

作成日:2015年 7月31日  
(前回作成日:2015年 4月30日)

# アセット トライ

## 期間運用報告書

自:2015年 4月 1日

至:2015年 6月30日

作成者 : AT ADMINISTRATION (CAYMAN) LIMITED

交付者 : 岡藤商事株式会社

〒104-0033 東京都中央区新川2-12-16  
コールセンター 電話 0120 (33) 7639

A. ファンドの状況

1. 資産推移(販売、解約の状況)

単位:千円

計算期間 *1	前期末*2		期中解約			期中販売			期末	
	口数	総純資産	件数	口数	総額*3	件数	口数	総額*4	口数	総純資産
1999/2/1～ 1999/5/31	720.000000	720,000	0	0.000000	0	43	72.791622	70,000	792.791622	740,509
1999/6/1～ 2000/5/31	792.791622	740,509	47	84.050664	78,704	52	125.839074	114,000	834.580032	799,018
2000/6/1～ 2001/5/31	834.580032	799,018	40	114.758743	129,155	8	8.087742	9,000	727.909031	815,593
2001/6/1～ 2002/5/31	727.909031	815,593	31	44.387643	51,035	80	138.652441	161,000	822.173829	872,581
2002/6/1～ 2003/5/31	822.173829	872,581	53	215.272753	286,590	82	132.339191	175,000	739.240267	1,116,301
2003/6/1～ 2004/5/31	739.240267	1,116,301	24	31.843891	45,639	192	306.840111	453,000	1,014.236487	1,414,915
2004/6/1～ 2005/5/31	1,014.236487	1,414,915	45	62.586487	88,110	322	418.237374	582,000	1,369.887374	2,025,127
2005/6/1～ 2006/5/31	1,369.887374	2,025,127	95	461.930128	734,344	444	732.904334	1,226,000	1,640.861580	2,862,430
2006/6/1～ 2007/5/31	1,640.861580	2,862,430	159	326.531143	540,296	398	580.581296	973,000	1,894.911733	3,386,437
2007/6/1～ 2008/5/31	1,894.911733	3,386,437	224	332.721437	662,243	0	0	0	1,562.190296	3,571,161
2008/6/1～ 2009/5/31	1,562.190296	3,571,161	159	245.328954	551,663	0	0	0	1,316.861342	2,922,718
2009/6/1～ 2010/5/31	1,316.861342	2,922,718	74	104.247836	210,683	0	0	0	1,212.613506	2,496,116
2010/6/1～ 2011/5/31	1,212.613506	2,496,116	155	212.923305	466,843	0	0	0	999.690201	2,267,404
2011/6/1～ 2012/5/31	999.690201	2,267,404	141	228.329614	500,833	13	11.973380	25,000	783.333967	1,823,261
2012/6/1～ 2013/5/31	783.333967	1,823,261	68	111.223429	234,382	10	10.729242	24,000	682.839780	1,524,861
2013/6/1～ 2014/5/31	682.839780	1,524,861	49	52.171509	103,089	2	0.985283	2,000	631.653554	1,222,196
2014/6/1～ 2014/6/30	631.653554	1,222,196	6	12.583764	24,105	0	0.000000	0	619.069790	1,204,029
2014/7/1～ 2014/9/30	619.069790	1,204,029	18	19.988657	38,972	0	0.000000	0	599.081133	1,209,693
2014/10/1～ 2014/12/31	599.081133	1,209,693	23	41.252014	82,317	0	0.000000	0	557.829119	1,118,090
2015/1/1～ 2015/3/31	557.829119	1,118,090	7	7.915100	15,408	0	0.000000	0	549.914019	1,089,576
2015/4/1～ 2015/5/31	549.914019	1,089,576	4	5.426619	10,595	1	2.547305	5,000	547.034705	1,077,782
2015/6/1～ 2015/6/30	547.034705	1,077,782	6	6.611908	12,897	0	0.000000	0	540.422797	1,008,907
累計	—	—	1,428	2,722.085598	4,867,902	1,647	2,542.508395	3,819,000	—	—

