

アセットトライ

AT ADMINISTRATION (CAYMAN) LIMITED

作成日：2017年2月28日

2017年1月運用報告書(2017年1月1日～2017年1月31日)

純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：4.27%】

	設定時 (1999/2/1)	2016年9月末	2016年10月末	2016年11月末	2016年12月末	2017年1月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	1,951,160	1,843,987	1,810,316	1,862,765	1,768,708
月次騰落率	—	-0.87%	-5.49%	-1.83%	2.90%	-5.05%
設定来騰落率	—	95.12%	84.40%	81.03%	86.28%	76.87%

各セクターごとの損益

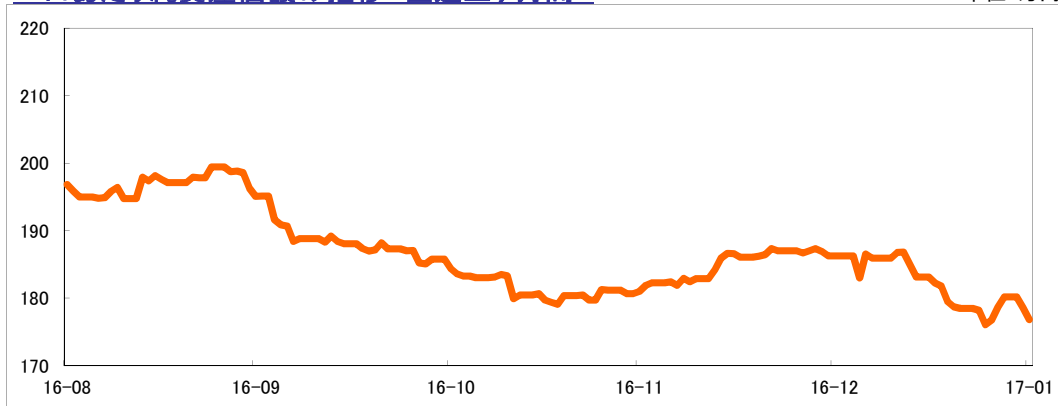
2017年1月の運用成績はマイナスとなり、アセットトライは前月比5.05%の損失となりました。

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。

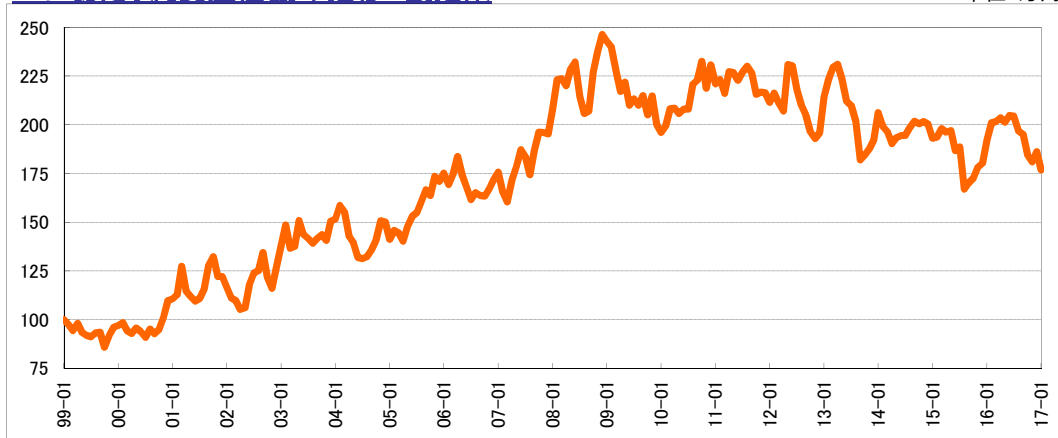
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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、当初の117円から一時118円に乗せたものの、月間を通しては円高傾向となりました。米国のトランプ新政権のドル高牽制発言を受けて全般にドル安が進展。月末には日銀の金融政策維持を確認し、貿易収支の黒字定着もあって112円に接近しました。ユーロドルはインフレ見通しの上昇もあって、当初の1.04ドルから月末には1.08ドルへユーロ高となりました。

主要国の短期金利は、ECB、日銀が金融政策を維持するなか、ユーロは横ばい、円では小幅に上昇。米国では緩やかな金利引き上げスタンスを確認し、わずかに上昇しました。長期金利は米国債利回りの上昇が一服し横ばい気味となる一方、英国債、ドイツ債ではインフレ見通しの上昇もあって上昇傾向。国内ではデフレ傾向が持続しており、低水準での横ばいが続きました。

