

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年3月22日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番6号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2022年11月22日付をもって提出しました有価証券届出書（2023年1月19日付で有価証券届出書の訂正届出書を提出済み。以下「原届出書」といいます。）において、2023年2月27日に行った書面決議の結果、当ファンドの投資対象に「RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」および「RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」を追加し、「RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」および「RM先進国債券マザーファンド」を投資対象から削除する約款変更が行われることが決定したこと、ならびに信託期間を無期限とする投資信託約款の変更に伴い、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。

第一部【証券情報】

(12)【その他】

<訂正前>

**埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG
投資信託約款変更(予定)に関するお知らせ**

この度、追加型証券投資信託「埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG」(以下、このお知らせでは「本ファンド」といいます。))について、投資信託約款における投資対象の変更を予定しております。

当該変更に伴い、受益者の皆様に対して書面による決議(以下、「書面決議」といいます。))の手続きを開始いたしますので、お知らせいたします。

なお、書面決議の手続きは、本ファンドの2023年1月23日時点の受益者の方が対象となり、2023年1月20日以降に取得申込みをされた方は対象外となりますので、予めご了承いただけますよう、お願いいたします。

1. 予定している投資信託約款の変更内容および理由

(変更内容)

本ファンドの投資対象に、「RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)」および「RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)」を追加し、「RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)」および「RM先進国債券マザーファンド」を投資対象から削除いたします。

(変更理由)

本ファンドのコンセプトは、「国際分散投資」、「埼玉県」、「ESG/SDGs」です。主要投資対象とする各マザーファンドを通じて、世界各国の債券、株式およびリートなどの資産に分散投資を行うとともに、「RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)」については埼玉県が発行する公募地方債を投資対象とすること、また、「RM国内株式ESGマザーファンド」および「RM先進国株式ESGマザーファンド」についてはESG関連インデックス*1に連動する投資成果を目指す運用を行うことで、本ファンドのコンセプトに沿った運用を行ってまいりました。

近年、ESGやSDGs*2への関心の高まりと共に、温暖化問題、再生可能エネルギーなどの環境プロジェクトに充当するために発行されるグリーン・ボンドや、貧困問題、女性活躍の機会増進など、社会的課題解決のためのプロジェクトに充当するために発行されるソーシャル・ボンドなどの債券(以下、「SDGs債」といいます。))の市場規模が急速に拡大しています。このような環境下、本ファンドの投資対象のうち、先進国の国債を主要投資対象とする「RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)」および「RM先進国債券マザーファンド」について、米ドル建およびユーロ建で発行されるSDGs債を主要投資対象とする「RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)」および「RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)」に変更することで、本ファンドのコンセプトの1つである「ESG/SDGs」がより明確となると考えております。

なお、本変更に伴う本ファンドのポートフォリオの構築プロセスについては変更ございません。

*1 ESG関連インデックスとは、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)およびMSCI-KOKUSAI ESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)をいいます。詳細は、ファンドの目的・特色の「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。

*2 [SDGs]とは、「Sustainable Development Goals」(持続可能な開発目標)の略で、地球上の「誰一人取り残さない(leave no one behind)」持続可能でよりよい社会の実現を目指し、2015年9月に国連が採択し、2030年を期限として世界が共通して取り組む目標です。世界が直面する社会・経済・環境の3側面からなる課題解決を17のゴールとし、169のターゲットから構成されています。

〈ご参考〉

① 投資対象に追加するマザーファンドの概要

ファンド名	RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	米ドル建のSDGs債および先進国(日本を除く)の国債を主要投資対象とします。
設定日	2021年5月21日
受託会社	株式会社りそな銀行

