

アセットトライ

2017年3月運用報告書(2017年3月1日～2017年3月31日)

純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：3.74%】

	設定時 (1999/2/1)	2016年11月末	2016年12月末	2017年1月末	2017年2月末	2017年3月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	1,810,316	1,862,765	1,768,708	1,686,930	1,680,063
月次騰落率	—	-1.83%	2.90%	-5.05%	-4.62%	-0.41%
設定来騰落率	—	81.03%	86.28%	76.87%	68.69%	68.01%

各セクターごとの損益

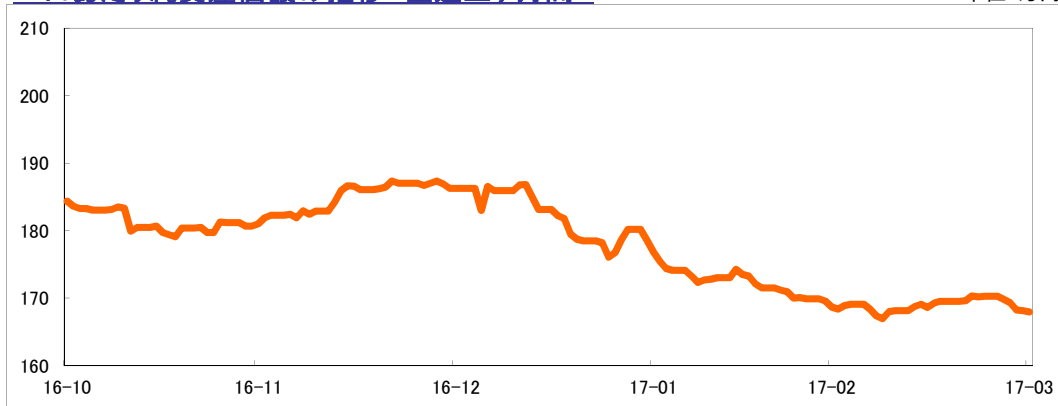
2017年3月の運用成績はマイナスとなり、アセットトライは前月比0.41%の損失となりました。

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。

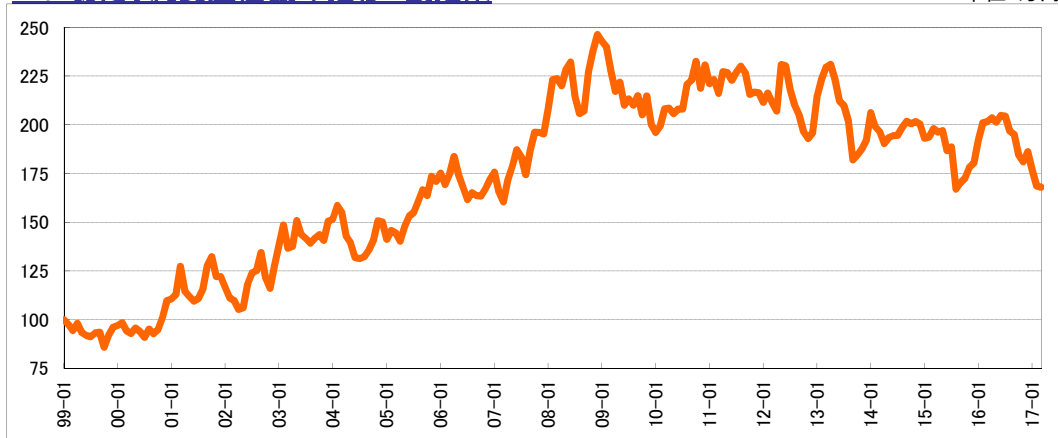
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

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

ドル円は米国の利上げ見通しで当初の112.70円から、115.50円へ円安ドル高となりました。利上げ決定後は利上げペース加速が否定されてドル安に転じ、一時110円に迫ったものの、月末には111円を回復しました。ユーロはECBの緩和策縮小も見込まれ、下旬にかけては1.09ドルと年初来高値を更新。しかし、月後半は緩和に否定的な報道を受け、1.06ドル台へユーロ安となりました。

主要国の短期金利は、米国の利上げを受けてドルでは上昇した一方で、ユーロではマイナス圏で横ばい、円は一部でマイナス金利を脱するなどわずかに上昇しました。主要国の長期金利は、前半は米国を中心に上昇傾向にありましたが、後半は米国の追加利上げペース加速が否定され、ECBの緩和縮小への否定的な見方から低下しました。日本では低水準の横ばいとなりました。

