

報道関係各位

3月の投資家信頼感指数は2月の72.7から70.0に下落 ステート・ストリートは投資家信頼感指数の内容をさらに充実させると発表

この報道発表資料は、2009年3月24日に米国ボストンで発表されたものの翻訳版です。
その正確な内容につきまして、正文をご参照ください。翻訳に関する責任を負いかねますのでご注意ください。

【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・マーケッツは、2009年3月の投資家信頼感指数®を発表しました。

3月の指数は2月の改定値72.7から2.7ポイント下落し70.0となりました。北米市場ではこのところの急激な上昇を受けて調整局面を迎え、2月から4.8ポイント下落し59.4となりました。欧州市場が64.5へ3.2ポイント下落した一方、アジア市場は86.6へ2.5ポイント上昇したことで証明されているとおり、そのほかの地域はまちまちの展開となりました。

「様々な分野で調整がかなり進んできたことに加え、米FRBと米財務省の権限と裁量権が拡大されてきたため、実体経済が急激に悪化する状況は終息しつつあるという見方が機関投資家の間に広がっています」とハーバード大学のフルート教授は述べています。「もちろん、依然として高いリスクが残っていますが、投資家は巨額の現金を蓄積する動きが突然転換される可能性に備えて置く必要があります。米FRBが金融システムに注入した金額の大きさを勘案すると、相場は大幅に上昇する可能性があります。機関投資家はこうした動きを見極めるとともに、リスクに対しては保守的な姿勢を弱めているように見えます」

「昨年12月に史上最低の30.6まで下落して以来、北米市場の指数は過去3ヵ月で大幅に反発してきたため、3月に反落したことはそれほど驚くべきことではありません」とステート・ストリート・アソシエイツのポール・オコネルは述べています。「事実、米国大型株がこの10日間上昇してきたことで北米の機関投資家は有利な立場にあると言ってよいでしょう。投資家信頼感指数が安値圏で低迷している欧州市場の事情はやや異なっていますが、これは北米市場と欧州市場における政府の対応のスピードの違いを反映したものです」

投資家信頼感指数®は、ステート・ストリート・グローバル・マーケッツ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、ケン・フルート教授とポール・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。

2009年5月26日以降、ステート・ストリートの投資家信頼感指数は内容を充実し、機関投資家のリスク選好度に関する追加情報の提供を目指します。今後、同指数の基準が新たに設定され、指数が100を上回る場合には機関投資家がリスク資産に対するエクスポージャーを増加していることを示す一方、指数が100を下回る場合にはリスク資産に対するエクスポージャーを削減していることを示すようになります。今回の基準見直しはグローバル指数と地域別のサブ指数について個別に行われます。さらに、指数の発表日は暦月と暦四半期の動きを整合させるため、各月の最終火曜日に変更されます。



3月の投資家信頼感指数

グローバル	70.0
北米	59.4
ヨーロッパ	64.5
アジア太平洋	86.6

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。2009年5月より、指数の発表日は暦月と暦四半期の動きを整合させるため、各月の最終火曜日に変更されます。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。

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3月24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

榊原

TEL: 03-4530-7487