞したことから、供給過剰感が強まりました。

金相場は、英国のEU離脱決定を受けた世界経済の減速懸念で、当初の1,320ドル台から1,370ドル台へ上昇しました。ただ、米国の経済指標が堅調、株価もNYダウが過去最高値を更新するなかで9月利上げの可能性が意識され1,310ドル近辺へ反落。下旬FOMCを経て米国の利上げ観測が後退すると、欧州金融機関の健全性に対する不安もあって1,350ドルへ反発しました。

大豆相場は当初の1,170セントから下落傾向となりました。6月末の米農務省発表で米国の大豆作付面積が過去最大へと上方修正されると急落し、南米の大豆生産下方修正や米国産地の高温乾燥懸念で一時的な反発を交えながらも、生育は順調であり、豊作見通しが強まるにつれて1,000セント割れへ続落。ただ、輸出需要の堅調から期末には1,030セントを回復しました。

《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7月31日時点)

評価日		2016/7/31		※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。				※平均年率⑧＝運用開始来騰落率÷(運用日数÷365)					
純資産価額		2,044,770		…①									
契約コード	運用期間		運用開始時		評価日時点		投資単位 ②	純資産価額 ③	取得口数 ④	評価額(時価) ⑤=①×④	評価損益 ⑥=⑤-②	損益率 ⑦=⑥÷②	年率 ⑧
	運用開始日	期間(月)	純資産価額	取得口数	純資産価額	評価損益							
1	AT9901	1999/2/1	210ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	2,044.770	1,044.770	204.48%	5.97%			
2	AT9902	1999/3/1	209ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	2,095.429	1,095.429	209.54%	6.28%			
3	AT9903	1999/4/1	208ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	2,163.853	1,081.853	216.39%	6.71%			
4	AT9904	1999/5/6	207ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	2,081.727	1,081.727	208.17%	6.27%			
5	AT9905	1999/6/1	206ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	2,189.136	1,189.136	218.91%	6.92%			
6	AT9906	1999/7/1	205ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	2,224.437	1,224.437	222.44%	7.16%			
7	AT9907	1999/8/2	204ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,238,700	1,238,700	223.87%	7.28%			
8	AT9908	1999/9/1	203ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	2,191,850	1,191,850	219.19%	7.04%			
9	AT9909	1999/10/1	202ヵ月	1,000,000	937,090	1,067,133	2,182,041	1,182,041	218.20%	7.02%			
10	AT9910	1999/11/1	201ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,381,065	1,381,065	238.11%	8.24%			
11	AT9911	1999/12/1	200ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,080	2,220,783	1,220,783	222.08%	7.32%			
12	AT9912	2000/1/4	199ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	2,123,532	1,123,532	212.35%	6.77%			
13	AT2001	2000/2/1	198ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	2,107,456	1,107,456	210.75%	6.71%			
14	AT2002	2000/3/1	197ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	2,074,486	1,074,486	207.45%	6.54%			
15	AT2003	2000/4/3	196ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	2,167,564	1,167,564	216.76%	7.14%			
16	AT2004	2000/5/1	195ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	2,198,137	1,198,137	219.81%	7.37%			
17	AT2005	2000/6/1	194ヵ月	1,000,000	957,390	1,045,506	2,135,774	1,135,774	213.58%	7.02%			
18	AT2006	2000/7/1	193ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,143	2,175,927	1,175,927	217.59%	7.31%			
19	AT2007	2000/8/1	192ヵ月	1,000,000	909,246	1,098,812	2,248,862	1,248,862	224.89%	7.80%			
20	AT2008	2000/9/1	191ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	2,145,184	1,145,184	214.52%	7.19%			
21	AT2009	2000/10/1	190ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	2,203,654	1,203,654	220.37%	7.60%			
