

報道関係各位

2月の投資家信頼感指数は1月の104.6から103.9に低下

この報道発表資料は、2010年2月23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2010年2月の投資家信頼感指数®を発表しました。

2月の投資家信頼感指数は、全体では、1月の改定値104.6をわずかに0.7ポイント下回る103.9に低下しました。1月と同じく、北米市場ではムードが好転し、2月の投資家信頼感指数は1月の改定値108.0から111.3に3.3ポイント上昇しました。欧州市場でも指数が小幅に上昇し、1月の改定値99.0を2.1ポイント上回る101.1に落ち着きました。対照的に、アジア市場では投資家の間で株式投資に慎重な姿勢が強まったため、1月の98.1から97.0に低下しました。

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、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が高いこととなります。

「今月も機関投資家は競合するさまざまな要因のバランスを取りながらリスク配分を行いました」とフルート教授は指摘しています。「依然として EU 周辺国の長期的な債務返済能力を巡る懸念が増大していることから、欧州市場の動向に多くの関心が注がれました。先日の米 FRB によるは公定歩合の引上げは、2月の投資家



信頼感指数データの集計後に実施されましたが、機関投資家はこの FED の政策、さらにはそれが欧州・北米市場の相対的な投資見通しに与える影響を予想していたようです」

「今月前半、投資家のセンチメントはギリシャの財政問題にやや過剰に反応したようです」とオコネルは述べています。「しかし今月末に向け、彼らの欧州財政問題に対する反応に微妙な相違が現われてきました。これに加え、米国のマクロ経済指標および企業決算が比較的良好だったことを受け、北米市場の投資家はリスク資産の組入比率を全体的に引き上げました。一方、アジア市場の投資家信頼感は小幅低下したものの、依然として 08 年 9 月の水準を維持しており、過度な悲観論が広がっているとは言えないでしょう」



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。18.8兆ドルのカストディー資産・管理資産と1.9兆ドルの運用資産を有し、世界25ヶ国、100以上の市場で業務を展開しています(2009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、2010年2月23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

###