



平成 19 年 7 月 13 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 専務取締役管理部長 小島 健太郎
(電話 03-5447-8400)

平成 20 年 3 月期 6 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 6 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。

6 月の商品市況は、エネルギー市場を中心に堅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) も堅調な商品市況をうけて 5 月末の 310.680 に対し、6 月末は 317.955 となり約 2.3%の上昇となっています。

海外のドル建て取引市場においては、エネルギー市場が堅調に推移しました。米国石油在庫統計で原油在庫の増加傾向が続いているものの、ガソリン在庫が引き続き低水準であることやナイジェリアの政情不安や中東の地政学リスクなどが支援材料となったものです。貴金属及び非鉄金属市場は全般に軟調な展開となりました。穀物市場は米国での収穫増減を材料視してまちまちの値動きとなりました。本邦の円建て市場では、円安ドル高の影響で商品市況は全般に堅調に推移しました。

一方、本邦株式市場は、活発な M&A 期待に後押しされた海外市場高を受けて堅調で、TOPIX 指数は 5 月末 1755.68 から、6 月末は 1774.88 と続伸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 11,113 百万円増 (49.3%増) の 33,630 百万円となりました。資産残高の伸びは、主に AMCI 連動型の運用資産の増加によるもので、AMCI 以外のプログラムの資産残高の伸張は、依然として課題となっております。

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 | 1,041 | | | |
| | アストプレリユード | 281 | 270 | 255 | | | |
| | アストオプション | 181 | 187 | 178 | | | |
| | AMCI | 7,624 | 8,119 | 11,899 | | | |
| 証券投資 顧問事業 | アストオプション | 20 | 19 | 19 | | | |
| | ファイナンシャル・ アストシンフォニー | 315 | 0 | 0 | | | |
| | アストジェルズ | 196 | 199 | 205 | | | |
| | 債券運用戦略 | 7,915 | 9,618 | 16,932 | | | |
| | その他 | 3,047 | 3,067 | 3,098 | | | |
| 合計 | | 20,624 | 22,517 | 33,630 | | | |

| 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% | 0.58% | | | |
| | アストプレリユード | -1.58% | -2.85% | -3.07% | | | |
| | アストオプション | 1.00% | 3.03% | -4.74% | | | |
| 証券投資 顧問事業 | アストオプション | 0.06% | 0.00% | -0.31% | | | |
| | 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 | -1.20% | 2.44% | 3.33% | | | |

| 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