

報道関係各位

**ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズと  
バークレイズのクオンティタティブ・ポートフォリオ・ストラテジー(QPS)が、  
システムティックなアクティブ債券運用における提携を発表**

**【2022年10月17日、東京】** ステート・ストリート・コーポレーション (NYSE : STT) の資産運用部門であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズは10月13日 (米国東部時間) 、バークレイズのリサーチ部門との提携を発表しました。この提携により、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズはシステムティックなアプローチによる一連のアクティブ債券運用戦略を開発・運用する予定です。

今回の提携により、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズは、バークレイズ・クオンティタティブ・ポートフォリオ・ストラテジー (バークレイズ QPS) チームが作り出したシステムティック戦略インデックスから得られたデータを活用し、投資商品および戦略の開発・運用を行っていきます。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズの債券・キャッシュ・為替担当 最高投資責任者であるマシュー・ステナウェイは、「バークレイズ QPS チームと協力することで、それぞれの組織の強みを活かし、債券運用の未来像につながるアクティブ運用の債券商品ラインナップを構築することができる」と述べています。

「過去 10 年間で、債券はより高い流動性を持ち、より効率的に取引されるようになってきた。先ごろ発表した『[債券投資の未来像](#)』レポートでは、回答者の半数近くが、市場の効率化が進むことで、アクティブ運用戦略が付加価値をつけることがより難しくなっていると考えている」とステナウェイは続けています。

このような背景から、ミスプライシングを発見するための徹底したデータ分析によってアルファを生み出すシステムティックな債券戦略や商品は、債券のアクティブ運用に成果を求める投資家にとって魅力的な選択肢であり、これから成長していく環境が整っていると言えます。ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズのレポート「[債券投資の未来像](#)」によると、機関投資家の 91% が今後 12 ヶ月間にシステムティックな債券戦略を利用する意欲を示しており、中でも投資適格社債とハイイールド社債が最も魅力的なセグメントであるとされています。

バークレイズのリサーチ部門責任者であるジェフ・メリ氏は、次のように述べています。「ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズとこの革新的なアプローチで協働できることを嬉しく思っている。ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズの規律あるポートフォリオ運用の強みと、バークレイズ QPS のリサーチの強みを組み合わせることで、両者の中核的な強みを発揮させ、投資家が革新的なシステムティックな債券戦略から利益を得ることを可能にするだろう。」

**ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ**は、1兆ドルを超える債券、キャッシュ、通貨の運用資産を有し<sup>1</sup>、うち約5,000億ドルがインデックス型債券です。債券市場のリスクと流動性に対する深い理解と、高度なトレーディングおよびポートフォリオ構築

の専門知識を組み合わせ、お客様の投資目的の達成に貢献しています。同社は、このたびの事業提携に、長年にわたる債券分野での投資商品のイノベーション、シスマティックな投資、そしてグローバルな営業ネットワークをもたらします。

**パークレイズ QPS** は、定量的ポートフォリオ・リサーチにおけるリーダーです。Institutional Investor 紙における債券リサーチ・チームの調査において首位を誇り、シスマティック投資に関する4冊の書籍を執筆しています。パークレイズ QPS は、過去30年にわたり、債券ポートフォリオの運用に使用される独自の手法をいくつも開発し、そのなかには業界標準となったクレジット・ポートフォリオのリスクに関する革新的な測定指標が含まれます。

1. 2022年6月30日現在の運用資産額、FICC 1.04兆ドル、うちインデックス債券 4,991億ドル

### ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズについて

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズは、過去40年にわたり、各国政府や機関投資家、金融プロフェッショナルの皆様へ資産運用サービスをご提供しています。厳密なリサーチや分析、厳しいマーケット環境における経験を礎としたリスク考慮型アプローチをもとに、アクティブからインデックス戦略まで幅広く、コスト効率に優れたソリューションを提案いたします。そしてスチュワード（受託者）として、社会、環境への配慮が長期的な成果をもたらすということをお客様に理解を深めていただくよう努めています。インデックス運用とETF、ESG投資の先駆者として、投資における新しい世界を常に切り拓き、約3.48兆ドル<sup>2</sup>を運用する世界第4位<sup>3</sup>の資産運用会社へと成長しています。

2. 2022年6月末時点、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ファンズ・ディストリビューターズ・エルエルシー（「SSGA FD」）が営業を行っているSPDRの残高約664.3億ドルを含みます。SSGA FDはSSGAの関連会社です。
3. Pensions & Investments Research Center、2021年12月末時点。

【本件に関するお問い合わせ先】

ステート・ストリート 広報部 [Japan\\_Corp\\_Comms@jp.statestreet.com](mailto:Japan_Corp_Comms@jp.statestreet.com)

### ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

東京都港区虎ノ門 1-23-1 虎ノ門ヒルズ森タワー25階 Tel: 03-4530-7152

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第345号

加入協会：一般社団法人 日本投資顧問業協会、一般社団法人 投資信託協会、日本証券業協会

### Barclays Index License Disclaimer

Neither Barclays Bank PLC ('BB PLC') nor any of its affiliates (collectively 'Barclays') is the issuer or producer of the products referenced herein and Barclays has no responsibilities, obligations or duties to investors in such products. The Barclays Indices referenced herein (collectively, the 'Indices'), together with any Barclays indices that are components of such Indices, are trademarks owned by Barclays and, together with any component indices and index data, are licensed for use by State Street Global Advisors as the producer of the products referenced herein (the 'Product Provider').

Barclays' only relationship with the Product Provider in respect of the Indices is the licensing of the Indices, which are administered, compiled and published by BB PLC in its role as the index sponsor (the 'Index Sponsor') without regard to the Product Provider or the products referenced herein or investors in such products. Additionally, State Street Global Advisors as Product Provider may for itself execute transaction(s) with Barclays in or relating to the Indices in connection with such products. Investors acquire such products from the Product Provider and investors neither acquire any interest in the Indices nor enter into any relationship of any kind whatsoever with Barclays upon making an investment in such products. The products referenced herein are not sponsored, endorsed, sold or promoted by Barclays and Barclays makes no representation regarding the advisability of such products or use of the Indices or any data included therein. Barclays shall not be liable in any way to the Product Provider, investors or to other third parties in respect of the use or accuracy of the Indices or any data included therein.

Barclays intends to engage Bloomberg Index Services Limited as the official index calculation and maintenance agent of the Indices, which are owned and administered by Barclays. Bloomberg Index Services Limited does not guarantee the timeliness, accurateness, or completeness of the calculations of the Indices or any data or information relating to the Indices. Bloomberg Index Services Limited makes no warranty, express or implied, as to the Indices or any data or values relating thereto or results to be obtained therefrom, and expressly disclaims all warranties of merchantability and fitness for a particular purpose with respect thereto. To the maximum extent allowed by law, Bloomberg Index Services Limited, its affiliates, and all of their respective partners, employees, subcontractors, agents, suppliers and vendors (collectively, the 'protected parties') shall have no liability or responsibility, contingent or otherwise, for any injury or damages, whether caused by the negligence of a protected party or otherwise, arising in connection with the calculation of the Indices or any data or values included therein or in connection therewith and shall not be liable for any lost profits, losses, punitive, incidental or consequential damages.

© 2022 State Street Corporation - All Rights Reserved.  
5013990.1.1.APAC.RTL Exp. Date: 10/31/2023