

作成日:2011年7月29日
(前回作成日:2010年7月30日)

アセット トライ

期末報告書

自:2010年 6月 1日
至:2011年 5月31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

< 目 次 >

A. ファンドの状況	
1 資産推移P. 1
2 運用実績推移(1口当たり)P. 2
B. ファンドの概況	
1 運用状況P. 3
2 主要運用商品別資産配分状況P. 3
3 配当の状況P. 3
4 決算状況P. 3
添付：匿名組合決算	

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			期中損益	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	-49,491	792.791622	740,509
1999/6/1～ 2000/5/31	792.791622	740,509	47	84.050664	78,703	52	125.839074	114,000	23,212	834.580032	799,018
2000/6/1～ 2001/5/31	834.580032	799,018	40	114.758743	129,154	8	8.087742	9,000	136,727	727.909031	815,593
2001/6/1～ 2002/5/31	727.909031	815,593	31	44.387643	51,034	80	138.652441	161,000	-52,980	822.173829	872,581
2002/6/1～ 2003/5/31	822.173829	872,581	53	215.272753	286,589	82	132.339191	175,000	355,308	739.240267	1,116,301
2003/6/1～ 2004/5/31	739.240267	1,116,301	24	31.843891	45,638	192	306.840111	453,000	-108,750	1014.236487	1,414,915
2004/6/1～ 2005/5/31	1014.236487	1,414,915	45	62.586487	88,110	322	418.237374	582,000	116,320	1369.887374	2,025,127
2005/6/1～ 2006/5/31	1369.887374	2,025,127	95	461.930128	734,342	444	732.904334	1,226,000	345,645	1640.861580	2,862,430
2006/6/1～ 2007/5/31	1640.861580	2,862,430	159	326.531143	540,294	398	580.581296	973,000	91,301	1894.911733	3,386,437
2007/6/1～ 2008/5/31	1894.911733	3,386,437	224	332.721437	662,243	0	0	0	846,967	1562.190296	3,571,161
2008/6/1～ 2009/5/31	1562.190296	3,571,161	159	245.328954	552,898	0	0	0	-95,545	1316.861342	2,922,718
2009/6/1～ 2010/5/31	1316.861342	2,922,718	74	104.247836	210,683	0	0	0	-215,919	1212.613506	2,496,116
2010/6/1～ 2011/5/31	1212.613506	2,496,116	155	212.923305	466,843	0	0	0	238,131	999.690201	2,267,404
累計	—	—	1,106	2,236.582984	3,846,531	1,621	2,516.273185	3,763,000	1,630,926	—	—

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。

* 期中分配はありません。千円未満は切り捨てとなっております。

* 計算期間中の期中解約における口数、資産額の減少は実際に投資家の方に支払われた月(解約評価日を含む月の翌月)に反映されています。

2. 運用実績推移(1口当たり)

単位:円

計算期間 *5	前期末 純資産	期中損益	期末 純資産*6	期間 騰落率	運用開始来 騰落率*7	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%
累計	—	1,268,106	—	—	—	—

注: *5 運用開始日は1999年2月1日です。

*6 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。

*7 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。

* 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、商品投資受益権説明書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。)

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

3) 口数の計算方法は、次の通りとなっております。

① 初回販売時 出資金1,000,000円あたり1口です。

② 追加販売時 出資金額を参加月の最終営業日の1口当たりの純資産価額で除した口数となります。
(小数点以下第7位を切捨て、小数点以下第6位まで計算した数とします。)

B.ファンドの概況

1 運用状況

- ・ 本ファンドは、初回出資金総額7億2,000万円(総口数:720口)をもって、1999年2月1日に匿名組合型(追加型)として設定されました。
- ・ 本ファンドの当期末における総純資産は、22億6,740万円となっております。
- ・ トレーディングマネージャーによる運用状況は期間報告書(年4回)にて詳細を記載しております。

2 主要運用商品別資産配分状況(2011年5月31日現在)

(単位:上段=千円、下段=%)

