

作成日:2015年10月30日
(前回作成日:2015年 7月31日)

アセット トライ

期間運用報告書

自:2015年 7月 1日

至:2015年 9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
2015/7/1~ 2015/9/30	540.422797	1,008,907	19	21.120556	36,825	0	0.000000	0	519.302241	884,879
累計	—	—	1,447	2,743.206154	4,904,727	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%
2015/7/1～ 2015/9/30	1,866,883	-162,907	1,703,976	-8.73%	70.40%	4.22%
累計	—	703,976	—	—	—	—

*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います。

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

為替相場は、米国年内利上げ方針による当初のドル高傾向から、8月に中国をはじめとした連鎖的な株価急落で金融市場への不安が強まると、一時はリスク回避的な円、ユーロの買い戻しが活発化しました。世界経済の減速懸念で米国の利上げ時期に不透明感が強まる一方、日銀、ECBの追加緩和観測もあり、次第に横ばい推移となりました。

主要国の短期金利は、金融政策の変更はないものの、年内利上げ方針のドルではわずかに上昇、ユーロではマイナス幅が拡大しました。長期金利は、中国株急落などから金融市場全体にリスク回避の動きが強まるなかで低下。米国ではFOMCを控えての上昇も利上げ見送りで低下しました。日本国内では小幅ながら低下傾向となりました。

主要国の株価指数は、全般に軟調となりました。中国経済の減速懸念が資源価格安を通じて関連企業の業績悪化から先進国市場にも圧迫となり、さらに中国元切り下げや天津港の爆発事故を受けて連鎖的に株価が急落。調整反発後も米国の利上げ方針から上値が重く、期末は独自自動車大手VWのスキャンダルにも圧迫されました。

原油相場は、ブレントは当初の63ドルから下落しました。世界経済の減速で需要の伸び悩みが見込まれるうえ、イラン核協議の包括的合意による石油輸出増加観測、米国の年内利上げ方針によるドル高が圧迫となり一時42ドルまで下落。8月末の株式市場急反発への追従も54ドルにとどまり、9月は50ドル弱での推移となりました。

金相場は、当初の1,173ドルから米国の年内利上げ方針によるドル高が圧迫となり1,078ドルへ下落しました。株価急落で金融不安が強まると、コインなど小口を中心に金への関心が回復し、一時は1,170ドルへ反発。1,150ドル超えには重さが見られるものの、米国の利上げ時期の不透明感もあり、1,100ドル台前半での推移となりました。

トウモロコシ相場は、米国産地の6月の大雨による被害を懸念し、当初は440セントに迫る上昇となりました。しかし、7月の天候が順調で豊作見通しが強まったほか、世界経済の減速懸念による商品全面安で一時は350セント割れまで下落。米国の収穫が始まると、生産高の見直しから期末には390セントへ反発しました。

C. 資産推移