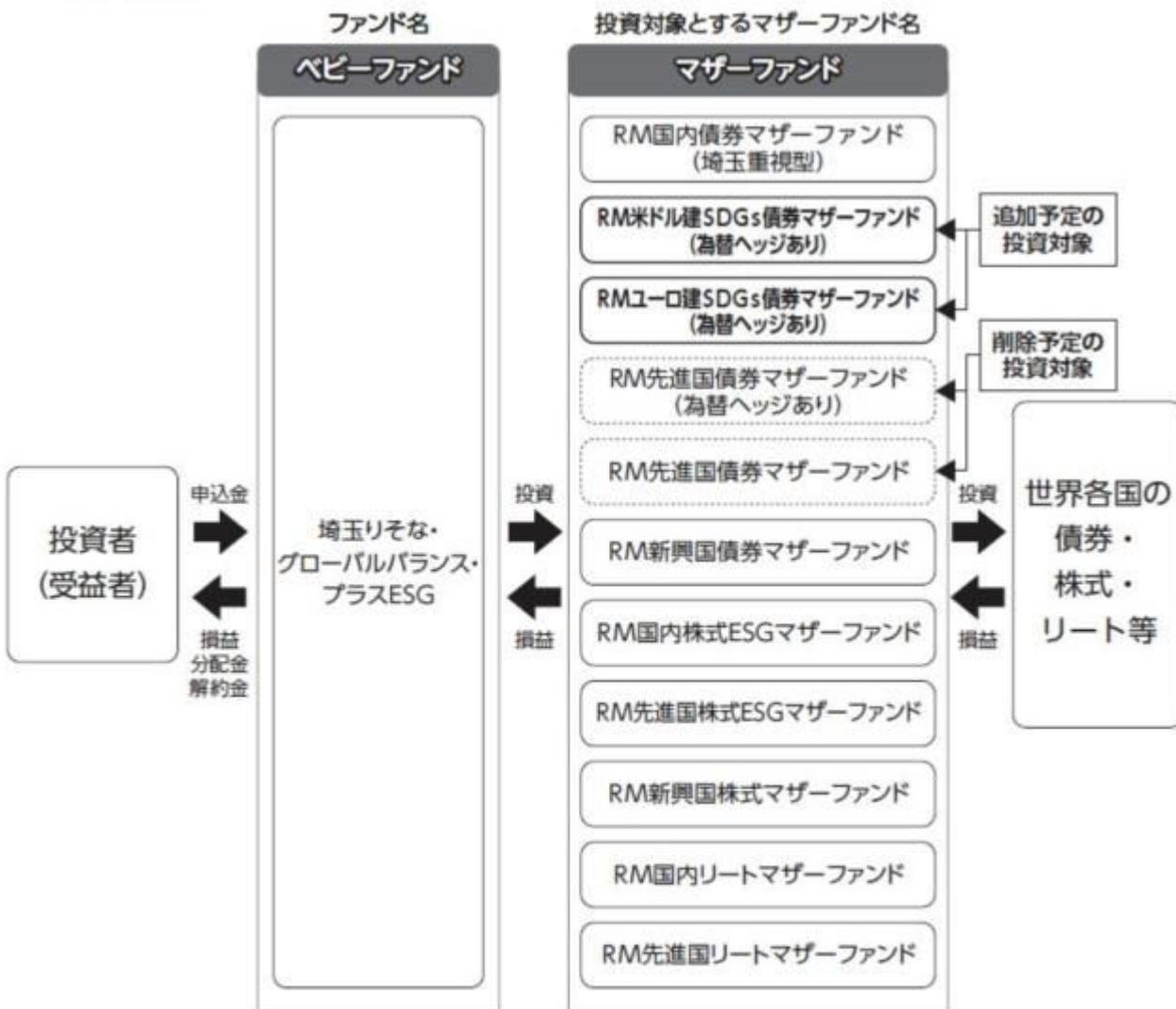
ファンド名	RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	ユーロ建のSDGs債および先進国(日本を除く)の国債を主要投資対象とします。
設定日	2021年5月21日
受託会社	株式会社りそな銀行

② 投資対象から削除するマザーファンドの概要

ファンド名	RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)に採用されている先進国の債券を主要投資対象とします。
設定日	2016年10月6日
受託会社	株式会社りそな銀行

ファンド名	RM先進国債券マザーファンド
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)に採用されている先進国の債券を主要投資対象とします。
設定日	2015年12月11日
受託会社	株式会社りそな銀行

③ ファンドの仕組み



④ その他の変更について

書面決議の結果、上記変更の実施が決定された場合には、信託期間を無期限とする投資約款変更(重大な約款変更には該当しません。)も行い、2023年3月23日から適用する予定です。

	変更後	変更前
信託期間	無期限(2020年9月25日設定)	2030年8月20日まで(2020年9月25日設定)