主要国の株価指数は、概ね横ばいとなりました。昨年未まで上昇を牽引していた米国株は、トランプ新政権の政策がTPP離脱やNAFTA見直しの一方、規制緩和を進めるなど、強弱混じることからNYダウは伸び悩んだものの月後半には初の2万ドルを達成。欧州株、日本株はドル牽制発言を受けた通貨高で輸出企業への影響が懸念されながらも、概ね横ばい推移となりました。

原油相場は、ブレントは当初の58.37ドルを高値に反落した後は53.50～57.50ドルでの横ばい推移となりました。12月にOPECとロシアなど非加盟産油国が合意した減産が1月から実施されていることが下支えとなる一方、トランプ新政権の発足で米国のエネルギー政策が転換し、米国の石油増産により、OPECの減産効果が相殺されるとの見方が上値を抑えました。

金相場は、当初の1,150ドルから上昇し、月末には1,200ドルを上抜きました。米国のトランプ新政権からドル高を牽制する発言が相次ぎ、ドル安を支援に上昇。米国の大統領令を受けた混乱や、欧州での政治的な不透明感が意識されるなかで、株式市場の停滞もあって金への投機的関心が回復しました。また、中国の旧正月による実需の季節的な増加期待も支援となりました。

トウモロコシ相場は、当初の350セントから一時370セントへ上昇しました。アルゼンチン産地の洪水と生産下方修正見通しで上昇したもののトウモロコシの被害は限定的で、またブラジルのトウモロコシ生育が順調であることから上昇が一巡。米国のトランプ新政権で貿易摩擦によりメキシコ向けなどの輸出に影響を受けるとの懸念から月末は360セントへ反落しました。

《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: 2017年1月31日時点)

