

報道関係各位:

1月の投資家信頼感指数は12月の48.2から60.3に上昇

(この報道発表資料は、2009年1月20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・マーケットは、2009年1月の投資家信頼感指数®を発表しました。

1月の指数は12月の改定値48.2から12.1ポイント上昇して60.3となりました。北米市場では過去最低値を記録した昨年12月の30.6から51.8へ21.2ポイント上昇し、今回の上昇を牽引しました。欧州市場も66.3から73.0へ6.7ポイント回復しました。一方、12月に指数の上昇を記録したアジア市場はほぼ横ばいで、12月の86.6から86.3へ小幅な低下にとどまりました。

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。

「1月の投資家信頼感指数は2007年8月以来の高い上昇率を記録しました」とフルート教授は述べています。「昨年12月に過去最低値を更新したこともあり、今月同指数が大幅上昇したのはそれほど意外ではないでしょう。昨年の第4四半期に比べると1月は機関投資家の間でリスク資産を選好する動きが強まりましたが、このリアロケーションが資産価値に対する長期的なスタンスの変化を示すと判断するには時期尚早です。」

「1月の数値では、北米市場の回復が最も際立っています」とオコネルは述べています。「これは、市場見通しが大幅に好転したことを表しています。年が変わりリスク資産の組入比率を見直したことも指数の上昇を招いた一因ですが、一連の政府の金融対策を受けて、機関投資家の間でシステミック・リスクがやや後退したと認識されていることも事実です。」





1月の投資家信頼感指数

グローバル	60.3
北米	51.8
ヨーロッパ	73.0
アジア太平洋	86.3

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。12兆ドルのカストディー資産と1.4兆ドルの運用資産を有し、世界27ヶ国、100以上の地理的市場で業務を展開しています (2008年12月31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、2009年1月20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

###