

アセットライ

AT ADMINISTRATION (CAYMAN) LIMITED
作成日：2016年11月30日

2016年10月運用報告書(2016年10月1日～2016年10月31日)

純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：4.75%】

	設定時 (1999/2/1)	2016年6月末	2016年7月末	2016年8月末	2016年9月末	2016年10月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	2,048,388	2,044,770	1,968,330	1,951,160	1,843,987
月次騰落率	—	1.72%	-0.18%	-3.74%	-0.87%	-5.49%
設定来騰落率	—	104.84%	104.48%	96.83%	95.12%	84.40%

各セクターごとの損益

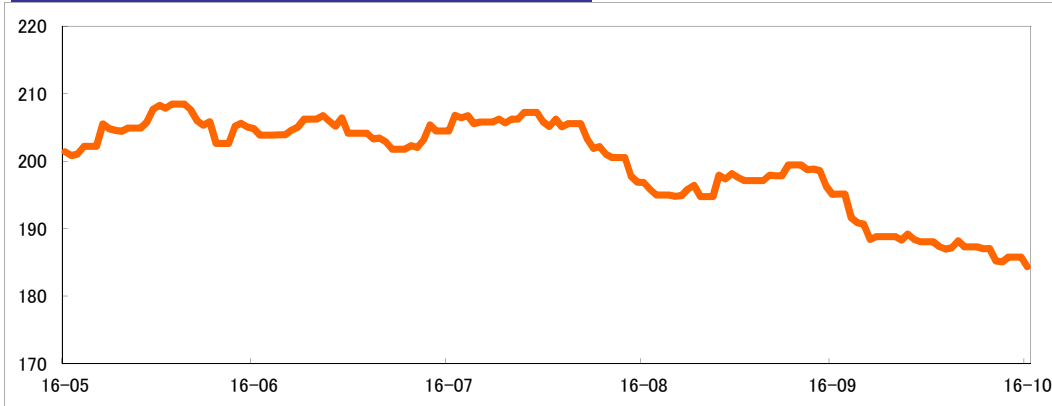
2016年10月の運用成績はマイナスとなり、アセットライは前月比5.49%の損失となりました。

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。

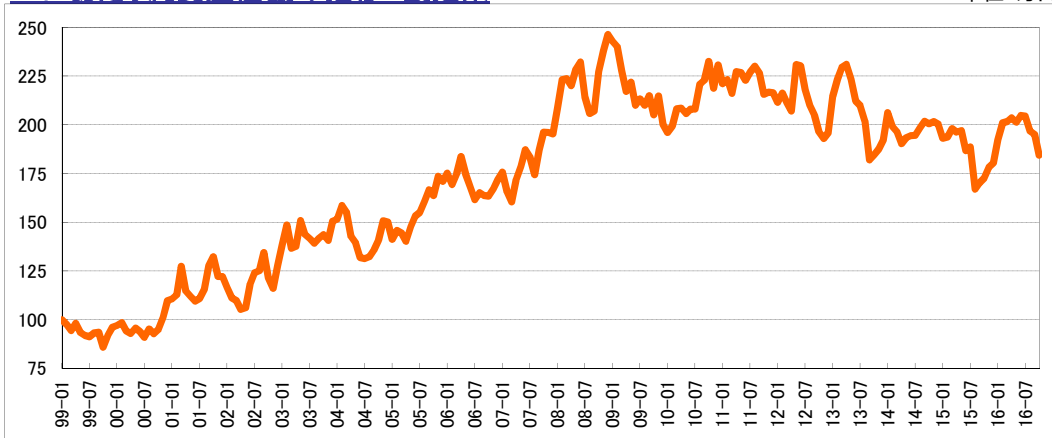
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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

為替は、ドル円は当初の101円から円安傾向となりました。米国の12月利上げ見通しが強まり、ドルは全面高。米大統領選でのクリントン候補優勢もドル高要因となり、一時105.53円へ円安となりました。しかし、月末には同候補のメール問題再捜査の報道を受けて米大統領選の不透明感が強まり、日欧の追加緩和見通し後退もあってドル売りに転じ、105円割れで越月しました。

主要国の短期金利は、利上げが見込まれるドルでわずかに上昇する一方、金融政策を据え置いた円、ユーロではほぼ横ばいとなりました。長期金利は、米国では12月利上げが見込まれ、日銀は9月の政策目標の変更を受けて国債購入が縮小しており、欧州でも緩和縮小見通しが強まるなか、欧米の主要国債利回りは全体に上昇傾向。国内ではマイナス圏での小動きが続きました。

