



平成 19 年 9 月 14 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 8 月度の月末運用資産残高及び運用収益率のお知らせ

今期(平成 20 年 3 月期) 8 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。

8 月は、金融市場の混乱を受け、商品先物市場においても全般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、7 月末の 312.529 に対し、8 月末は 289.569 となり約 7.4% の下落となっています。

エネルギー市場では、世界的な金融市場の混乱を受けて投機資金が流出し NY 市場の原油は中旬まで大幅に下落した後、月末にかけては徐々に値を戻して終了しました。一方、東京市場では、中東産原油・石油製品共に、円高の影響もあり大幅な下げとなりました。

貴金属市場では、世界的な金融市場の混乱の中でドルが買戻され急反発した月半ばには、金が急落する局面もありましたが、ドル建てでは月末には 7 月末の水準に値を戻すなど比較的確りした値動きとなりました。東京市場の円建て貴金属市場は、為替市場における円高の影響もあり全銘柄続落となりました。

非鉄金属市場でも、月半ばにかけて全面安の急落局面があった他、小麦を除く穀物や食品市場でも大半の銘柄が下落しました。

一方、本邦株式市場は、中旬にかけての急落の後、海外市場が落ち着きを取り戻した中でも戻りが鈍く、TOPIX 指数は 7 月末の 1706.18 から、8 月末 1608.25 へと続落して終了しました。

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 2,071 百万円減(6.0%減)の 32,423 百万円となりました。8 月の資産残高の減少は、商品指数の下落に伴う資産減少及び、トレンドフォロー型運用である Astprelude の運用終了によるものでした。

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	1,041	1,541	1,592	
	アストプレリユード	281	270	255	230	0	
	アストオプション	181	187	178	189	195	
	AMCI	7,624	8,119	11,899	11,909	11,177	
証券投資 顧問事業	アストオプション	20	19	19	19	19	
	ファイナンシャル・ アストシンフォニー	315	—	—	—	—	
	アストジェルズ	196	199	205	204	184	
	債券運用戦略	7,915	9,618	16,932	17,199	16,188	
	その他	3,047	3,067	3,098	3,201	3,065	
合計		20,624	22,517	33,630	34,495	32,423	

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

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%	0.13%	0.65%	
	アストプレリユード	-1.58%	-2.85%	-3.07%	-5.66%	-4.03%	
	アストオプション	1.00%	3.03%	-4.74%	6.00%	3.08%	
証券投資 顧問事業	アストオプション	0.06%	0.00%	-0.31%	-1.24%	0.80%	
	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%	0.46%	-8.98%	

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