2. 書面決議の手続きおよび日程

① 受益者および受益権口数の確定日	: 2023年1月23日
② 書面による議決権の行使期間	: 2023年1月23日から2023年2月24日まで
③ 書面決議の日	: 2023年2月27日
④ 投資信託約款の変更適用予定日	: 2023年3月23日

本議案にかかる書面決議は、議決権を行使できる受益者の受益権口数の3分の2以上の賛成をもって可決されます。本議案が可決された場合は、2023年3月23日付で本ファンドの投資信託約款の変更を適用いたします。本議案が否決された場合は、本ファンドの投資信託約款の変更は行いません。

書面決議の結果については、2023年3月1日に、弊社ホームページ(<https://www.resona-am.co.jp/>)に掲載いたします。

※以上の点をご理解のうえ、ご購入くださいますようお願い申し上げます。

《本件に関するお問い合わせ先》
りそなアセットマネジメント株式会社
電話番号 0120-223351（営業日の午前9時から午後5時まで）

<訂正後>

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

ファンドの特色

1 各マザーファンドを通じて、世界各国の債券、株式およびリートなどの資産に分散投資します。

- 先進国債券、国内株式および先進国株式に投資を行う4つのマザーファンドにおいて、特にESG/SDGsを重視した運用*1を行います。
 - ◆ RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)およびRMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)は、残存期間が10年程度までのSDGs債*2および先進国(日本を除く)の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。
 - ◆ RM国内株式ESGマザーファンドおよびRM先進国株式ESGマザーファンドは、ESG関連インデックス*3に連動する投資成果を目指します。
- 国内債券に投資を行うマザーファンドにおいて、埼玉県が発行する公募地方債も主要投資対象とします*4。
 - ◆ RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)は、投資するわが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債の残存年限を幅広く分散させることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。

*1 ESG/SDGsを重視した運用の詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。

*2 マザーファンドにおける投資対象としてのSDGs債の詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。SDGs債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、SDGs債に投資を行わない、もしくは投資比率が低位となる場合があります。

*3 ESG関連インデックスとは、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)およびMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)をいいます。詳細は、「ESG/SDGsを重視した運用について」をご参照ください。

*4 埼玉県が発行する公募地方債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、当該地方債に投資を行わない、もしくは投資比率が低位となる場合があります。

- その他の各マザーファンドは、以下の対象指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

		投資対象地域		
		国内	先進国	新興国
投資対象資産	債券	RM国内債券マザーファンド (埼玉重視型) 【主要投資対象】 わが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債 【対象指数】 なし	RM米ドル建SDGs債券マザーファンド (為替ヘッジあり) 【主要投資対象】 米ドル建のSDGs債*および先進国(日本を除く)の国債 【対象指数】 なし	RM新興国債券マザーファンド 【主要投資対象】 新興国の債券およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)
		RMユーロ建SDGs債券マザーファンド (為替ヘッジあり) 【主要投資対象】 ユーロ建のSDGs債*および先進国(日本を除く)の国債 【対象指数】 なし		
	株式	RM国内株式ESGマザーファンド 【主要投資対象】 国内の株式 【対象指数】 MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)	RM先進国株式ESGマザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の株式 【対象指数】 MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)	RM新興国株式マザーファンド 【主要投資対象】 新興国の株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)
	リート	RM国内リートマザーファンド 【主要投資対象】 国内の不動産投資信託証券 【対象指数】 東証REIT指数(配当込み)	RM先進国リートマザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の不動産投資信託証券、不動産関連株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	—

■ 特にESG/SDGsを重視した運用を行うマザーファンド ■ 埼玉に関連した運用を行うマザーファンド

* 発行国が先進国以外の場合があります。

※各対象指数については、「各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について」をご参照ください。

ESGとは

「ESG」とは、Environment(環境)、Social(社会)、Governance(ガバナンス)の頭文字を取ったものです。ESG評価の高い企業は、持続的な企業価値の向上が期待されています。ESG投資は、従来の財務情報に加え、非財務情報であるESGの評価を重視して銘柄選別を行う運用手法です。