22	AT2010	2000/11/1	189ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	2,155,312	1,155,312	215.53%	7.33%			
23	AT2011	2000/12/1	188ヵ月	1,000,000	1,012,677	1,087,481	2,019,171	1,019,171	201.92%	6.50%			
24	AT2012	2001/1/4	187ヵ月	1,000,000	1,099,531	1,090,878	1,859,673	859,673	185.97%	5.51%			
25	AT2101	2001/2/1	186ヵ月	1,000,000	1,106,736	1,090,357	1,847,566	847,566	184.76%	5.47%			
26	AT2102	2001/3/1	185ヵ月	1,000,000	1,128,441	1,086,178	1,812,030	812,030	181.20%	5.26%			
27	AT2103	2001/4/2	184ヵ月	1,000,000	1,274,671	1,078,456	1,604,154	604,154	160.42%	3.94%			
28	AT2104	2001/5/1	183ヵ月	1,000,000	1,148,518	1,078,687	1,780,354	780,354	178.04%	5.11%			
29	AT2105	2001/6/1	182ヵ月	1,000,000	1,120,460	1,089,490	1,824,936	824,936	182.49%	5.44%			
30	AT2106	2001/7/2	181ヵ月	1,000,000	1,095,410	1,091,290	1,866,670	866,670	186.67%	5.74%			
31	AT2107	2001/8/1	180ヵ月	1,000,000	1,108,831	1,091,850	1,844,075	844,075	184.41%	5.62%			
32	AT2108	2001/9/3	179ヵ月	1,000,000	1,156,883	1,086,391	1,767,480	767,480	176.75%	5.14%			
33	AT2109	2001/10/1	178ヵ月	1,000,000	1,128,225	1,078,234	1,599,693	599,693	159.97%	4.04%			
34	AT2110	2001/11/1	177ヵ月	1,000,000	1,323,490	1,075,558	1,544,983	544,983	154.50%	3.69%			
35	AT2111	2001/12/3	176ヵ月	1,000,000	1,222,209	1,081,910	1,673,010	673,010	167.30%	4.59%			
36	AT2112	2002/1/2	175ヵ月	1,000,000	1,221,883	1,081,408	1,673,456	673,456	167.35%	4.62%			
37	AT2201	2002/2/1	174ヵ月	1,000,000	1,166,737	1,085,091	1,752,553	752,553	175.26%	5.19%			
38	AT2202	2002/3/1	173ヵ月	1,000,000	1,111,645	1,089,567	1,839,407	839,407	183.94%	5.82%			
39	AT2203	2002/4/1	172ヵ月	1,000,000	1,098,307	1,010,492	1,861,746	861,746	186.17%	6.01%			
40	AT2204	2002/5/1	171ヵ月	1,000,000	1,053,547	1,049,174	1,940,842	940,842	194.08%	6.60%			
41	AT2205	2002/6/3	170ヵ月	1,000,000	1,061,310	1,042,231	1,926,645	926,645	192.66%	6.54%			
42	AT2206	2002/7/1	169ヵ月	1,000,000	1,182,603	1,045,592	1,729,041	729,041	172.90%	5.17%			
43	AT2207	2002/8/1	168ヵ月	1,000,000	1,241,166	1,080,564	1,647,458	647,458	164.75%	4.62%			
44	AT2208	2002/9/2	167ヵ月	1,000,000	1,251,288	1,079,176	1,634,131	634,131	163.41%	4.55%			
45	AT2209	2002/10/1	166ヵ月	1,000,000	1,344,590	1,074,321	1,520,738	520,738	152.07%	3.76%			
46	AT2210	2002/11/1	165ヵ月	1,000,000	1,216,142	1,022,712	1,681,357	681,357	168.14%	4.95%			
47	AT2211	2002/12/2	164ヵ月	1,000,000	1,161,070	1,086,124	1,761,107	761,107	176.11%	5.56%			
48	AT2212	2003/1/2	163ヵ月	1,000,000	1,278,691	1,078,209	1,599,110	599,110	159.91%	4.41%			
49	AT2301	2003/2/3	162ヵ月	1,000,000	1,382,741	1,072,301	1,478,779	478,779	147.88%	3.54%			
50	AT2302	2003/3/3	161ヵ月	1,000,000	1,485,812	1,073,032	1,376,195	376,195	137.62%	2.80%			
51	AT2303	2003/4/1	160ヵ月	1,000,000	1,366,283	1,073,192	1,496,591	496,591	149.66%	3.72%			
52	AT2304	2003/5/1	159ヵ月	1,000,000	1,377,293	1,076,061	1,484,627	484,627	148.46%	3.65%			
53	AT2305	2003/6/2	158ヵ月	1,000,000	1,510,066	1,066,222	1,354,091	354,091	135.41%	2.69%			
54	AT2306	2003/7/1	157ヵ月	1,000,000	1,436,823	1,069,579	1,423,116	423,116	142.31%	3.23%			
55	AT2307	2003/8/1	156ヵ月	1,000,000	1,417,256	1,055,888	1,442,765	442,765	144.28%	3.40%			
