

報道関係各位

12月の投資家信頼感指数は11月の100.8から103.9に上昇

この報道発表資料は、2009年12月29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12月の投資家信頼感指数®を発表しました。

12月の投資家信頼感指数は11月の100.8から3.1ポイント上昇して103.9となりました。アジア市場では、11月の91.2から6.3ポイント回復し、97.5となりました。アジア市場以外では信頼感指数は大幅横這いでした。北米市場の投資家信頼感指数は102.2から103.1へと緩やかに上昇し、欧州市場ではリスク選好度が104.8から104.6へと若干低下しました。

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のディ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は高いこととなります。

「今月の投資家信頼感指数の上昇は、リスク選好度が過去8カ月の最高値を記録したアジア市場のムード改善が大きく寄与しています」とフルート教授は指摘しています。「他の地域では、ポートフォリオ再配分は小幅に留まっています。4つの指数のうち3つがニュートラルを示す100を超えており、機関投資家は年初よりも若干遅めのペースながらもリスク資産の積み増しを続けていると言えるでしょう。投資家は2010年に向けた大幅な再配分を行う前に、新たな経済成長や政策当局の適切に策定された出口戦略の兆しを注視しています」

「この一年を通じ、投資家信頼感指数は株価、消費マインドや投資家期待度調査などの指標に先行して、12ヶ



月前の歴史的な低レベルから有意義な回復を遂げました」とオコネルは述べています。「実際に機関投資家のリスク資産配分を定量的に測定した結果、わが社の指数は機関投資家が今年一年、リスク選好度の上昇に先回りをして行動してきたことを示しています」



ステート・ストリート・グローバル・マーケッツについて

ステート・ストリート・グローバル・マーケッツは、アセット・マネージャーやアセット・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・マーケッツのリサーチ・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12月29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

###