主要国の株価指数は、おおむね横ばい。米国株は12月利上げ見通しやドル高による一部製造業への悪影響、大統領選を控えた政治的不透明感から伸び悩み。欧州もECB総裁の緩和縮小否定は下支えながら、主要企業の決算発表は強弱が混じり方向感定まらず。ただ、国内では、円安を背景に輸出企業の業績改善が見込まれ、日経平均株価は月間を通して上昇傾向となりました。

原油相場は、ブレントは当初の50ドルから一時53.73ドルと年初来高値へ上昇しました。9月末にOPECが減産で合意し、ロシアなど非加盟産油国も生産調整に協調する姿勢を示したことから上昇。ただ、実際の生産枠についての協議が進まず、減産の実現に対し懐疑的な見方が広がったほか、米国の増産見通しやドル高も圧迫となり、月末には48ドル割れへ下落しました。

金相場は、米国の12月利上げ観測を背景としたドル高や、ECBの緩和縮小見通しを受け、当初の1,310ドル台から一時1,250ドル割れへ急落しました。しかし、ECBが緩和的な姿勢を維持したほか、11月の米国大統領選を控え政治的不透明感が強まると、金への投機的な関心が強まり、ドル安も支援となって反発。インドなどの実需の回復傾向も下支えとなり1,270ドルを回復しました。

大豆相場は、当初の950セント水準から上昇傾向となりました。米国の記録的豊作を織り込んだ安値から、収穫が進むにつれて中国向け輸出の好調など需要面の強さが見直され反発。米利上げ観測を背景としたドル高圧力が次第に後退すると、下旬には一時1,020セントまで上昇しました。しかし、南米産地の増産予想もあって月末には1,000セント割れへ反落しました。

《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10月31日時点)