主要国の株価指数は、上値の重い動きとなりました。前半は米国の利上げが確実視されたことが上値を抑制。後半は米国株では政権と議会の連携不足から今後の政策実現が懸念されると一段安となりました。欧州では英国がEU離脱交渉本格化を控えて軟調となる一方、政治不安が一時期より後退した仏独では上昇。日本株は円高が圧迫となり月末にかけ軟化しました。

原油相場は、ブレントは当初の57ドルから一時50ドル割れへ下落しました。OPECが減産を実行している一方、米国では原油在庫が高水準に達しているうに、石油掘削リグ稼働数が増加し増産傾向にあることから供給過剰感が再認識されると圧迫されました。ただ、下旬にOPECを中心とした産油国の減産延長に対する期待が強まると反発し、月末には53ドルを回復しました。

金相場は、米国で15日のFOMCでの利上げがほぼ確定的とされたことからドル高に圧迫され、月初に1,250ドルを割り込むと中旬には一時1,200ドルへ急落しました。しかし、利上げ決定後は追加利上げペース加速に否定的な見方が強まるとともに、米国で政権と議会の連携不足から今後の政策実現への懸念を背景としたドル安により反発。下旬には1,250ドルを回復しました。

大豆相場は、当初の1,040セントから月末には950セント割れと月間を通して下落傾向となりました。南米では、懸念されていたアルゼンチンの洪水被害は予想より小規模にとどまり、ブラジルでは豊作となったことが圧迫。米国では前年の記録的豊作で在庫水準が高いうに、今年の大豆の作付面積は過去最大と見込まれるなど、強い供給過剰感が圧迫となりました。

《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3月31日時点)

