

## 2006年度（2007年3月期）月次運用資産残高推移（確報値）

スパークス・グループ株式会社

### ■会社別運用資産残高

（単位：億円）

	2006年 4月	2006年 5月	2006年 6月	2006年 7月	2006年 8月	2006年 9月	2006年 10月	2006年 11月	2006年 12月	2007年 1月	2007年 2月	2007年 3月
スパークス・アセット・マネジメント	16,452	15,223	15,231	14,925	15,521	13,303	12,920	12,748	13,794	13,703	13,476	12,825
Cosmo Investment Management	1,912	1,832	1,924	1,898	2,103	2,248	2,242	2,481	2,490	2,357	2,441	2,587
PMA Capital Management	n/a	n/a	2,615	2,588	2,616	2,659	2,582	2,552	2,545	2,417	2,354	2,370
合計	18,364	17,055	19,771	19,411	20,241	18,211	17,745	17,782	18,830	18,478	18,272	17,783

### ■投資戦略別運用資産残高

スパークス・アセット・マネジメント

（単位：億円）

	2006年 4月	2006年 5月	2006年 6月	2006年 7月	2006年 8月	2006年 9月	2006年 10月	2006年 11月	2006年 12月	2007年 1月	2007年 2月	2007年 3月
日本株式ロング・ショート戦略	3,308	3,186	3,183	3,007	3,133	3,153	3,082	3,050	3,074	3,004	2,921	2,704
日本株式集中投資戦略	870	800	777	728	720	683	655	656	645	629	624	620
ファンド・オブ・ファンズ投資戦略	515	504	502	706	718	721	728	728	772	747	745	751
日本株式一般投資戦略	6,795	6,144	6,176	6,013	6,266	4,421	4,172	4,148	4,690	4,725	4,615	4,247
日本株式中小型投資戦略	3,028	2,810	2,810	2,781	2,916	2,570	2,535	2,491	2,858	2,832	2,866	2,821
バリュース・クリエーション投資戦略	1,891	1,736	1,740	1,645	1,723	1,708	1,701	1,631	1,709	1,718	1,658	1,634
日本株式未公開株式投資戦略	43	41	41	42	42	42	44	42	44	44	44	44
合計	16,452	15,223	15,231	14,925	15,521	13,303	12,920	12,748	13,794	13,703	13,476	12,825

### Cosmo Invest Management

（単位：億円）

	2006年 4月	2006年 5月	2006年 6月	2006年 7月	2006年 8月	2006年 9月	2006年 10月	2006年 11月	2006年 12月	2007年 1月	2007年 2月	2007年 3月
韓国株式ロング・ショート投資戦略	247	286	301	316	333	333	331	352	360	371	382	398
韓国株式集中投資戦略	34	56	87	102	111	149	167	181	183	170	170	175
韓国株式一般投資戦略	622	581	609	560	597	640	603	678	652	555	563	581
韓国株式インデックス運用戦略	862	798	816	810	948	1,006	1,019	1,143	1,166	1,136	1,197	1,304
その他	117	108	109	108	113	118	119	125	128	123	126	128
合計	1,912	1,832	1,924	1,898	2,103	2,248	2,242	2,481	2,490	2,357	2,441	2,587

### PMA Capital Management

（単位：億円）

	2006年 4月	2006年 5月	2006年 6月	2006年 7月	2006年 8月	2006年 9月	2006年 10月	2006年 11月	2006年 12月	2007年 1月	2007年 2月	2007年 3月
アジア株式投資戦略	—	—	1,315	1,283	1,270	1,289	1,230	1,190	1,136	1,063	1,001	998
アジア・欧州株式投資戦略	—	—	1,203	1,208	1,245	1,266	1,252	1,264	1,309	1,262	1,263	1,273
アジア・マクロ投資戦略	—	—	96	96	99	103	100	97	99	91	89	99
合計	—	—	2,615	2,588	2,616	2,659	2,582	2,552	2,545	2,417	2,354	2,370

- 注) 1. 金額は時価純資産であり、表示単位未満を切り捨てて表示しています。なお、上記の金額は、月末時点の実際の運用に係る金額のみでなく、コミットメント・ベース等により契約上運用報酬の算定の対象となる金額がある場合は、これを含め表示しています。
2. Cosmo Investment Management Co., Ltd.は当社の連結子会社に該当するため、同社の経営成績・財務状態は当社持分である 51.9%に応じ連結数値に反映されます。
3. PMA Capital Management Co., Ltd.は当社の 100%子会社に該当するため、同社の経営成績・財務状態は連結数値に反映されます。
4. スパークス・アセット・マネジメントには SPARX International (Hong Kong) Limited の運用資産残高が含まれています。
5. 全ての数値は当社持分に係らず運用資産残高の 100%を記載しております。
6. PMA Capital Management の「アジア・マクロ投資戦略」は、アジアの株式・債券・為替・金利を投資対象とした戦略です。
7. 月末時点の為替レートをもとに計算を行っています。