評価日		2016/10/31		※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		1,843,987									
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	213ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,843,987	843,987	184.40%	4.75%	
2	AT9902	1999/3/1	212ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	1,889,671	889,671	188.97%	5.03%	
3	AT9903	1999/4/1	211ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	1,951,377	951,377	195.14%	5.41%	
4	AT9904	1999/5/6	210ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	1,877,315	877,315	187.73%	5.01%	
5	AT9905	1999/6/1	209ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	1,974,178	974,178	197.42%	5.59%	
6	AT9906	1999/7/1	208ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	2,006,012	1,006,012	200.60%	5.80%	
7	AT9907	1999/8/2	207ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,018,874	1,018,874	201.89%	5.90%	
8	AT9908	1999/9/1	206ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	1,976,624	976,624	197.66%	5.68%	
9	AT9909	1999/10/1	205ヵ月	1,000,000	937,090	1,067,133	1,967,779	967,779	196.78%	5.66%	
10	AT9910	1999/11/1	204ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,147,260	1,147,260	214.73%	6.74%	
11	AT9911	1999/12/1	203ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,080	2,002,717	1,002,717	200.27%	5.92%	
12	AT9912	2000/1/4	202ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	1,915,015	915,015	191.50%	5.43%	
13	AT2001	2000/2/1	201ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	1,900,518	900,518	190.05%	5.37%	
14	AT2002	2000/3/1	200ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	1,870,785	870,785	187.08%	5.22%	
15	AT2003	2000/4/3	199ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	1,954,723	954,723	195.47%	5.75%	
16	AT2004	2000/5/1	198ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	1,982,295	982,295	198.23%	5.95%	
17	AT2005	2000/6/1	197ヵ月	1,000,000	957,390	1,045,506	1,926,055	926,055	192.61%	5.64%	
18	AT2006	2000/7/1	196ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,143	1,962,265	962,265	196.23%	5.89%	
19	AT2007	2000/8/1	195ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,812	2,028,039	1,028,039	202.80%	6.32%	
20	AT2008	2000/9/1	194ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	1,934,541	934,541	193.45%	5.78%	
21	AT2009	2000/10/1	193ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	1,987,270	987,270	198.73%	6.13%	
22	AT2010	2000/11/1	192ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	1,943,674	943,674	194.37%	5.89%	
23	AT2011	2000/12/1	191ヵ月	1,000,000	1,012,677	1,087,481	1,820,902	820,902	182.09%	5.15%	
24	AT2012	2001/1/4	190ヵ月	1,000,000	1,099,531	1,090,478	1,677,065	677,065	167.71%	4.27%	
25	AT2101	2001/2/1	189ヵ月	1,000,000	1,106,736	1,903,557	1,666,147	666,147	166.61%	4.23%	
26	AT2102	2001/3/1	188ヵ月	1,000,000	1,128,441	1,886,178	1,634,100	634,100	163.41%	4.04%	
27	AT2103	2001/4/2	187ヵ月	1,000,000	1,274,671	1,784,516	1,446,637	446,637	144.66%	2.86%	
28	AT2104	2001/5/1	186ヵ月	1,000,000	1,148,518	1,870,687	1,605,535	605,535	160.55%	3.90%	
29	AT2105	2001/6/1	185ヵ月	1,000,000	1,120,460	1,892,490	1,645,739	645,739	164.57%	4.18%	
30	AT2106	2001/7/2	184ヵ月	1,000,000	1,095,410	1,912,900	1,683,735	683,735	168.34%	4.45%	
31	AT2107	2001/8/1	183ヵ月	1,000,000	1,108,831	1,901,850	1,662,999	662,999	166.30%	4.34%	
32	AT2108	2001/9/3	182ヵ月	1,000,000	1,156,883	1,864,391	1,593,925	593,925	159.39%	3.91%	
33	AT2109	2001/10/1	181ヵ月	1,000,000	1,278,225	1,782,334	1,442,613	442,613	144.26%	2.93%	
34	AT2110	2001/11/1	180ヵ月	1,000,000	1,323,490	1,755,578	1,393,276	393,276	139.33%	2.62%	
35	AT2111	2001/12/3	179ヵ月	1,000,000	1,222,209	1,818,190	1,508,731	508,731	150.87%	3.41%	
36	AT2112	2002/1/2	178ヵ月	1,000,000	1,221,883	1,818,408	1,509,133	509,133	150.91%	3.43%	
37	AT2201	2002/2/1	177ヵ月	1,000,000	1,166,737	1,857,091	1,580,464	580,464	158.05%	3.93%	
38	AT2202	2002/3/1	176ヵ月	1,000,000	1,111,645	1,899,567	1,658,789	658,789	165.88%	4.49%	
39	AT2203	2002/4/1	175ヵ月	1,000,000	1,098,307	1,910,492	1,678,935	678,935	167.89%	4.65%	
40	AT2204	2002/5/1	174ヵ月	1,000,000	1,053,547	1,949,174	1,750,264	750,264	175.03%	5.17%	
41	AT2205	2002/6/3	173ヵ月	1,000,000	1,061,310	1,942,231	1,737,461	737,461	173.75%	5.11%	
