



STATE STREET

ご 参 考

報道関係者各位

2006年8月23日

8月の投資家信頼感指数が83.1に低下

(この報道発表資料は、2006年8月22日に米国ボストンで発表されたものの翻訳版です)

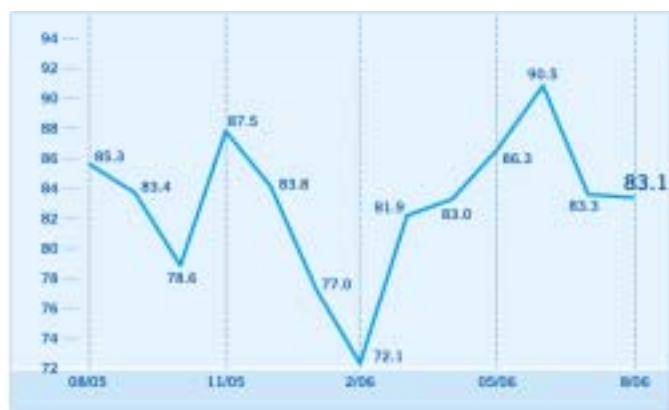
【米国ボストン発】 ステート・ストリート・コーポレーション (NYSE:STT) のリサーチおよびトレーディング部門であるステート・ストリート・グローバル・マーケットスは、2006年8月の投資家信頼感指数[®]を発表しました。

8月の指数によると、投資家信頼感は7月の83.3(改定値)から僅かに0.2ポイント低下し83.1になりました。地域別では、北米が98.1(改定値)から95.2へ低下しました。アジアでは81.1(改定値)から86.5へ、ヨーロッパでは85.4(改定値)から88.4へ上昇しました。

投資家信頼感指数[®]は、ステート・ストリート・グローバル・マーケットスのリサーチ部門であるステート・ストリート・アソシエイツ(SSA)において、ハーバード大学のケン・フルート教授とSSAのディレクターであるポール・オコネルにより開発されました。投資家信頼感を定量的に測定し、機関投資家の実際の売買パターンを分析する同指数は、リスクに対する投資家センチメント、つまり、ポートフォリオに株式を組み込む意欲の変化の持つ意味を正確に読み取る金融理論に基づいています。機関投資家がポートフォリオに組み込む株式の割合が大きいほど、彼らのリスク選好度または信頼感は高いこととなります。

「バーナンキ氏が利上げを据え置いたことで、世界的に株価が上昇してきました」とフルート教授は述べています。「わが社が10,000社余りの機関投資家のポートフォリオ策定データに基づき算出したリスク選好度は、この利上げ休止を織り込んで、過去5ヶ月にわたって堅調に上昇してきました。しかし、直近では、投資家はさらなるリスクを取ろうとしていません。彼らは現在の上昇相場に照準を合わせており、利上げが再開した時点でリスクを削減し始める可能性があります」

「実際、米国の投資家は今年前半にポートフォリオ・リスクを大幅に拡大させましたが、過去2ヶ月にわたり急激にリスクを削減しているようです。」とオコネルは述べています。「特に、過去2ヶ月、彼らの米国市場に対するエクスポージャーは価格とともに上昇しています。対照的にアジアおよびヨーロッパの投資家は、米国株式への配分は比較的少ないものの、そのエクスポージャーを増加させています。これは、投資家がFEDによる再利上げの必要性を楽観視している一方で、中東情勢を背景にした他市場との経済的・地政治学的な問題を懸念していることを示唆しています。」



8月の投資家信頼感指数

グローバル	83.1
北米	95.2
ヨーロッパ	88.4
アジア太平洋	86.5

2003年9月に公表が開始されて以来、ステート・ストリートの投資家信頼感指数[®]は、アセット・オーナーや投資マネジャー、そして各国中央銀行にとって主要な経済指標の一つになりました。同指数は、世界の機関投資家に共通する投資パターンを追録する唯一の定量的測定値であり、多数の機関投資家や彼らの投資行動・判断に関する情報を独自の視点から提供します。

