

2009年度(2010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)

	2009年 4月	2009年 5月	2009年 6月	2009年 7月	2009年 8月	2009年 9月	2009年 10月	2009年 11月	2009年 12月	2010年 1月	2010年 2月	2010年 3月
スパークス・アセット・マネジメント	3,151	3,313	3,400	3,405	3,221	3,087	2,810	2,576	2,627	2,617	2,362	2,783
Cosmo	2,126	2,121	2,046	2,276	2,131	2,196	2,055	1,973	2,296	2,160	2,091	2,419
PMA	1,443	1,440	1,529	1,460	1,435	1,378	1,438	1,346	1,412	1,391	1,373	1,415
合計	6,721	6,875	6,976	7,141	6,788	6,662	6,304	5,896	6,335	6,169	5,827	6,618

■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)

	2009年 4月	2009年 5月	2009年 6月	2009年 7月	2009年 8月	2009年 9月	2009年 10月	2009年 11月	2009年 12月	2010年 1月	2010年 2月	2010年 3月
日本株式ロング・ショート戦略	955	959	958	954	942	880	818	760	772	762	740	759
日本株式集中投資戦略	364	391	351	346	356	347	341	297	310	311	184	205
ファンド・オブ・ファンズ投資戦略	372	371	369	328	320	312	179	170	184	177	170	173
日本株式一般投資戦略	530	577	601	613	385	367	316	298	314	316	313	339
日本株式中小型投資戦略	871	954	1,064	1,106	1,160	1,124	1,099	995	985	990	894	1,253
その他	56	58	56	54	55	55	55	53	58	58	58	51
合計	3,151	3,313	3,400	3,405	3,221	3,087	2,810	2,576	2,627	2,617	2,362	2,783

COSMO Invest Management

(単位:億円)

	2009年 4月	2009年 5月	2009年 6月	2009年 7月	2009年 8月	2009年 9月	2009年 10月	2009年 11月	2009年 12月	2010年 1月	2010年 2月	2010年 3月
韓国株式ロング・ショート投資戦略	229	214	209	203	200	200	185	159	166	156	149	162
韓国株式集中投資戦略	90	96	91	102	106	111	107	98	117	105	103	120
韓国株式一般投資戦略	363	369	368	406	370	389	354	337	406	383	361	407
韓国株式インデックス運用戦略	1,362	1,361	1,298	1,474	1,366	1,401	1,316	1,289	1,505	1,422	1,384	1,622
その他	80	79	79	90	87	93	91	87	99	93	92	104
合計	2,126	2,121	2,046	2,276	2,131	2,196	2,055	1,973	2,296	2,160	2,091	2,419

PMA Capital Management

(単位:億円)

	2009年 4月	2009年 5月	2009年 6月	2009年 7月	2009年 8月	2009年 9月	2009年 10月	2009年 11月	2009年 12月	2010年 1月	2010年 2月	2010年 3月
アジア株式投資戦略	537	546	538	517	480	454	449	419	410	387	368	386
アジア・欧州株式投資戦略	730	718	728	648	629	610	578	535	580	550	556	582
アジア・マクロ投資戦略	175	176	172	202	194	184	187	179	188	177	174	153
その他	-	-	90	90	132	129	222	213	233	276	274	292
合計	1,443	1,440	1,529	1,460	1,435	1,378	1,438	1,346	1,412	1,391	1,373	1,415

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。
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。