42	AT2206	2002/7/1	172ヵ月	1,000,000	1,182,603	1,845,592	1,559,260	559,260	155.93%	3.90%	
43	AT2207	2002/8/1	171ヵ月	1,000,000	1,241,166	1,805,694	1,485,689	485,689	148.57%	3.41%	
44	AT2208	2002/9/2	170ヵ月	1,000,000	1,251,288	1,799,176	1,473,670	473,670	147.37%	3.34%	
45	AT2209	2002/10/1	169ヵ月	1,000,000	1,344,590	1,743,721	1,371,411	371,411	137.14%	2.63%	
46	AT2210	2002/11/1	168ヵ月	1,000,000	1,216,142	1,822,712	1,516,258	516,258	151.63%	3.68%	
47	AT2211	2002/12/2	167ヵ月	1,000,000	1,161,070	1,861,274	1,588,178	588,178	158.82%	4.22%	
48	AT2212	2003/1/2	166ヵ月	1,000,000	1,278,691	1,782,049	1,442,088	442,088	144.21%	3.19%	
49	AT2301	2003/2/3	165ヵ月	1,000,000	1,382,741	1,723,201	1,333,573	333,573	133.36%	2.42%	
50	AT2302	2003/3/3	164ヵ月	1,000,000	1,485,812	1,673,032	1,241,062	241,062	124.11%	1.76%	
51	AT2303	2003/4/1	163ヵ月	1,000,000	1,366,283	1,731,912	1,349,636	349,636	134.96%	2.57%	
52	AT2304	2003/5/1	162ヵ月	1,000,000	1,377,293	1,726,061	1,338,847	338,847	133.88%	2.51%	
53	AT2305	2003/6/2	161ヵ月	1,000,000	1,510,066	1,662,222	1,221,128	221,128	122.11%	1.65%	
54	AT2306	2003/7/1	160ヵ月	1,000,000	1,436,823	1,695,979	1,283,376	283,376	128.34%	2.12%	
55	AT2307	2003/8/1	159ヵ月	1,000,000	1,417,256	1,705,588	1,301,095	301,095	130.11%	2.27%	
56	AT2308	2003/9/1	158ヵ月	1,000,000	1,392,804	1,717,976	1,323,938	323,938	132.39%	2.46%	
57	AT2309	2003/10/1	157ヵ月	1,000,000	1,416,896	1,705,768	1,301,427	301,427	130.14%	2.30%	
58	AT2310	2003/11/4	156ヵ月	1,000,000	1,436,951	1,695,917	1,283,261	283,261	128.33%	2.18%	
59	AT2311	2003/12/1	155ヵ月	1,000,000	1,407,221	1,710,620	1,310,374	310,374	131.04%	2.40%	
60	AT2312	2004/1/5	154ヵ月	1,000,000	1,506,668	1,663,716	1,223,883	223,883	122.39%	1.74%	
61	AT2401	2004/2/2	153ヵ月	1,000,000	1,515,744	1,659,742	1,216,555	216,555	121.66%	1.70%	
62	AT2402	2004/3/1	152ヵ月	1,000,000	1,587,195	1,630,042	1,161,789	161,789	116.18%	1.28%	
63	AT2403	2004/4/1	151ヵ月	1,000,000	1,551,768	1,644,426	1,188,313	188,313	118.83%	1.50%	
64	AT2404	2004/5/3	150ヵ月	1,000,000	1,429,064	1,699,758	1,290,344	290,344	129.03%	2.32%	
65	AT2405	2004/6/1	149ヵ月	1,000,000	1,395,055	1,716,817	1,321,801	321,801	132.18%	2.59%	
66	AT2406	2004/7/1	148ヵ月	1,000,000	1,318,409	1,758,489	1,398,643	398,643	139.86%	3.23%	
67	AT2407	2004/8/2	147ヵ月	1,000,000	1,313,299	1,761,441	1,404,087	404,087	140.41%	3.30%	
68	AT2408	2004/9/1	146ヵ月	1,000,000	1,323,594	1,755,518	1,393,165	393,165	139.32%	3.23%	
69	AT2409	2004/10/1	145ヵ月	1,000,000	1,357,884	1,736,439	1,357,983	357,983	135.80%	2.96%	
70	AT2410	2004/11/1	144ヵ月	1,000,000	1,408,023	1,710,215	1,309,627	309,627	130.96%	2.58%	
71	AT2411	2004/12/1	143ヵ月	1,000,000	1,507,175	1,663,492	1,223,470	223,470	122.35%	1.87%	
72	AT2412	2005/1/3	142ヵ月	1,000,000	1,500,722	1,666,345	1,228,731	228,731	122.87%	1.93%	
73	AT2501	2005/2/1	141ヵ月	1,000,000	1,412,989	1,707,719	1,305,024	305,024	130.50%	2.59%	
74	AT2502	2005/3/1	140ヵ月	1,000,000	1,459,169	1,685,321	1,263,723	263,723	126.37%	2.26%	
75	AT2503	2005/4/1	139ヵ月	1,000,000	1,445,096	1,691,995	1,276,029	276,029	127.60%	2.38%	
76	AT2504	2005/5/2	138ヵ月	1,000,000	1,402,509	1,713,007	1,314,775	314,775	131.48%	2.73%	
77	AT2505	2005/6/1	137ヵ月	1,000,000	1,478,317	1,676,444	1,247,353	247,353	124.74%	2.16%	
78	AT2506	2005/7/1	136ヵ月	1,000,000	1,532,845	1,652,381	1,202,982	202,982	120.30%	1.79%	
79	AT2507	2005/8/1	135ヵ月	1,000,000	1,551,175	1,646,672	1,188,766	188,766	118.88%	1.68%	
80	AT2508	2005/9/1	134ヵ月	1,000,000	1,607,807	1,621,965	1,146,895	146,895	114.69%	1.31%	

※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					
契約コード	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
81	AT2509	2005/10/3	133ヵ月	1,000,000	1,666,428	1,600,000	1,106,548	106,548	110.65%	0.96%	
82	AT2510	2005/11/1	132ヵ月	1,000,000	1,637,800	1,610,000	1,125,892	125,892	112.59%	1.14%	
83	AT2511	2005/12/1	131ヵ月	1,000,000	1,735,801	1,658,000	1,262,324	262,324	126.23%	0.57%	
84	AT2512	2006/1/2	130ヵ月	1,000,000	1,710,516	1,680,000	1,278,027	278,027	127.80%	0.72%	
85	AT2601	2006/2/1	129ヵ月	1,000,000	1,752,235	1,650,000	1,322,361	322,361	132.24%	0.49%	
86	AT2602	2006/3/1	128ヵ月	1,000,000	1,693,853	1,630,000	1,388,634	388,634	138.86%	0.83%	
87	AT2603	2006/4/1	127ヵ月	1,000,000	1,747,442	1,620,000	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