

報道関係各位

5月の投資家信頼感指数は4月の103.2から106.3に上昇

この報道発表資料は、2009年5月26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・マーケッツは、2009年5月の投資家信頼感指数®を発表しました。

5月の指数は4月の改定値である103.2から3.1ポイント上昇しました。北米市場の上昇幅が最も大きく、4月の95.3から104.9へ9.6ポイント、欧州市場でも指数は大幅に上昇し、4月の76.8から84.3へ7.5ポイント、それぞれ上昇しました。しかし、アジア市場ではリスク選好度がやや後退し、指数は4月の98.0から93.1へ4.9ポイント低下しました。

投資家信頼感指数®は、ステート・ストリート・グローバル・マーケッツのリー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、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、投資家のリスク選好度の変化、つまりポートフォリオに株式を組み込む意欲の変化に正確な意味をつけ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。

「今月より当社は投資家信頼感指数を改定し、リスク許容度を計測する精度がさらに高まりました」とフルート教授は述べています。「特に、指数の基準値を見直し、100を「ニュートラル」としました。指数が100を上回る場合は機関投資家がリスク資産のポートフォリオへの組み入れを増加、下回ると減少させていることを表しています。4月までは7ヵ月にわたり同指数は100を割り込んできましたが、5月に106.3まで上昇したことは、4月に機関投資家の間でリスク・テイクの動きが復活してきたことを裏付けるものです」

「地域別に見ても、今回投資家信頼感指数の基準値を改定したことで、リスク選好度を測る新たな視点が加わりました」とオコネルは述べています。「北米の投資家のリスク許容度は、ポートフォリオ内でリスク資産を増額させ



るところまで上昇していますが、欧州とアジアではやや事情が異なり、数カ月前に比べると信頼感が高まってきてはいますが、投資家は依然として慎重な姿勢を崩していません」



5月の投資家信頼感指数

グローバル	106.2
北米	104.9
ヨーロッパ	84.3
アジア太平洋	93.1

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、毎月最終火曜日の米国東部時間午前10時にボストンにて公表され、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、<http://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。11.3兆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(2009年3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ます。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ます。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ます。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 2008 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ます。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 5 月 26 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 優

Tel: 03-4530-7487

Email: ysakakibara@jp.statestreet.com