評価日		2017/3/31		※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		1,680,063		…①							
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=⑥÷②	⑧		
1	AT9901	1999/2/1	218ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,680,063	680,063	168.01%	3.74%	
2	AT9902	1999/3/1	217ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	1,721,686	746,862	172.17%	3.99%	
3	AT9903	1999/4/1	216ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	1,777,906	832,939	177.79%	4.32%	
4	AT9904	1999/5/6	215ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	1,710,428	728,182	171.04%	3.96%	
5	AT9905	1999/6/1	214ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	1,798,680	864,627	179.87%	4.48%	
6	AT9906	1999/7/1	213ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	1,827,685	908,455	182.77%	4.66%	
7	AT9907	1999/8/2	212ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	1,839,403	926,030	183.94%	4.75%	
8	AT9908	1999/9/1	211ヵ月	1,000,000	932,896	1,071,930	1,800,909	868,013	180.09%	4.55%	
9	AT9909	1999/10/1	210ヵ月	1,000,000	937,090	1,067,133	1,792,850	855,760	179.29%	4.53%	
10	AT9910	1999/11/1	209ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	1,956,376	1,097,614	195.64%	5.49%	
11	AT9911	1999/12/1	208ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,080	1,824,682	903,940	182.47%	4.75%	
12	AT9912	2000/1/4	207ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	1,744,777	781,868	174.48%	4.31%	
13	AT2001	2000/2/1	206ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	1,731,568	761,314	173.16%	4.26%	
14	AT2002	2000/3/1	205ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	1,704,479	718,804	170.45%	4.12%	
15	AT2003	2000/4/3	204ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	1,780,955	837,606	178.10%	4.59%	
16	AT2004	2000/5/1	203ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	1,806,076	875,848	180.61%	4.76%	
17	AT2005	2000/6/1	202ヵ月	1,000,000	957,390	1,045,506	1,754,835	797,445	175.48%	4.48%	
18	AT2006	2000/7/1	201ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,143	1,787,827	848,104	178.78%	4.70%	
19	AT2007	2000/8/1	200ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,812	1,847,753	938,507	184.78%	5.08%	
20	AT2008	2000/9/1	199ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	1,762,567	809,377	176.26%	4.60%	
21	AT2009	2000/10/1	198ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	1,810,608	882,709	181.06%	4.91%	
22	AT2010	2000/11/1	197ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	1,770,888	822,177	177.09%	4.69%	
23	AT2011	2000/12/1	196ヵ月	1,000,000	1,012,677	1,087,481	1,659,030	646,353	165.90%	4.03%	
24	AT2012	2001/1/4	195ヵ月	1,000,000	1,099,531	1,090,478	1,527,980	428,449	152.80%	3.25%	
25	AT2101	2001/2/1	194ヵ月	1,000,000	1,106,736	1,093,557	1,518,032	411,300	151.80%	3.20%	
26	AT2102	2001/3/1	193ヵ月	1,000,000	1,128,441	1,086,176	1,488,834	360,693	148.88%	3.04%	
27	AT2103	2001/4/2	192ヵ月	1,000,000	1,274,671	1,184,516	1,318,036	43,465	131.80%	1.99%	
28	AT2104	2001/5/1	191ヵ月	1,000,000	1,148,518	1,076,887	1,462,809	314,291	146.28%	2.91%	
29	AT2105	2001/6/1	190ヵ月	1,000,000	1,120,460	1,092,490	1,499,439	378,979	149.94%	3.15%	
30	AT2106	2001/7/2	189ヵ月	1,000,000	1,095,410	1,091,290	1,533,729	438,439	153.37%	3.39%	
31	AT2107	2001/8/1	188ヵ月	1,000,000	1,108,831	1,091,850	1,515,164	406,313	151.52%	3.29%	
32	AT2108	2001/9/3	187ヵ月	1,000,000	1,156,883	1,064,391	1,452,231	295,348	145.22%	2.90%	
33	AT2109	2001/10/1	186ヵ月	1,000,000	1,278,225	1,082,334	1,314,370	43,045	131.44%	2.03%	
34	AT2110	2001/11/1	185ヵ月	1,000,000	1,323,490	1,055,578	1,269,418	215,848	126.94%	1.75%	
35	AT2111	2001/12/3	184ヵ月	1,000,000	1,222,209	1,081,890	1,374,610	152,401	137.46%	2.44%	
36	AT2112	2002/1/2	183ヵ月	1,000,000	1,221,883	1,081,408	1,374,976	153,568	137.50%	2.46%	
37	AT2201	2002/2/1	182ヵ月	1,000,000	1,166,737	1,057,091	1,439,966	273,169	144.00%	2.90%	
38	AT2202	2002/3/1	181ヵ月	1,000,000	1,111,645	1,099,567	1,511,329	419,764	151.13%	3.39%	
39	AT2203	2002/4/1	180ヵ月	1,000,000	1,098,307	1,010,492	1,529,683	431,176	152.97%	3.53%	
40	AT2204	2002/5/1	179ヵ月	1,000,000	1,053,547	1,049,174	1,594,672	545,498	159.47%	3.98%	
41	AT2205	2002/6/3	178ヵ月	1,000,000	1,061,310	1,042,231	1,583,007	521,797	158.30%	3.93%	