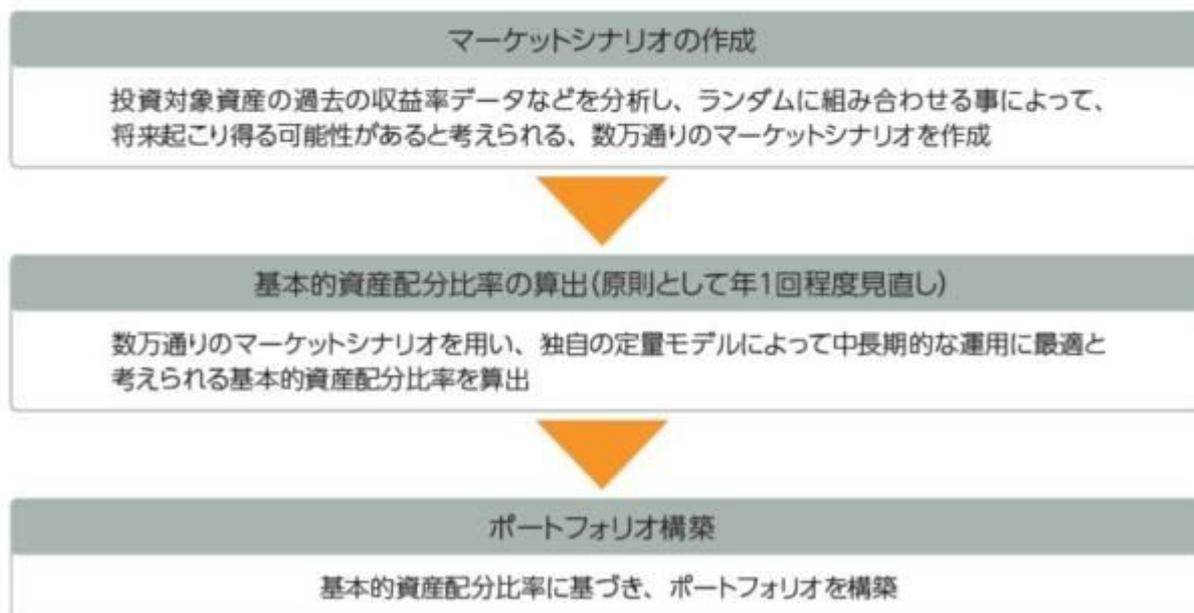
SDGsとは

「SDGs」とは、「Sustainable Development Goals」(持続可能な開発目標)の略で、地球上の「誰一人取り残さない(leave no one behind)」持続可能でよりよい社会の実現を目指し、2015年9月に国連が採択し、2030年を期限として世界が共通して取り組む目標です。世界が直面する社会・経済・環境の3側面からなる課題解決を17のゴールとし、169のターゲットから構成されています。

2 中長期的な運用に理想的なポートフォリオ構築を目指します。

- 独自の定量モデルを用いて算出した基本的資産配分比率に基づき、ポートフォリオを構築します。基本的資産配分比率は、原則として年1回程度見直します。
当ファンドでは、過去に起きていなかった事象も今後起こり得ると考え、過去のデータをランダムに組み合わせ、将来起こり得る可能性のある数万通りのシナリオを作成します。このように作成されたマーケット・シナリオを用いてシミュレーションを行い、中長期的な運用に最適と考えられるポートフォリオを構築します。