	品目	商品先物取引	商品実物 オプション取引	商品実物取引	小計
商品	1.貴金属(金地金)	0 0.00%	0 0.00%	0 0.00%	0 0.00%
	(その他貴金属)	0 0.00%	0 0.00%	0 0.00%	0 0.00%
	2.農林水産物	0 0.00%	0 0.00%	0 0.00%	0 0.00%
	3.エネルギー資源	0 0.00%	0 0.00%	0 0.00%	0 0.00%
	4.その他商品	0 0.00%	0 0.00%	0 0.00%	0 0.00%
商品合計		0 0.00%	0 0.00%	0 0.00%	0 0.00%
その他	1.金融・証券先物	/			0 0.00%
	2.金融オプション				0 0.00%
	3.現金・預金				2,267,404 100.00%
	4.その他				0 0.00%
その他合計					2,267,404 100.00%
総合計					2,267,404 100.00%

注: 2011年6月1日付、先物運用顧問会社変更に伴い、2011年5月31日時点にて一時的に全ポジションを現金化しました。

3 配当の状況

- ・ 本ファンドは、期中配当を実施しておりません。

4 匿名組合財産の決算状況

- ・ 添付ご参照下さい。

アセットトライ

匿名組合貸借対照表

2011年5月31日現在

(単位：円)

科 目	金 額	科 目	金 額
資産の部		負債の部	
【流動資産】	【149,694,065】	【流動負債】	【149,694,065】
未収入金	149,694,065	未払金	149,694,065
【固定資産】	【1,442,000,000】	負債合計	149,694,065
(投資その他の資産)	(1,442,000,000)	出資金の部	
投資有価証券	1,442,000,000	【出資金】	【1,442,000,000】
		匿名組合出資金	1,442,000,000
		【利益剰余金】	【0】
		繰越利益剰余金	0
		出資金合計	1,442,000,000
資産合計	1,591,694,065	負債・出資金合計	1,591,694,065

匿名組合損益計算書

自 2010年6月1日

至 2011年5月31日

(単位：円)

科 目	金 額	
I 営業収入		
受取手数料	35,787,261	
投資有価証券中途解約償還差益	185,484,686	221,271,947
II 営業費用		
支払手数料	35,787,261	35,787,261
営業利益金額		185,484,686
当期純利益金額		185,484,686
中途解約者分配金		185,484,686
繰越利益剰余金		0

アセットトライ 匿名組合

財務諸表注記

2011年5月期

本商品ファンドの組織及び営業内容並びに管理費用等

匿名組合契約による本商品ファンド「アセット トライ」は、三井物産フューチャーズ株式会社と三井物産株式会社が共同で組成したものであり、運用開始日は1999年2月1日である。

本商品ファンドは、出資者からの出資の全額を先物運用会社 VICTORIA TC (CAYMAN) LIMITED に出資することにより先物運用等を行っており、その運用損益はすべて各出資者に帰属する。本商品ファンドの運営管理は、その営業者である AT ADMINISTRATION (CAYMAN) LIMITED (本店所在地：ケイマン諸島) が行う。

本商品ファンドは、運用開始後も追加募集を行う追加型で、出資者は毎月申込みをすることが可能であったが、2007年2月出資分を最後に追加募集の受付を終了した。

追加出資者の出資額にかかる取得口数は、出資直前の本商品ファンドの一口当り純資産額に基づき算定される。なおこの口数は、営業者が先物運用会社に出資する株数と連動する。

本商品ファンドは匿名組合契約によるため、出資者すなわち組合員各自が税金を負担することになる。したがって、本組合自体の当期利益に関わる税金は計上されていない。なお、商品投資受益権説明書 2.10 の記載に従い、運用終了前の出資者に対する利益配当は予定されていない。