評価日		2017/1/31		※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。						
純資産価額		1,768,708 ...①		※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							
	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=⑥÷②	⑧	
1	AT9901	1999/2/1	216ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,768,708	768,708	176.87%	4.27%
2	AT9902	1999/3/1	215ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	1,812,527	812,527	181.25%	4.53%
3	AT9903	1999/4/1	214ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	1,871,714	871,714	187.17%	4.88%
4	AT9904	1999/5/6	213ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	1,800,675	800,675	180.07%	4.51%
5	AT9905	1999/6/1	212ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	1,893,584	893,584	189.36%	5.05%
6	AT9906	1999/7/1	211ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	1,924,119	924,119	192.41%	5.25%
7	AT9907	1999/8/2	210ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	1,936,455	936,455	193.65%	5.35%
8	AT9908	1999/9/1	209ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	1,895,931	895,931	189.59%	5.14%
9	AT9909	1999/10/1	208ヵ月	1,000,000	937,900	1,067,133	1,887,446	887,446	188.74%	5.11%
10	AT9910	1999/11/1	207ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,059,600	1,059,600	205.96%	6.14%
11	AT9911	1999/12/1	206ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,080	1,920,958	920,958	192.10%	5.36%
12	AT9912	2000/1/4	205ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	1,936,836	936,836	193.68%	4.89%
13	AT2001	2000/2/1	204ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	1,822,931	822,931	182.29%	4.84%
14	AT2002	2000/3/1	203ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	1,794,412	794,412	179.44%	4.69%
15	AT2003	2000/4/3	202ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	1,874,924	874,924	187.49%	5.19%
16	AT2004	2000/5/1	201ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	1,901,369	901,369	190.14%	5.38%
17	AT2005	2000/6/1	200ヵ月	1,000,000	957,390	1,045,506	1,847,426	847,426	184.74%	5.08%
18	AT2006	2000/7/1	199ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,143	1,882,158	882,158	188.22%	5.31%
19	AT2007	2000/8/1	198ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,812	1,945,246	945,246	194.52%	5.72%
20	AT2008	2000/9/1	197ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	1,855,565	855,565	185.56%	5.21%
21	AT2009	2000/10/1	196ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	1,906,141	906,141	190.61%	5.54%
22	AT2010	2000/11/1	195ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	1,864,326	864,326	186.43%	5.31%
23	AT2011	2000/12/1	194ヵ月	1,000,000	1,012,677	1,098,781	1,746,565	746,565	174.66%	4.61%
24	AT2012	2001/1/4	193ヵ月	1,000,000	1,099,531	1,090,478	1,608,601	608,601	160.86%	3.78%
25	AT2101	2001/2/1	192ヵ月	1,000,000	1,106,736	1,090,357	1,598,128	598,128	159.81%	3.74%
26	AT2102	2001/3/1	191ヵ月	1,000,000	1,128,441	1,086,178	1,567,390	567,390	156.74%	3.56%
27	AT2103	2001/4/2	190ヵ月	1,000,000	1,274,671	1,078,456	1,387,579	387,579	138.76%	2.45%
28	AT2104	2001/5/1	189ヵ月	1,000,000	1,148,518	1,076,687	1,539,991	539,991	154.00%	3.42%
29	AT2105	2001/6/1	188ヵ月	1,000,000	1,120,460	1,089,490	1,578,554	578,554	157.86%	3.69%
30	AT2106	2001/7/2	187ヵ月	1,000,000	1,095,410	1,091,290	1,614,653	614,653	161.47%	3.94%
31	AT2107	2001/8/1	186ヵ月	1,000,000	1,108,831	1,090,185	1,595,109	595,109	159.51%	3.84%
32	AT2108	2001/9/3	185ヵ月	1,000,000	1,156,883	1,084,391	1,528,855	528,855	152.89%	3.43%
33	AT2109	2001/10/1	184ヵ月	1,000,000	1,278,225	1,082,334	1,383,720	383,720	138.37%	2.50%
34	AT2110	2001/11/1	183ヵ月	1,000,000	1,323,490	1,075,558	1,336,396	336,396	133.64%	2.20%
35	AT2111	2001/12/3	182ヵ月	1,000,000	1,222,209	1,081,190	1,447,139	447,139	144.71%	2.95%
36	AT2112	2002/1/2	181ヵ月	1,000,000	1,221,883	1,081,408	1,447,524	447,524	144.75%	2.96%
37	AT2201	2002/2/1	180ヵ月	1,000,000	1,166,737	1,085,091	1,515,943	515,943	151.59%	3.44%
38	AT2202	2002/3/1	179ヵ月	1,000,000	1,111,645	1,089,567	1,591,071	591,071	159.11%	3.96%
39	AT2203	2002/4/1	178ヵ月	1,000,000	1,098,307	1,091,042	1,610,394	610,394	161.04%	4.11%
40	AT2204	2002/5/1	177ヵ月	1,000,000	1,053,547	1,049,914	1,678,811	678,811	167.88%	4.60%
41	AT2205	2002/6/3	176ヵ月	1,000,000	1,061,310	1,042,231	1,666,531	666,531	166.65%	4.54%