運用プロセスのイメージ



※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

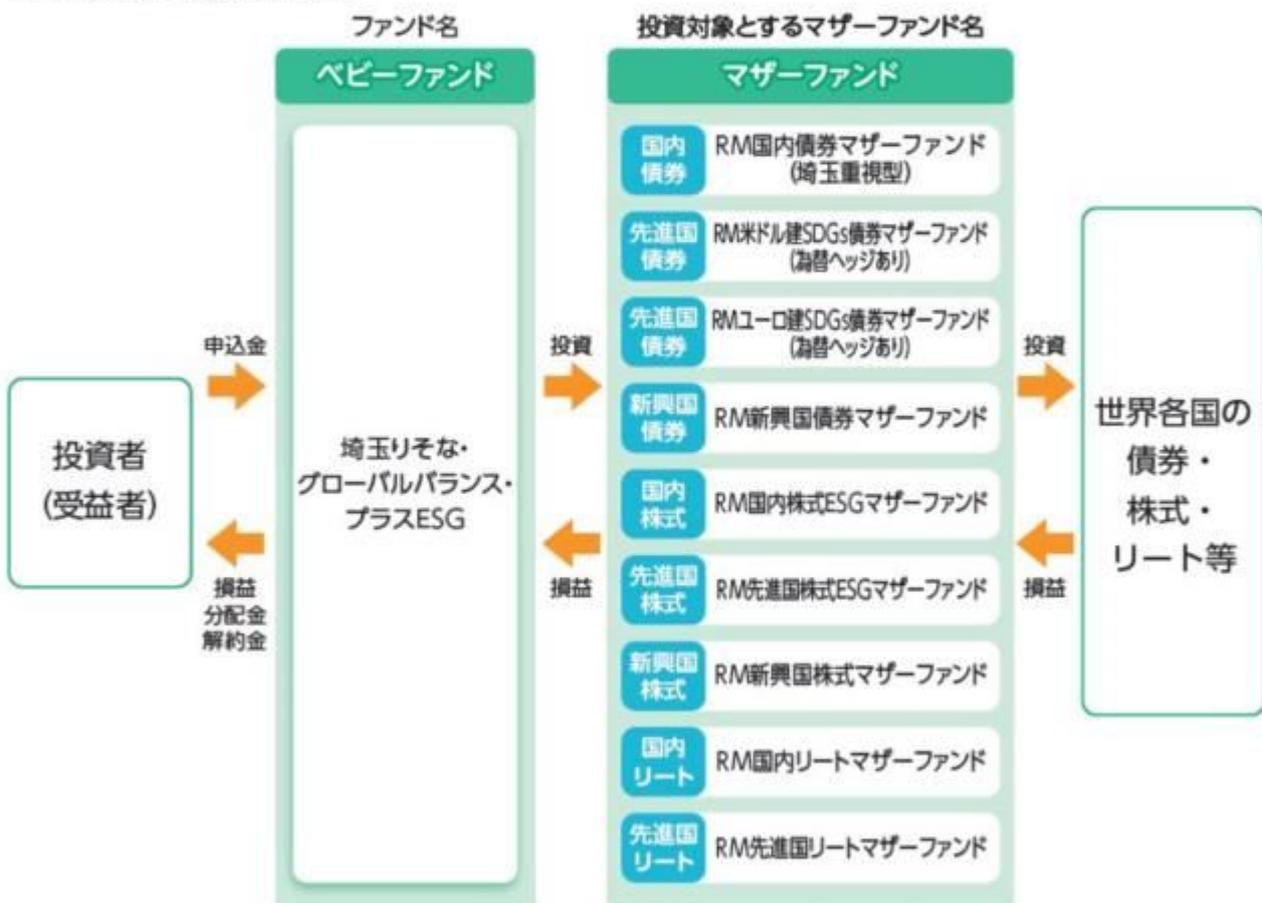
3 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

- 外貨建資産として組み入れるRM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)およびRMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)において為替ヘッジを行います。

資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの仕組み

当ファンドは各マザーファンドを通じて世界各国の債券、株式およびリートなどに実質的に投資を行う、ファミリーファンド方式で運用を行います。



主な投資制限

- 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

分配方針

原則、毎年8月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ③留保金は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

●RM新興国債券マザーファンド

「JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)」は、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー(J.P.Morgan Securities LLC)が算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数であり、指数に関する著作権はJ.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

●RM国内株式ESGマザーファンド

MSCI Inc.が開発した「MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)」は、国内株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

●RM先進国株式ESGマザーファンド

「MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI Inc.が開発したMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(米ドルベース)は、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

●RM新興国株式マザーファンド

「MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCIエマージング・マーケット指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCIエマージング・マーケット指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

●RM国内リートマザーファンド

「東証REIT指数(配当込み)」は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託(REIT)全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

●RM先進国リートマザーファンド

「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)および同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数であり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに帰属します。

ESG/SDGsを重視した運用について

先進国債券、国内株式および先進国株式への投資において、特にESG/SDGsを重視します。

ー先進国債券の投資についてー

- RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)およびRMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)は、SDGs債および先進国(日本を除く)の国債を主要投資対象とします。(以下、上記マザーファンドを総称して「SDGs債券マザーファンド」といいます。)

