

2007年度（2008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）

	2007年 4月	2007年 5月	2007年 6月	2007年 7月	2007年 8月	2007年 9月	2007年 10月	2007年 11月	2007年 12月	2008年 1月	2008年 2月	2008年 3月
スパークス・アセット・マネジメント	12,419	12,301	12,481	11,885	10,900	10,726	9,977	9,256	8,999	8,047	7,766	7,159
Cosmo	2,779	3,299	3,575	3,942	3,750	3,910	4,257	3,662	3,668	3,132	3,237	2,928
PMA	2,311	2,384	2,476	2,378	2,268	2,317	2,322	2,739	3,035	2,766	2,736	2,561
合計	17,510	17,985	18,533	18,206	16,920	16,954	16,557	15,657	15,704	13,946	13,740	12,649

■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）

	2007年 4月	2007年 5月	2007年 6月	2007年 7月	2007年 8月	2007年 9月	2007年 10月	2007年 11月	2007年 12月	2008年 1月	2008年 2月	2008年 3月
日本株式ロング・ショート戦略	2,527	2,458	2,406	2,254	1,919	1,894	1,767	1,721	1,613	1,510	1,471	1,310
日本株式集中投資戦略	630	598	611	594	564	562	585	570	555	528	534	525
ファンド・オブ・ファンズ投資戦略	748	776	832	824	855	906	917	853	871	782	824	701
日本株式一般投資戦略	4,091	4,088	4,117	3,974	3,630	3,571	3,296	3,000	2,957	2,651	2,629	2,431
日本株式中小型投資戦略	2,750	2,685	2,722	2,628	2,395	2,294	2,046	1,956	1,888	1,604	1,430	1,345
バリュース・クリエーション投資戦略	1,610	1,632	1,701	1,519	1,451	1,415	1,279	1,069	1,010	859	765	744
日本株式未公開株式投資戦略	41	41	70	69	65	62	66	61	55	52	55	53
その他	19	19	19	19	19	19	19	23	46	56	53	47
合計	12,419	12,301	12,481	11,885	10,900	10,726	9,977	9,256	8,999	8,047	7,766	7,159

Cosmo Invest Management

（単位：億円）

	2007年 4月	2007年 5月	2007年 6月	2007年 7月	2007年 8月	2007年 9月	2007年 10月	2007年 11月	2007年 12月	2008年 1月	2008年 2月	2008年 3月
韓国株式ロング・ショート投資戦略	397	460	525	547	515	518	517	480	501	445	451	409
韓国株式集中投資戦略	193	240	269	276	249	255	250	221	225	154	159	142
韓国株式一般投資戦略	656	828	974	1,105	1,076	1,108	1,271	1,018	969	812	831	742
韓国株式インデックス運用戦略	1,388	1,603	1,630	1,822	1,735	1,849	2,028	1,778	1,806	1,581	1,650	1,505
その他	143	167	175	189	173	178	188	163	165	138	144	128
合計	2,779	3,299	3,575	3,942	3,750	3,910	4,257	3,662	3,668	3,132	3,237	2,928

PMA Capital Management

（単位：億円）

	2007年 4月	2007年 5月	2007年 6月	2007年 7月	2007年 8月	2007年 9月	2007年 10月	2007年 11月	2007年 12月	2008年 1月	2008年 2月	2008年 3月
アジア株式投資戦略	990	999	1,048	1,042	979	987	1,010	1,498	1,727	1,565	1,547	1,417
アジア・欧州株式投資戦略	1,222	1,269	1,307	1,222	1,159	1,193	1,198	1,148	1,209	1,090	1,046	988
アジア・マクロ投資戦略	98	114	120	113	128	136	113	92	99	109	142	155
合計	2,311	2,384	2,476	2,378	2,268	2,317	2,322	2,739	3,035	2,766	2,736	2,561

- 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67.9%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. 国内投信「日興・スパークス・アジア中東株式ファンド」の運用資産残高については、「PMA Asia Middle East Equity Income Fund」への投資部分がPMA Capital Managementの「アジア株式投資戦略」に、同ファンドのそれ以外の部分がスパークス・アセット・マネジメントの「その他」に含まれます。
7. 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。
8. 月末時点の為替レートをもとに計算を行っています。