注: \*1 運用開始日は1999年2月1日です。

\*2 運用開始時の前期末口数・総純資産は、初回販売口数・総純資産となっております。

\*3 期中解約総額は、解約手数料が差し引かれております。

\*4 期中販売総額には、販売手数料が含まれておりません。

\*5 期中販売及び期中解約の件数、口数及び件数は、払込期限及び解約手続基準日の翌月に反映しております。

## 2. 運用実績推移(1口当たり)

単位:円

計算期間 *1	前期末 純資産	期中損益	期末 純資産*2	期間 騰落率	運用開始来 騰落率*3	年平均 騰落率
1999/2/1～ 1999/5/31	1,000,000	-65,947	934,053	-6.59%	-6.59%	—
1999/6/1～ 2000/5/31	934,053	23,337	957,390	2.50%	-4.26%	-3.21%
2000/6/1～ 2001/5/31	957,390	163,070	1,120,460	17.03%	12.05%	5.17%
2001/6/1～ 2002/5/31	1,120,460	-59,150	1,061,310	-5.28%	6.13%	1.84%
2002/6/1～ 2003/5/31	1,061,310	448,756	1,510,066	42.28%	51.01%	11.78%
2003/6/1～ 2004/5/31	1,510,066	-115,011	1,395,055	-7.62%	39.51%	7.41%
2004/6/1～ 2005/5/31	1,395,055	83,262	1,478,317	5.97%	47.83%	7.55%
2005/6/1～ 2006/5/31	1,478,317	266,151	1,744,468	18.00%	74.45%	10.15%
2006/6/1～ 2007/5/31	1,744,468	42,653	1,787,121	2.45%	78.71%	9.45%
2007/6/1～ 2008/5/31	1,787,121	498,875	2,285,996	27.92%	128.60%	13.78%
2008/6/1～ 2009/5/31	2,285,996	-66,539	2,219,457	-2.91%	121.95%	11.80%
2009/6/1～ 2010/5/31	2,219,457	-160,998	2,058,459	-7.25%	105.85%	9.34%
2010/6/1～ 2011/5/31	2,058,459	209,647	2,268,106	10.18%	126.81%	10.28%
2011/6/1～ 2012/5/31	2,268,106	41,586	2,309,692	1.83%	130.97%	9.82%
2012/6/1～ 2013/5/31	2,309,692	-76,576	2,233,116	-3.32%	123.31%	8.60%
2013/6/1～ 2014/5/31	2,233,116	-298,202	1,934,914	-13.35%	93.49%	6.10%
2014/6/1～ 2014/6/30	1,934,914	9,986	1,944,900	0.52%	94.49%	6.13%
2014/7/1～ 2014/9/30	1,944,900	74,346	2,019,246	3.82%	101.92%	6.50%
2014/10/1～ 2014/12/31	2,019,246	-14,888	2,004,358	-0.74%	100.44%	6.31%
2015/1/1～ 2015/3/31	2,004,358	-23,002	1,981,356	-1.15%	98.14%	6.07%
2015/4/1～ 2015/5/31	1,981,356	-11,130	1,970,226	-0.56%	97.02%	5.94%
2015/6/1～ 2015/6/30	1,970,226	-103,343	1,866,883	-5.25%	86.69%	5.28%
累計	—	866,883	—	—	—	—

注: \*1 運用開始日は1999年2月1日です。

\*2 期末純資産は、1口当たりの表記となっておりますので、お客様の保有口数を乗じた金額がお客様の保有する口数に対する時価となります。

\*3 運用開始来騰落率は、運用開始日の1口当たり純資産価額100万円を基準として算出されています。

\*4 パーセンテージの計算は小数点以下第3位を四捨五入しています。

注: 1) 純資産は、契約締結前交付書面2. 13項に基づいて算出されております。

2) 期間騰落率及び運用開始来騰落率、年平均騰落率の計算方法は、次の通りとなっております。

なお、すべて1口当たりの価額にて算出しております。

① 期間騰落率

$$= \frac{\text{期末純資産(期中配当含む)} - \text{期初純資産}}{\text{期初純資産}} \times 100$$

② 運用開始来騰落率

$$= \frac{\text{期末純資産(期中配当含む)} + \text{前期末までの配当累計} - \text{運用開始時純資産}}{\text{運用開始時純資産}} \times 100$$

③ 年平均騰落率(設定時より1年以上経過した場合のみ記載。)

$$= \text{運用開始来騰落率} \div (\text{運用日数(片端落し)} / 365)$$

B. ファンドの概況

先物運用顧問会社による運用状況

プラスに寄与したセクター	株価指数	農産物			
マイナスに寄与したセクター	通貨	金利	エネルギー	金属	その他商品

為替相場は、ユーロドルが米国の利上げ先送り観測で1.06ドル水準から一時1.14ドルへ反発。ギリシャ債務問題の再燃で期末には1.10ドルを割り込む場面もみられました。ドル円が当初の119円台を中心とした横ばいから、5月後半に円安に転じ、一時125円台となりましたが、黒田日銀総裁の発言を受け円高警戒が強まりました。

主要国の短期金利は、ドル、円ともに金融政策を据え置くなか低水準での横ばいを維持し、ユーロでは小幅ながらマイナス幅を拡大しました。長期金利は米国の年内利上げ方針が意識され米国債を中心に上昇傾向。6月にはギリシャのデフォルト懸念が強まったことから、横ばいとなりました。国内はおおむね横ばい推移となりました。

主要国の株式市況は、米国経済の堅調からNYダウは5月に過去最高値を更新後、ドル高が圧迫となり伸び悩みました。日本株はTPP交渉の進展期待からもあって6月にかけて続伸、欧州株はギリシャのデフォルト懸念が強まり、期末には次第に弱含みとなりました。新興国市場では、中国株は6月半ばには急落に転じました。

原油相場は、ブレントは当初の55ドルから、イエメン情勢の緊張を背景に69ドル台まで上昇しました。しかし、世界の石油需給は供給過剰感が強く、OPECも減産に否定的であることから上値が抑えられ、米国の利上げ観測によるドル高やギリシャ問題、対イランの制裁緩和による一段の供給過剰見通しから次第に弱含みとなりました。

金相場は、米国の利上げ観測によるドル高を背景に、1,200ドル前後から次第に軟調推移となりました。インドの祭礼シーズンが過ぎアジアの現物需要が鈍化するなか、株式市場の堅調地合いから金への投機的関心が後退。ギリシャ債務問題から金貨等小口需要の増加がみられたものの、ユーロ安ドル高もあって影響は限定的となりました。

トウモロコシ相場は、当初の380セント前後から、米国産地での作付作業が順調に進むにつれて軟化し、一時450セントを割り込みました。ただ、6月に産地の天候が悪化し洪水による作柄の悪化が懸念されると急反発。旧穀の国内輸送費が上昇したほか、新穀では作付面積が下方修正されたことから415セントまで急伸しました。

C. 資産推移