ステート・ストリート・グローバル・マーケットについて

ステート・ストリート・グローバル・マーケットは、アセット・マネジャーやアセット・オーナーのポートフォリオ価値の維持・向上を目指し、為替、株式、債券およびデリバティブ商品に関するインベストメント・リサーチおよびトレーディング・サービスを提供しています。世界市場のクロスロードとしての特殊な地位を利用し、フローベースのリサーチや革新的なポートフォリオ戦略の提供、トレード・プロセスの最適化や複数の資産クラスやマーケットをグローバルにつなげる等、顧客に付加価値を提供しています。

ステート・ストリート・グローバル・マーケットのリサーチ・チームは、第一線で活躍する研究者や業界の専門家で構成されています。顧客が旧来型の思考に挑み、アイデアを生み出し、より多くの情報に基づいた投資判断を行い、測定可能な成果を享受することができるように、独自の投資家行動研究の理論および応用や、画期的なポートフォリオおよびリスク・マネージメントの技術など、科学の持続的発展に向けた取り組みを進めています。

ステート・ストリート・アソシエイツについて

1999年、マサチューセッツ州ケンブリッジに設立されたステート・ストリート・アソシエイツは、ポートフォリオおよびポートフォリオ・フロー・リサーチ、為替管理、資産配分サービスなどを開発し、世界のポートフォリオ・マネジャーのニーズを支援するための投資戦略ツールを提供しています。

ステート・ストリートの投資家信頼感指数[®]について

ステート・ストリート投資家信頼感指数[®]は毎月、月末から2週間前の火曜日、ボストンにて東部時間午前10時に公表され、全世界に配信されます。ステート・ストリート投資家信頼感指数に関するより詳細な情報および公表日程は、www.statestreet.com/investorconfidenceindex をご参照ください。前月発表された指数は報告対象期間の最終日の取引量を調整して改定されます。

ステート・ストリート・コーポレーションについて

ステート・ストリート・コーポレーション (NYSE: STT) は、世界の機関投資家を対象に、資産管理や資産運用サービス、インベストメント・リサーチとトレーディング・サービスを提供する世界有数の金融機関です。10.9兆ドルのカスタディー資産と1.5兆ドルの運用資産を有し、世界26ヶ国、100以上の地理的市場で業務を展開しています (2006年6月30日現在)。詳細については、ステート・ストリートのウェブサイト www.statestreet.com をご参照ください。

このプレス・リリースには、米連邦証券法の下で「将来の展望に関する表明」と称される情報が含まれている。同情報は、現在の諸予想に基づいて作成されたものであり、数多くのリスクや不確定要素を含んでいる。こうした重要要因の中には、ステート・ストリートの新規顧客の獲得及び既存顧客へのサービス拡大の速度、世界及び地域の金融市場の価値、国際間での投資活動の速度や金利の変動、世界的な経済成長の速度及びインフレ率の速度、為替市場の変動の規模、顧客と競合相手間の整理統合、ステート・ストリートの事業内容、ステート・ストリートがサービスを提供する市場の動態、それにステート・ストリートが買収した企業の統合・転換の成功等が含まれる。本プレス・リリースの中に記された業績見通し内容と実績が大きく乖離する原因となり得る重要要因については、当社の2005年度年次報告書、および追って証券取引委員会 (SEC) に提出される文書の中に記載されている。投資家の皆様には、いかなる投資判断を決定されるよりも前に、弊社の年次報告書、特に財務結果に影響しかねない要因についての項目、及びその後SECに提出した追加的な情報に関する報告書に目を通されることをお奨めします。このプレス・リリースにおける業績見通しは、2006年8月22日現在のものであり、この日付以降に生じる出来事や動きを反映した「将来の展望に関する表明」の改訂版を出すことを保証するものではありません。

お問い合わせ

ステート・ストリート広報デスク
平井 / 武藤 (バーソン・マーステラ)
TEL: 03-3264-6701