



2020年2月7日

各位

スパークス・グループ株式会社
代表取締役社長 グループCEO 阿部 修平
(コード 8739 東証第一部)

2020年1月度(速報値)月末運用資産残高のお知らせ

当月の当社グループ全体の運用資産は前月末比で139億円減少(1.1%減少)し、1兆2,352億円となりました。

■投資戦略別運用資産残高

(単位:億円)

	2019年 2月	2019年 3月	2019年 4月	2019年 5月	2019年 6月	2019年 7月	2019年 8月	2019年 9月	2019年 10月	2019年 11月	2019年 12月	2020年 1月
日本株式	8,511	8,512	8,597	8,077	8,196	8,085	7,666	8,048	8,567	8,577	8,626	8,509
OneAsia	450	368	343	300	274	260	261	271	302	298	634	611
実物資産	1,861	1,862	2,000	2,051	2,224	2,223	2,223	2,223	2,197	2,197	2,112	2,112
未来創生	1,073	1,113	1,113	1,113	1,113	1,113	1,113	1,118	1,118	1,118	1,118	1,118
合計	11,897	11,856	12,054	11,542	11,808	11,682	11,264	11,661	12,185	12,191	12,491	12,352

(※) 投資戦略別運用資産残高に変更した理由

当社グループは、市場に影響されない安定的な投資戦略と収益性の高い投資戦略によるハイブリッドのビジネスモデルを強化・拡大して成長することを目指しており、現在「日本株式」、「OneAsia」、「実物資産」及び「未来創生」の投資戦略を4本の柱としております。

つきましては、この4本の柱に分けて月末運用資産残高をお伝えするため、今月より投資対象地域別から投資戦略別に変更して開示致します。

(注)

1. 月末運用資産残高(速報値)は、当社グループの収益の大半を占める投信・投資顧問料収入等のベースとなるものであるため、通常は毎月月初より5営業日までに開示いたします。
2. 当社グループの運用資産残高は、お客様からお預かりして当社グループが運用している資産等であり、当社が直接保有する資産等ではありません。
3. 当社グループの運用資産残高は、運用パフォーマンスによる増減のほか、外貨建ての運用資産残高を日本円に換算することによる為替変動、ファンドの設定・解約等によっても増減いたします。
4. 当社グループの運用資産残高は、当社運用子会社であるスパークス・アセット・マネジメント株式会社、スパークス・アセット・トラスト&マネジメント株式会社、スパークス・AI&テクノロジーズ・インベストメント株式会社、SPARX Asset Management Korea Co., Ltd.及びSPARX Asia Capital Management Limitedによる運用資産残高で構成され、加えてスパークス・グリーンエナジー&テクノロジー株式会社が管理する発電所等の資産も含めております。
5. 上記の数値は、残高報酬の算定の基礎となる時価純資産額・コミットメント額等であり、表示単位未満を切り捨てて表示しております。
6. 前月末の数値は、社内資料に基づく速報値であり、当該速報値は、毎翌月に外部資料と照合の上、確定値に調整、移行しております。
7. 「実物資産」に含まれる「日本再生可能エネルギー投資戦略」の運用資産残高は、ファンドの投資対象となる発電所設備等資産の取得価額を掲載しております。これは、当社グループが受取る報酬は、当該エクイティ出資額をベースとする投資顧問料収入だけでなく、当該取得価額をベースとする発電所等管理報酬も、契約に応じて毎月定額を受取っているためです。
8. 「OneAsia」には同一のファンドで日本株式とアジア株式の両方に投資するファンドが含まれております。

(ご参考)

なお、変更前の投資地域別運用資産残高による内訳は、以下の通りとなります。

■投資対象地域別運用資産残高

(単位:億円)

	2019年 2月	2019年 3月	2019年 4月	2019年 5月	2019年 6月	2019年 7月	2019年 8月	2019年 9月	2019年 10月	2019年 11月	2019年 12月	2020年 1月
日本	11,446	11,487	11,710	11,241	11,533	11,422	11,003	11,389	11,882	11,892	11,857	11,740
韓国	169	141	125	118	94	86	104	111	137	140	485	469
アジア全域	281	227	217	182	180	173	156	159	165	158	149	141
合計	11,897	11,856	12,054	11,542	11,808	11,682	11,264	11,661	12,185	12,191	12,491	12,352

■投資戦略別内訳

日本

(単位:億円)

	2019年 2月	2019年 3月	2019年 4月	2019年 5月	2019年 6月	2019年 7月	2019年 8月	2019年 9月	2019年 10月	2019年 11月	2019年 12月	2020年 1月
日本株式ロング・ ショート投資戦略	461	461	389	328	330	339	333	366	375	380	363	406
日本株式 長期厳選投資戦略	4,907	5,063	5,199	4,921	5,046	5,050	4,785	5,091	5,436	5,448	5,455	5,344
日本株式 中小型投資戦略	2,145	2,033	2,024	1,883	1,881	1,879	1,776	1,815	1,975	1,980	2,052	1,965
日本株式マーケット・ ニュートラル投資戦略	389	427	476	492	501	500	460	458	452	429	411	404
日本株式 サステナブル投資戦略	413	414	426	402	409	297	296	312	326	337	344	388
日本不動産投資戦略	331	331	331	331	331	331	331	331	305	305	221	221
日本再生可能エネルギー 投資戦略	1,529	1,530	1,668	1,719	1,892	1,892	1,892	1,892	1,892	1,892	1,891	1,891
未来創生投資戦略	1,073	1,113	1,113	1,113	1,113	1,113	1,113	1,118	1,118	1,118	1,118	1,118
その他	195	112	81	49	27	17	15	4	—	—	—	—
合計	11,446	11,487	11,710	11,241	11,533	11,422	11,003	11,389	11,882	11,892	11,857	11,740

韓国

(単位:億円)

	2019年 2月	2019年 3月	2019年 4月	2019年 5月	2019年 6月	2019年 7月	2019年 8月	2019年 9月	2019年 10月	2019年 11月	2019年 12月	2020年 1月
韓国株式 アクティブ投資戦略	39	11	11	18	18	18	40	45	69	73	425	412
韓国株式アソシエイト・ リターン投資戦略	66	68	52	40	12	6	6	7	6	7	12	12
その他	62	61	61	58	62	60	57	58	60	60	46	45
合計	169	141	125	118	94	86	104	111	137	140	485	469

アジア全域

(単位:億円)

	2019年 2月	2019年 3月	2019年 4月	2019年 5月	2019年 6月	2019年 7月	2019年 8月	2019年 9月	2019年 10月	2019年 11月	2019年 12月	2020年 1月
アジア株式投資戦略	281	227	217	182	180	173	156	159	165	158	149	141
合計	281	227	217	182	180	173	156	159	165	158	149	141

■ 各種マーケット指標

	2019年12月	2020年1月	変動率
日経平均株価	23,656.62	23,205.18	▲1.91%
東証株価指数	1,721.36	1,684.44	▲2.14%
JASDAQ インデックス	174.09	169.10	▲2.87%
韓国総合株価指数	2,197.67	2,119.01	▲3.58%
KOSDAQ 指数	669.83	642.48	▲4.08%
香港ハンセン指数	28,189.75	26,312.63	▲6.66%
韓国ウォン/日本円レート	0.0939	0.0909	▲3.22%
米国ドル/日本円レート	108.67	108.38	▲0.27%

■ 本件に関するお問い合わせ先

スパークス・グループ株式会社 経営管理部

TEL : 03-6711-9100 / FAX : 03-6711-9101