



平成 19 年 6 月 15 日

各 位

会社名 アストマックス株式会社  
代表者名 代表取締役社長 牛嶋 英揚  
(コード番号：8734)  
問合せ先 常務取締役管理部長 小島 健太郎  
(電話 03-5447-8400)

### 平成 20 年 3 月期 5 月度の月末運用資産残高及び運用収益率のお知らせ

平成 20 年 3 月期 5 月度のプログラム別月末運用資産残高及び運用収益率につきまして、添付のとおりお知らせいたします。

5 月の商品市況は、エネルギー市場を中心に軟調な展開となりました。

当社が公表しておりますアストマックス商品指数 (AMCI) は 4 月末の 312.643 に対し、5 月末は 310.680 となり 0.63% の下落となっています。

海外のドル建て取引市場においては、穀物市場では価格が上昇しましたが、エネルギー、貴金属及び非鉄金属市場価格は軒並み反落しました。これらの背景としては、ドル反発と米国におけるガソリン在庫の増加等が材料としてあげられます。なお、本邦の円建て市場では、円安ドル高の影響でエネルギー価格の下げ幅も限定的でした。

一方、本邦株式市場は年度末の企業決算発表が好調であった点を評価し TOPIX 指数は 4 月末 1,701.00 から、5 月末は 1,755.68 と大きく上昇して終了しております。

こうした市場環境の中、当社が運用する資産残高は前月比 1,893 百万円増 (9.2%増) の 22,517 百万円となりました。

尚、個別の運用資産残高、月次収益率は以下のとおりとなっております。

1. 運用資産残高

(単位：百万円)

プログラム名		平成19年 4月	平成19年 5月	平成19年 6月	平成19年 7月	平成19年 8月	平成19年 9月
商品投資 顧問事業	アストジェネシス	1,042	1,034				
	アストプレリユード	281	270				
	アストオプション	181	187				
	AMCI	7,624	8,119				
証券投資 顧問事業	アストオプション	20	20				
	ファイナンシャル・ アストシンフォニー	315	0				
	アストジェルズ	196	199				
	債券運用戦略	7,915	9,618				
	その他	3,047	3,067				
合計		20,624	22,517				

プログラム名		平成19年 10月	平成19年 11月	平成19年 12月	平成20年 1月	平成20年 2月	平成20年 3月
商品投資 顧問事業	アストジェネシス						
	アストプレリユード						
	アストオプション						
	AMCI						
証券投資 顧問事業	アストオプション						
	ファイナンシャル・ アストシンフォニー						
	アストジェルズ						
	債券運用戦略						
	その他						
合計							

## 2. 運用収益率

(単位：月次収益率%)

プログラム名		平成 19 年 4 月	平成 19 年 5 月	平成 19 年 6 月	平成 19 年 7 月	平成 19 年 8 月	平成 19 年 9 月
商品投資 顧問事業	アストジェネシス	-0.19%	-0.55%				
	アストプレリユード	-1.58%	-2.85%				
	アストオプション	1.00%	3.03%				
証券投資 顧問事業	アストオプション	0.06%	0.00%				
	ファイナンシャル・ アストシンフォニー	0.06%	---				
	アストジェルズ	-1.32%	2.64%				

プログラム名		平成 19 年 10 月	平成 19 年 11 月	平成 19 年 12 月	平成 20 年 1 月	平成 20 年 2 月	平成 20 年 3 月
商品投資 顧問事業	アストジェネシス						
	アストプレリユード						
	アストオプション						
証券投資 顧問事業	アストオプション						
	ファイナンシャル・ アストシンフォニー						
	アストジェルズ						

- (注) 1. 上記の数値は原則、毎月月初より 10 営業日までに開示いたします。
2. 運用資産残高は時価純資産額、または時価純資産額にノーショナル・エクイティ(想定運用資産)を加えたもので、表示単位未満を切り捨てて表示しております。
- \* 先物市場を使った運用の場合、実際に証拠金として必要な資金が少額であることから、顧客によっては実際に預託する資金に想定運用資産を加えた資産額で運用する様に契約上取り決めることが多く、通常、この契約運用資産額が管理報酬の計算上のベースとなっています。この様に顧客との契約運用資産額のうち実際に資金が預託されていない金額をノーショナル・エクイティ(想定運用資産)と言います。
3. 複数の契約が存在する運用プログラムについては当該プログラムのコンポジットを作成し運用資産残高、運用収益率を算出しております。また、運用収益率は、成功報酬を伴う運用プログラムについてのみ掲載しております。
4. 「アストオプション」に関しては商品投資顧問事業と証券投資顧問事業の二つの事業部門にありますが、両運用プログラムのうち、証券先物等で運用するものを証券投資顧問事業に、商品及び金融先物やその他の運用のものを商品投資顧問事業に分類しております。
5. 総運用資産残高につきましては 1%以上の修正が生じた場合はその内容を開示いたします。

以上