

2010年度(2011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)

	2010年 4月	2010年 5月	2010年 6月	2010年 7月	2010年 8月	2010年 9月	2010年 10月	2010年 11月	2010年 12月	2011年 1月	2011年 2月	2011年 3月
スパークス・アセット・マネジメント	2,881	2,632	2,541	2,537	2,395	2,440	2,449	2,539	2,773	2,873	2,954	2,739
Cosmo	2,628	2,397	2,319	2,305	2,130	2,414	2,362	2,456	2,598	2,815	2,694	3,057
PMA	1,347	1,309	1,284	1,194	1,163	1,038	1,013	1,040	976	955	939	929
合計	6,857	6,339	6,144	6,038	5,689	5,893	5,825	6,035	6,348	6,644	6,588	6,726

■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)

	2010年 4月	2010年 5月	2010年 6月	2010年 7月	2010年 8月	2010年 9月	2010年 10月	2010年 11月	2010年 12月	2011年 1月	2011年 2月	2011年 3月
日本株式ロング・ショート戦略	746	733	701	705	695	701	681	678	705	718	731	702
日本株式一般投資戦略	334	302	291	292	275	279	264	265	271	309	311	257
日本株式中小型投資戦略	1,307	1,157	1,106	1,111	1,022	1,049	1,120	1,198	1,276	1,299	1,350	1,230
環境・グリーンテック投資戦略	—	—	—	—	—	—	—	—	224	245	255	251
その他	493	439	441	427	402	410	382	397	296	301	305	297
合計	2,881	2,632	2,541	2,537	2,395	2,440	2,449	2,539	2,773	2,873	2,954	2,739

COSMO Invest Management

(単位:億円)

	2010年 4月	2010年 5月	2010年 6月	2010年 7月	2010年 8月	2010年 9月	2010年 10月	2010年 11月	2010年 12月	2011年 1月	2011年 2月	2011年 3月
韓国株式ロング・ショート投資戦略	154	147	139	130	121	123	121	118	120	130	124	136
韓国株式集中投資戦略	134	117	116	121	96	105	93	94	96	103	99	120
韓国株式一般投資戦略	488	469	415	339	326	398	394	375	342	348	346	444
韓国株式インデックス運用戦略	1,738	1,567	1,552	1,615	1,571	1,770	1,752	1,867	2,038	2,233	2,123	2,355
その他	112	95	94	99	14	16	—	—	—	—	—	—
合計	2,628	2,397	2,319	2,305	2,130	2,414	2,362	2,456	2,598	2,815	2,694	3,057

PMA Capital Management

(単位:億円)

	2010年 4月	2010年 5月	2010年 6月	2010年 7月	2010年 8月	2010年 9月	2010年 10月	2010年 11月	2010年 12月	2011年 1月	2011年 2月	2011年 3月
アジア株式投資戦略	371	333	324	320	290	246	239	236	216	214	206	206
アジア・欧州株式投資戦略	519	463	444	384	368	292	264	277	265	248	251	254
アジア・マクロ投資戦略	156	163	157	128	162	157	178	178	167	155	145	124
その他	300	348	357	360	341	342	331	348	326	336	336	343
合計	1,347	1,309	1,284	1,194	1,163	1,038	1,013	1,040	976	955	939	929

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(2010年11月末の月末運用資産残高まで)。
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. 投資戦略の分類については、原則として、該当する投資戦略の当社グループ全体の月末運用資産残高に対する割合が1%を下回る場合には過去に遡及して「その他」に分類し、同1%を上回る場合には当該月末より独立して表示しております。この基準に基づき、「環境・グリーンテック投資戦略」については、2010年12月末より独立して表示しております。
7. 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。
8. 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。
9. 月末時点の為替レートをもとに計算を行っています。