42	AT2206	2002/7/1	175ヵ月	1,000,000	1,182,603	1,045,592	1,495,605	495,605	149.56%	3.39%
43	AT2207	2002/8/1	174ヵ月	1,000,000	1,241,166	1,080,564	1,425,037	425,037	142.50%	2.93%
44	AT2208	2002/9/2	173ヵ月	1,000,000	1,251,288	1,079,917	1,413,508	413,508	141.35%	2.87%
45	AT2209	2002/10/1	172ヵ月	1,000,000	1,344,590	1,043,721	1,315,425	315,425	131.54%	2.20%
46	AT2210	2002/11/1	171ヵ月	1,000,000	1,216,142	1,022,272	1,454,359	454,359	145.44%	3.19%
47	AT2211	2002/12/2	170ヵ月	1,000,000	1,161,070	1,086,124	1,523,342	523,342	152.33%	3.69%
48	AT2212	2003/1/2	169ヵ月	1,000,000	1,278,691	1,082,049	1,383,216	383,216	138.32%	2.72%
49	AT2301	2003/2/3	168ヵ月	1,000,000	1,382,741	1,072,301	1,279,131	279,131	127.91%	1.99%
50	AT2302	2003/3/3	167ヵ月	1,000,000	1,485,812	1,067,302	1,190,397	190,397	119.04%	1.37%
51	AT2303	2003/4/1	166ヵ月	1,000,000	1,366,283	1,071,912	1,294,538	294,538	129.45%	2.13%
52	AT2304	2003/5/1	165ヵ月	1,000,000	1,377,293	1,076,061	1,284,189	284,189	128.42%	2.06%
53	AT2305	2003/6/2	164ヵ月	1,000,000	1,510,066	1,066,222	1,171,277	171,277	117.13%	1.25%
54	AT2306	2003/7/1	163ヵ月	1,000,000	1,436,823	1,069,579	1,230,983	230,983	123.10%	1.70%
55	AT2307	2003/8/1	162ヵ月	1,000,000	1,417,256	1,075,588	1,247,979	247,979	124.80%	1.83%
56	AT2308	2003/9/1	161ヵ月	1,000,000	1,392,804	1,071,796	1,269,889	269,889	126.99%	2.01%
57	AT2309	2003/10/1	160ヵ月	1,000,000	1,416,896	1,075,768	1,248,297	248,297	124.83%	1.86%
58	AT2310	2003/11/4	159ヵ月	1,000,000	1,436,951	1,069,517	1,230,873	230,873	123.09%	1.74%
59	AT2311	2003/12/1	158ヵ月	1,000,000	1,407,221	1,076,620	1,256,879	256,879	125.69%	1.95%
60	AT2312	2004/1/5	157ヵ月	1,000,000	1,506,668	1,066,316	1,173,919	173,919	117.39%	1.33%
61	AT2401	2004/2/2	156ヵ月	1,000,000	1,515,744	1,065,972	1,166,890	166,890	116.69%	1.28%
62	AT2402	2004/3/1	155ヵ月	1,000,000	1,587,195	1,063,002	1,114,360	114,360	111.44%	0.88%
63	AT2403	2004/4/1	154ヵ月	1,000,000	1,551,768	1,064,426	1,139,801	139,801	113.98%	1.09%
64	AT2404	2004/5/3	153ヵ月	1,000,000	1,429,064	1,069,758	1,237,667	237,667	123.77%	1.86%
65	AT2405	2004/6/1	152ヵ月	1,000,000	1,395,055	1,071,687	1,267,839	267,839	126.78%	2.11%
66	AT2406	2004/7/1	151ヵ月	1,000,000	1,318,409	1,075,849	1,341,545	341,545	134.15%	2.71%
67	AT2407	2004/8/2	150ヵ月	1,000,000	1,313,299	1,071,441	1,346,766	346,766	134.68%	2.77%
68	AT2408	2004/9/1	149ヵ月	1,000,000	1,323,594	1,075,518	1,336,290	336,290	133.63%	2.71%
69	AT2409	2004/10/1	148ヵ月	1,000,000	1,357,884	1,073,649	1,302,545	302,545	130.25%	2.45%
70	AT2410	2004/11/1	147ヵ月	1,000,000	1,408,023	1,072,015	1,256,162	256,162	125.62%	2.09%
71	AT2411	2004/12/1	146ヵ月	1,000,000	1,507,175	1,066,342	1,173,523	173,523	117.35%	1.42%
72	AT2412	2005/1/3	145ヵ月	1,000,000	1,500,722	1,066,345	1,178,569	178,569	117.86%	1.48%
73	AT2501	2005/2/1	144ヵ月	1,000,000	1,412,989	1,070,719	1,251,748	251,748	125.17%	2.10%
74	AT2502	2005/3/1	143ヵ月	1,000,000	1,459,169	1,068,521	1,212,132	212,132	121.21%	1.78%
75	AT2503	2005/4/1	142ヵ月	1,000,000	1,445,096	1,069,195	1,223,937	223,937	122.39%	1.89%
76	AT2504	2005/5/2	141ヵ月	1,000,000	1,402,509	1,071,307	1,261,101	261,101	126.11%	2.22%
77	AT2505	2005/6/1	140ヵ月	1,000,000	1,478,317	1,076,444	1,196,431	196,431	119.64%	1.68%
78	AT2506	2005/7/1	139ヵ月	1,000,000	1,532,845	1,065,281	1,153,871	153,871	115.39%	1.33%
79	AT2507	2005/8/1	138ヵ月	1,000,000	1,551,175	1,064,672	1,140,236	140,236	114.02%	1.22%
80	AT2508	2005/9/1	137ヵ月	1,000,000	1,607,807	1,062,195	1,100,074	100,074	110.01%	0.88%

※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事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							
	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=⑥÷②	⑧	
81	AT2509	2005/10/3	136ヵ月	1,000,000	1,666,428	1,600,005	1,061,375	61,375	106.14%	0.54%
82	AT2510	2005/11/1	135ヵ月	1,000,000	1,637,800	1,601,075	1,079,928	79,928	107.99%	0.71%
83	AT2511	2005/12/1	134ヵ月	1,000,000	1,735,801	1,578,102	1,018,956	18,956	101.90%	0.17%
84	AT2512	2006/1/2	133ヵ月	1,000,000	1,710,516	1,584,618	1,034,018	34,018	103.40%	0.31%
85	AT2601	2006/2/1	132ヵ月	1,000,000	1,752,235	1,570,699	1,009,399	9,399	100.94%	0.09%
86	AT2602	2006/3/1	131ヵ月	1,000,000	1,693,853	1,590,370	1,044,192	44,192	104.42%	0.40%
87	AT2603	2006/4/1	130ヵ月	1,000,000	1,747,442	1,572,265	1,012,169	12,169	101.22%	0.11%
88	AT2604									

「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