

報道関係各位

10月の投資家信頼感指数は9月の118.4から108.4に低下

この報道発表資料は、2009年10月27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・マーケットスは、2009年10月の投資家信頼感指数®を発表しました。

10月の投資家信頼感指数は、9月の改定値118.4から10.0ポイント低下して108.4となりました。最も下落幅が目立ったのは北米市場で、9月の113.9から101.1へ12.8ポイント低下しました。欧州市場も北米市場に追随し、9月の111.1から101.8へ9.3ポイント低下しました。対照的に、アジア市場はリスクに対する前向きな姿勢がやや強まり、指数は92.9から95.3へ上昇しました。指数の100という数値はニュートラルな水準を表し、機関投資家がリスク資産の組入れを増減させていないことを示しています。

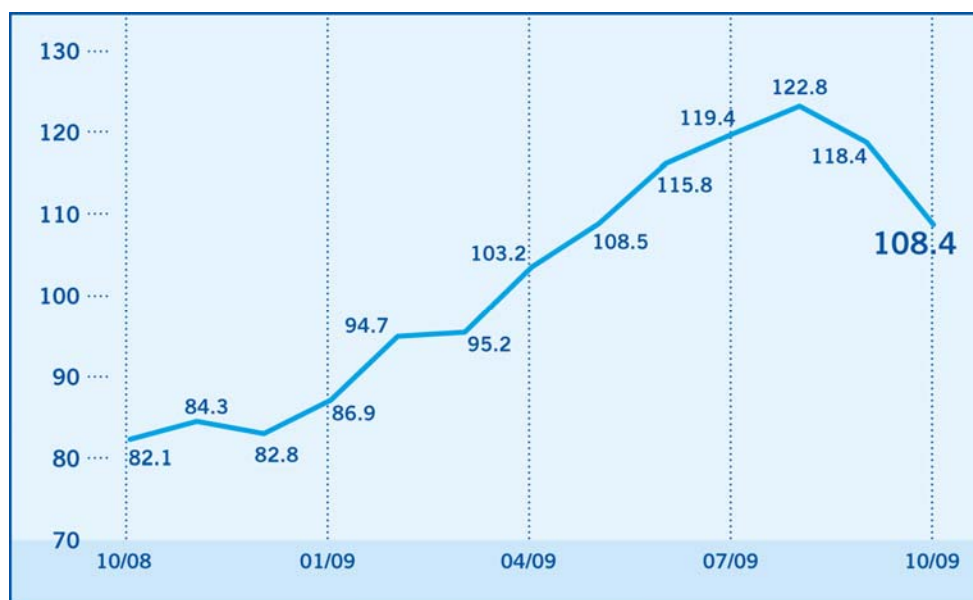
投資家信頼感指数®は、ステート・ストリート・グローバル・マーケットスのリーサー部門であるステート・ストリート・アソシエイツ(SSA)において、ハーバード大学のケン・フルート教授とSSAのダイレクターであるポール・オコネルによって開発され、機関投資家の実際の売買パターンを分析することによって投資家信頼感を定量的に測定したものです。この指数はサーベイの結果ではなく、事実に基づいています。この指数は、投資家のリスク選好度の変化、つまりポートフォリオに株式を組み込む意欲の変化の持つ意味を正確に読み取る金融理論に基づいています。機関投資家がポートフォリオに組み込む株式の割合が大きいほど、彼らのリスク選好度または信頼感が高いことになります。

「10月に入り機関投資家は株式への投資を一時的に手控えました」とフルート教授は指摘しています。
「10月の投資家信頼感指数は108.4で、7カ月連続してニュートラル・レベルの100を大きく上回ってい



ますが、7月や8月の非常に高い水準であった頃に比べると、株式市場に流入する資金はやや勢いを失っています。直近の米国企業の決算発表は比較的順調な業績回復を示していますが、雇用統計、小売売上高、製造業統計や貿易統計に見られた明るいニュースは大幅に減少しており、これが投資家のリスク選好度に影響を与えた模様です。」

「地域別のデータを見ると、北米機関投資家による外国株(とりわけ、日本株と英国株)保有増加の意欲が後退してきています」とオコネルは述べています。「同時に、米国外からの米国株式市場に対する関心は高まっています。夏場に比べ機関投資家の投資市場の選別色が強まってきているほか、国別の見通しとファンダメンタルズの緩やかでも着実な回復のバランスを模索している中で、投資環境はさらに複雑になっています。」



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、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。17.9 兆ドルのカストディー資産・管理資産と 1.7 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 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 10 月 27 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

###