

報道関係各位:

12月の投資家信頼感指数は11月の54.5から48.0に低下

(この報道発表資料は、2008年12月23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)のリーサー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・マーケットは、2008年12月の投資家信頼感指数®を発表しました。

12月の指数は、11月の改定値54.5から6.5ポイント低下し48.0になりました。とりわけ、北米市場では11月の改定値45.3から30.1へ急落しました。欧州市場も北米市場ほどではありませんが、指数が11月の改定値72.5から67.4に低下しました。一方、アジア市場はこうしたトレンドに抵抗し、11月の82.2から86.1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・マーケットのリーサー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・オコネルによって開発されました。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くほど、彼らのリスク選好度または信頼感が高いこととなります。

「11月は小幅な低下にとどまりましたが、12月は投資家信頼感指数が急落し、一部ではリスク資産に対する配分を過去10年間では最も大きく見直す(配分比率を引き下げる)動きがありました」とフルート教授は述べています。「12月の指数計測期限の12月17日直前の数日間には売りが一服したものの、12月全体を通して幅広い売りが見られました。機関投資家の間では、最近の政策措置によって2009年にはデフレや景気減速の鮮明化を十分に阻止できるのか不安視する動きが解消されていないように思われます」

「10月31日以来、定量分析に基づく各種の数値は、北米の機関投資家を筆頭に、機関投資家がほぼ3日に2日の頻度でレバレッジを引き下げてきたことを明らかにしています」とオコネルは述べています。「最新の投資家信頼感指数の低下は、この間、株価が小幅ながら上昇しただけにやや予想外でした。これは、機関投資家がリスク選好度を高めてきた他の市場参加者に対して流動性を供給する側に回っている可能性を示唆しています」





12月の投資家信頼感指数

グローバル	48.0
北米	30.1
ヨーロッパ	67.4
アジア太平洋	86.1

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。14兆ドルのカस्टディー資産と1.7兆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 (2008年9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、米国連邦証券諸法の下で「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2007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、2008年12月23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・ストリート広報部

亀井

TEL: 03-4530-7104

###