本商品ファンドに係る管理費用等は、商品投資受益権説明書に基づき、先物運用会社が運用する本商品ファンドの資産から支払われている。費用のうち、管理料、先物投資顧問料及び先物取引手数料については、純資産価額に基づいて計算されている。先物運用顧問会社に支払う成功報酬は、毎月の純資産価額が過去の最高額を超える資産の純増額に基づいて計算されている。また、商品投資受益権説明書 2.11.5 及び 2.11.5.1 の記載に基づき、初期費用を含むその他の費用がその運用資産から差し引かれ支払われる。

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

市場価格のない株式については、出資者別取得年月別に原価法による評価を行っている。

また、追加出資時に出資直前の本商品ファンドの一口当り純資産額に基づき当該出資額に係る株数が算定される。

2. 収益及び費用の計上基準

収益及び費用は、発生主義によって計上している。

貸借対照表注記

1. 投資有価証券の増減

(単位：円)

	期首残高	当期増加	当期中途解約による減少	当期評価損計上	期末残高
投資有価証券 VICTORIA TC (CAYMAN) LIMITED	1,858,000,000	-	416,000,000	-	1,442,000,000

2. 匿名組合出資金の増減

(単位：円)

	期首残高	当期増加	当期減少	期末残高
(出資口数(未監査))	(1,209.387568 口)	(-口)	(272.587965 口)	(936.799603 口)
匿名組合出資金	1,858,000,000	-	416,000,000	1,442,000,000

出資口数については、先物運用顧問会社 MAN INVESTMENTS LIMITED から報告される純資産価額 (NET ASSET VALUE) に基づき算定しているものである。また、表示単位については、商品投資受益権説明書の記載に基づき、小数点以下第 7 位を切捨て、小数点以下第 6 位まで計算している。

主な資産・負債の明細

1. 勘定の内訳

(1) 未収入金

受取手数料	8,477,947 円
中途解約投資有価証券償還額	<u>141,216,118 円</u>
合計	<u>149,694,065 円</u>

(2) 投資有価証券

VICTORIA TC (CAYMAN) LIMITED	1,442,000,000 円
------------------------------	-----------------

(3) 未払金

支払手数料	8,477,947 円
中途解約匿名組合出資金償還額	<u>141,216,118 円</u>
合計	<u>149,694,065 円</u>

【参考情報】**投資有価証券の実質価額（2011年5月31日現在）**

（単位：円）

VICTORIA TC (CAYMAN) LIMITED 持分額	金額
前期末実質価額（2010年5月末解約差引後）	2,489,542,015
追加出資による増加額	-
当期運用損益	238,130,825
中途解約(2010年6月～2011年5月)による減少額	△601,484,686
当期末実質価額（2011年5月末解約差引後）	2,126,188,154
貸借対照表価額	1,442,000,000
評価差額	684,188,154

投資有価証券の実質価額の説明

市場価格のない株式については、本匿名組合の出資先である先物運用会社(VICTORIA TC (CAYMAN) LIMITED)が締結している先物契約、オプション契約、及び先物為替予約等の金融商品等の残高については市場価値で評価しており(値洗基準)、実質価額の算定にあたっては、当該金額から「本商品ファンドの組織及び営業内容並びに管理費用等」に記載の方法により計算された費用等を控除している。

その計上額は、先物運用顧問会社 MAN INVESTMENTS LIMITED からの報告書に基づくものである。

留意事項

1. 匿名組合の監査について

本匿名組合決算書に就きましては、商品投資受益権説明書2.12.1に記載された通り監査がなされておりません。

2. VICTORIA TC (CAYMAN) LIMITEDの監査について

本商品ファンドの出資先である先物運用会社VICTORIA TC (CAYMAN) LIMITEDの2011年5月31日の純資産額、及び2011年5月31日を決算日とする会計年度の損益、純資産の増減については、ERNST and YOUNGによって監査が行われます。

3. 匿名組合の決算報告書について

本匿名組合の決算報告書は、本匿名組合全体の数値を示すものとなっております。本匿名組合員の各々の持ち分につきましては、貸借対照表注記に記載される出資口数の期末残高を本商品ファンド取得時の出資口数にて按分計算して頂いたものとなります。

以上