56	AT2308	2003/9/1	155ヵ月	1,000,000	1,392,804	1,071,796	1,468,095	468,095	146.81%	3.62%			
57	AT2309	2003/10/1	154ヵ月	1,000,000	1,416,896	1,075,768	1,443,133	443,133	144.31%	3.45%			
58	AT2310	2003/11/4	153ヵ月	1,000,000	1,436,951	1,069,517	1,422,990	422,990	142.90%	3.32%			
59	AT2311	2003/12/1	152ヵ月	1,000,000	1,407,221	1,071,620	1,453,054	453,054	145.31%	3.57%			
60	AT2312	2004/1/5	151ヵ月	1,000,000	1,506,668	1,066,316	1,357,146	357,146	135.71%	2.84%			
61	AT2401	2004/2/2	150ヵ月	1,000,000	1,515,744	1,065,972	1,349,020	349,020	134.90%	2.79%			
62	AT2402	2004/3/1	149ヵ月	1,000,000	1,587,195	1,063,042	1,288,290	288,290	128.83%	2.32%			
63	AT2403	2004/4/1	148ヵ月	1,000,000	1,551,768	1,064,426	1,317,702	317,702	131.77%	2.57%			
64	AT2404	2004/5/3	147ヵ月	1,000,000	1,429,064	1,069,758	1,430,844	430,844	143.08%	3.51%			
65	AT2405	2004/6/1	146ヵ月	1,000,000	1,395,055	1,068,171	1,465,725	465,725	146.57%	3.83%			
66	AT2406	2004/7/1	145ヵ月	1,000,000	1,318,409	1,075,849	1,550,935	550,935	155.09%	4.56%			
67	AT2407	2004/8/2	144ヵ月	1,000,000	1,313,299	1,076,141	1,556,971	556,971	155.70%	4.64%			
68	AT2408	2004/9/1	143ヵ月	1,000,000	1,323,594	1,075,518	1,544,860	544,860	154.49%	4.57%			
69	AT2409	2004/10/1	142ヵ月	1,000,000	1,357,884	1,073,439	1,505,848	505,848	150.58%	4.27%			
70	AT2410	2004/11/1	141ヵ月	1,000,000	1,408,023	1,072,015	1,452,226	452,226	145.22%	3.85%			
71	AT2411	2004/12/1	140ヵ月	1,000,000	1,507,175	1,066,349	1,356,688	356,688	135.67%	3.06%			
72	AT2412	2005/1/3	139ヵ月	1,000,000	1,500,722	1,066,345	1,362,522	362,522	136.25%	3.13%			
73	AT2501	2005/2/1	138ヵ月	1,000,000	1,412,989	1,070,719	1,447,122	447,122	144.71%	3.89%			
74	AT2502	2005/3/1	137ヵ月	1,000,000	1,459,169	1,068,521	1,401,323	401,323	140.13%	3.51%			
75	AT2503	2005/4/1	136ヵ月	1,000,000	1,445,096	1,069,195	1,414,970	414,970	141.50%	3.66%			
76	AT2504	2005/5/2	135ヵ月	1,000,000	1,402,509	1,071,307	1,457,935	457,935	145.79%	4.07%			
77	AT2505	2005/6/1	134ヵ月	1,000,000	1,478,317	1,076,444	1,383,172	383,172	138.32%	3.43%			
78	AT2506	2005/7/1	133ヵ月	1,000,000	1,532,845	1,065,281	1,333,969	333,969	133.40%	3.01%			
79	AT2507	2005/8/1	132ヵ月	1,000,000	1,551,175	1,064,672	1,318,205	318,205	131.82%	2.89%			
80	AT2508	2005/9/1	131ヵ月	1,000,000	1,607,807	1,062,195	1,271,775	271,775	127.18%	2.49%			

※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		投資単位 ②	純資産価額 ③	取得口数 ④	評価額(時価) ⑤=①×④	評価損益 ⑥=⑤-②	損益率 ⑦=⑥÷②	年率 ⑧
	運用開始日	期間(月)	純資産価額	取得口数	純資産価額	評価損益							
81	AT2509	2005/10/3	130ヵ月	1,000,000	1,666,428	1,600,000	2,277,035	1,277,035	227.03%	2.09%			
82	AT2510	2005/11/1	129ヵ月	1,000,000	1,637,800	1,601,075	2,248,485	1,248,485	224.85%	2.31%			
83	AT2511	2005/12/1	128ヵ月	1,000,000	1,735,801	1,576,102	2,177,996	1,177,996	217.80%	1.67%			
84	AT2512	2006/1/2	127ヵ月	1,000,000	1,710,516	1,584,618	2,195,409	1,195,409	219.54%	1.85%			
85	AT2601	2006/2/1	126ヵ月	1,000,000	1,752,235	1,506,999	2,166,948	1,166,948	216.69%	1.59%			
86	AT2602	2006/3/1	125ヵ月	1,000,000	1,693,853	1,590,370	2,127,170	1,127,170	212.72%	1.99%			
87													

「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