

作成日:2016年10月31日
(前回作成日:2016年 7月29日)

アセット トライ

期間運用報告書

自:2016年 7月 1日

至:2016年 9月30日

作成者 : AT ADMINISTRATION (GAYMAN) 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
法人事業部投資商品課 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～ 2015/5/31	631.653554	1,222,196	58	87.166154	171,397	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
2015/10/1～ 2015/12/31	519.302241	884,879	13	15.648676	27,175	0	0.000000	0	503.653565	908,242
2016/1/1～ 2016/3/31	503.653565	908,242	12	15.825306	29,254	0	0.000000	0	487.828259	983,901
2016/4/1～ 2016/5/31	487.828259	983,901	7	6.120882	12,235	0	0.000000	0	481.707377	970,046
2016/6/1～ 2016/6/30	481.707377	970,046	2	1.329010	2,650	0	0.000000	0	480.378367	984,002
2016/7/1～ 2016/9/30	480.378367	984,002	4	3.070445	6,178	0	0.000000	0	477.307922	931,304
累計	—	—	1,485	2,785.200473	4,982,218	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～ 2015/5/31	1,934,914	35,312	1,970,226	1.82%	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%
2015/10/1～ 2015/12/31	1,703,976	99,331	1,803,307	5.83%	80.33%	4.75%
2016/1/1～ 2016/3/31	1,803,307	213,593	2,016,900	11.84%	101.69%	5.92%
2016/4/1～ 2016/5/31	2,016,900	-3,135	2,013,765	-0.16%	101.38%	5.85%
2016/6/1～ 2016/6/30	2,013,765	34,623	2,048,388	1.72%	104.84%	6.02%
2016/7/1～ 2016/9/30	2,048,388	-97,228	1,951,160	-4.75%	95.12%	5.38%
累計	—	951,160	—	—	—	—

*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。)

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

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

為替相場は、当初の102円台から英国のEU離脱決定を受けた欧州通貨安円高で100円に接近しましたが、日銀の追加緩和期待もあって107円への円安に転じました。しかし、日銀の追加緩和期待が後退すると円高となり再度100円に接近。米国の利上げ観測から円安に振れる場面があったものの、8月以降は100～104円での推移となりました。

主要国の株価指数は全般に堅調となりました。6月の英国のEU離脱決定を受けた混乱は7月上旬で一服し急反発。英国株はポンド安を支援に上昇し、NYダウは米国経済の堅調さから過去最高値を更新しました。しかし、ドイツ大手銀行の経営不安、米国の利上げ観測から、8月後半以降は伸び悩みました。国内は円高も上値を抑えました。

主要国の短期金利は、主要国の短期金利は年内利上げが意識されるドルで上昇傾向、円、ユーロはマイナス圏で概ね横ばいとなりました。長期金利は英国債が8月の利下げを受けて低下。9月には米国の年内利上げが意識され米国債主導で全般に上昇しました。国内では日銀の追加緩和期待が後退し、マイナス利回りが縮小しました。

原油相場は、ブレントはイランや米国の増産見通しによる供給過剰感が強く当初の50ドルから41ドル台へ下落しました。8月にはメキシコン湾のハリケーンによる米国内の原油在庫減少から50ドルを回復。ドル高で反落したものの、産油国の生産調整への期待で45ドルを維持し、OPEC減産合意もあって期末には49ドルへ反発しました。

金相場は、英国のEU離脱決定を受けて金融不安が強まり、当初の1,320ドルから1,370ドルへ上昇しました。米国の利上げ観測によるドル高や、アジアの現物需要縮小から反落。欧州金融機関の健全性に対する不安が強まり、米国の利上げ見送りでは反発するなど期間を通しては1,300ドル台前半を中心に横ばい推移となりました。

トウモロコシ相場は、米国トウモロコシの記録的な豊作見通しが強まり、飼料需要で競合する小麦も需給が緩和傾向にあることから、当初の333セントから一時301セントへ下落しました。しかし、生産高予想が下方修正されたほか、収穫期を迎えて降雨による作業遅れが懸念されると反発し、期末には期初の水準を回復しました。

C. 資産推移