42	AT2206	2002/7/1	177ヵ月	1,000,000	1,182,603	1,045,592	1,420,647	238,044	142.06%	2.85%	
43	AT2207	2002/8/1	176ヵ月	1,000,000	1,241,166	1,080,694	1,353,616	112,450	135.36%	2.41%	
44	AT2208	2002/9/2	175ヵ月	1,000,000	1,251,288	1,079,176	1,342,666	263,488	134.27%	2.35%	
45	AT2209	2002/10/1	174ヵ月	1,000,000	1,344,590	1,043,721	1,249,498	204,908	124.95%	1.72%	
46	AT2210	2002/11/1	173ヵ月	1,000,000	1,216,142	1,022,272	1,381,468	165,326	138.15%	2.64%	
47	AT2211	2002/12/2	172ヵ月	1,000,000	1,161,070	1,061,274	1,446,994	285,924	144.70%	3.12%	
48	AT2212	2003/1/2	171ヵ月	1,000,000	1,278,691	1,078,209	1,313,891	35,182	131.39%	2.20%	
49	AT2301	2003/2/3	170ヵ月	1,000,000	1,382,741	1,072,301	1,210,233	21,932	121.50%	1.52%	
50	AT2302	2003/3/3	169ヵ月	1,000,000	1,485,812	1,073,032	1,130,736	11,704	113.07%	0.93%	
51	AT2303	2003/4/1	168ヵ月	1,000,000	1,366,283	1,073,912	1,229,658	155,746	122.97%	1.64%	
52	AT2304	2003/5/1	167ヵ月	1,000,000	1,377,293	1,076,061	1,199,828	122,535	121.98%	1.58%	
53	AT2305	2003/6/2	166ヵ月	1,000,000	1,510,066	1,062,222	1,112,574	152,352	111.26%	0.81%	
54	AT2306	2003/7/1	165ヵ月	1,000,000	1,436,823	1,069,579	1,169,288	102,709	116.93%	1.23%	
55	AT2307	2003/8/1	164ヵ月	1,000,000	1,417,256	1,070,588	1,185,432	118,146	118.54%	1.36%	
56	AT2308	2003/9/1	163ヵ月	1,000,000	1,392,804	1,071,796	1,206,244	113,440	120.62%	1.52%	
57	AT2309	2003/10/1	162ヵ月	1,000,000	1,416,896	1,070,768	1,185,734	168,968	118.57%	1.37%	
58	AT2310	2003/11/4	161ヵ月	1,000,000	1,436,951	1,069,517	1,169,184	169,184	116.92%	1.26%	
59	AT2311	2003/12/1	160ヵ月	1,000,000	1,407,221	1,071,620	1,193,886	196,666	119.39%	1.45%	
60	AT2312	2004/1/5	159ヵ月	1,000,000	1,506,668	1,063,716	1,115,084	111,368	111.51%	0.87%	
61	AT2401	2004/2/2	158ヵ月	1,000,000	1,515,744	1,065,972	1,108,408	108,408	110.84%	0.82%	
62	AT2402	2004/3/1	157ヵ月	1,000,000	1,587,195	1,030,042	1,058,510	108,510	105.85%	0.45%	
63	AT2403	2004/4/1	156ヵ月	1,000,000	1,551,768	1,044,426	1,082,676	82,676	108.27%	0.64%	
64	AT2404	2004/5/3	155ヵ月	1,000,000	1,429,064	1,069,758	1,175,637	175,637	117.56%	1.36%	
65	AT2405	2004/6/1	154ヵ月	1,000,000	1,395,055	1,068,177	1,204,297	204,297	120.43%	1.59%	
66	AT2406	2004/7/1	153ヵ月	1,000,000	1,318,409	1,075,489	1,274,309	274,309	127.43%	2.15%	
67	AT2407	2004/8/2	152ヵ月	1,000,000	1,313,299	1,071,441	1,279,268	279,268	127.93%	2.20%	
68	AT2408	2004/9/1	151ヵ月	1,000,000	1,323,594	1,075,518	1,269,317	269,317	126.93%	2.14%	
69	AT2409	2004/10/1	150ヵ月	1,000,000	1,357,884	1,076,439	1,237,263	237,263	123.73%	1.90%	
70	AT2410	2004/11/1	149ヵ月	1,000,000	1,408,023	1,072,015	1,193,205	193,205	119.32%	1.56%	
71	AT2411	2004/12/1	148ヵ月	1,000,000	1,507,175	1,063,492	1,114,708	111,478	111.47%	0.93%	
72	AT2412	2005/1/3	147ヵ月	1,000,000	1,500,722	1,066,345	1,119,501	119,501	111.95%	0.98%	
73	AT2501	2005/2/1	146ヵ月	1,000,000	1,412,989	1,070,719	1,189,012	189,012	118.90%	1.55%	
74	AT2502	2005/3/1	145ヵ月	1,000,000	1,459,169	1,068,321	1,151,382	151,382	115.14%	1.25%	
75	AT2503	2005/4/1	144ヵ月	1,000,000	1,445,096	1,069,195	1,162,595	162,595	116.26%	1.35%	
76	AT2504	2005/5/2	143ヵ月	1,000,000	1,402,509	1,071,307	1,197,896	197,896	119.79%	1.66%	
77	AT2505	2005/6/1	142ヵ月	1,000,000	1,478,317	1,076,444	1,136,468	136,468	113.65%	1.15%	
78	AT2506	2005/7/1	141ヵ月	1,000,000	1,532,845	1,065,281	1,096,041	96,041	109.60%	0.82%	
79	AT2507	2005/8/1	140ヵ月	1,000,000	1,551,175	1,064,672	1,083,089	83,089	108.31%	0.71%	
80	AT2508	2005/9/1	139ヵ月	1,000,000	1,607,807	1,062,196	1,044,940	44,940	104.49%	0.39%	

※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=⑥÷②	⑧	
81	AT2509	2005/10/3	138ヵ月	1,000,000	1,666,428	1,600,000	1,008,180	8,180	100.82%	0.07%
82	AT2510	2005/11/1	137ヵ月	1,000,000	1,637,800	1,605,075	1,025,804	25,804	102.58%	0.23%
83	AT2511	2005/12/1	136ヵ月	1,000,000	1,735,801	1,578,102	1,067,887	32,113	96.79%	-0.28%
84	AT2512	2006/1/2	135ヵ月	1,000,000	1,710,516	1,584,618	1,058,195	-17,805	98.22%	-0.16%
85	AT2601	2006/2/1	134ヵ月	1,000,000	1,752,235	1,507,699	1,058,195	-19,005	95.88%	-0.37%
86	AT2602	2006/3/1	133ヵ月	1,000,000	1,693,853	1,590,370	1,058,195	-8,142	99.19%	-0.07%
87	AT2603	2006/4/1	132ヵ月	1,000,000	1,747,442	1,572,265	1,061,441	-38,559		

「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