・SDGs債券マザーファンドにおける投資対象としてのSDGs債とは、調達資金がSDGsに貢献する事業に充当される債券であり、国際資本市場協会(ICMA)*によるグリーンボンド原則、ソーシャルボンド原則、サステナビリティボンド・ガイドライン等に沿って発行された債券および事業全体がSDGsに貢献すると考えられている機関が発行する債券(国際機関債等)等をいいます。

*国際資本市場協会(ICMA)は、国際資本と証券市場に関する諸論点の共同調査や議論を通じ、世界に多数存在する協会の良好な関係を促進することなどを目的とする非営利の国際組織です。

※SDGs債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、SDGs債に投資を行わない、もしくは投資比率が低位となる場合があります。

〈代表的なSDGs債の種類と特徴〉

代表的なSDGs債の種類	概要	特徴
グリーン・ボンド	温暖化問題、再生可能エネルギー等、環境プロジェクトに充当するために発行する債券です。	<ul style="list-style-type: none"> ● 以下の4要素の観点から、それぞれの債券の要件が設定されています。 <ul style="list-style-type: none"> ・資金調達の使途 ・プロジェクトの評価と選定のプロセス ・調達資金の管理 ・レポーティング ● 要件のほか、発行体に対する推奨項目も設定されています。 <ul style="list-style-type: none"> ・フレームワーク等によって、原則やガイドラインへの適合性等を説明すること ・外部評価機関を用いて、原則やガイドラインへの適合性を評価したり、資金管理の検証等を行うこと <p style="text-align: right;">など</p>
ソーシャル・ボンド	貧困問題、女性活躍の機会増進など、社会的課題解決のためのプロジェクトに充当するために発行する債券です。	
サステナブル・ボンド	グリーンとソーシャル両方のプロジェクト、両方の性格を持つプロジェクトに充当するために発行する債券です。	

※上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

ー国内株式および先進国株式の投資についてー

- RM国内株式ESGマザーファンドは、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。また、RM先進国株式ESGマザーファンドは、MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。

- ・ MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）は、MSCI Inc.が開発し、国内株式を対象とした株価指数であるMSCI ジャパン IMI指数^{*1}の構成銘柄から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数で、配当を考慮したものです。
- ・ MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）は、MSCI Inc.が開発したMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（米ドルベース）をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数（米ドルベース）は、日本を除く世界の先進国の株式から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数で、配当を考慮したものです。

〈両指数の特徴〉

- ① MSCI Inc.独自のESG評価モデルを用います。当該モデルは、評価対象企業に対し、当該企業が属する業種が直面するESG上のリスクや機会は何か、当該企業にとってそれらがどの程度大きく、どの程度マネジメントを行っているかを測定・分析し、同業種他社と比較することを目的としています。
- ② 企業に対するESG評価は最終的にAAA～CCCの7段階のESG格付で表され、格付がBB以上（7段階のうち上位5段階目まで）の企業が選別されます。
- ③ E/S/Gそれぞれの要素に負の影響を与える可能性がある不祥事について分析し、11段階のうち上位8段階目までの企業が選別されます。
- ④ MSCI ジャパン IMI指数^{*1}を構成する銘柄、またはMSCI-KOKUSAI指数^{*2}を構成する日本を除く先進国の銘柄の中から、業種分類（GICS:Global Industry Classification Standard）ごとに時価総額50%を目標として、指数を構成する企業が選別されます。
- ⑤ MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数においては、非人道的兵器や核兵器製造などに関与する企業、アルコールやギャンブルなどから一定以上の収益を得ている企業は指数の構成銘柄から除外されます。

*1 MSCI ジャパン IMI指数は、MSCI Inc.が開発した、日本の上場株式を対象として算出した指数です。

*2 MSCI-KOKUSAI指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数です。

※ MSCI Inc.の資料に基づき、りそなアセットマネジメントが作成。

※ 上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

〈ESG格付決定プロセス〉

1. 業種別に、MSCI Inc.が独自にE/S/Gそれぞれに設定している細項目(Key Issue)のうち関連が深いものを選定し、それがリスクまたは機会として顕在化するまでの時間の長短および環境・社会に与える影響の大小の2軸をもとにウエイト配分を決定する。
2. E/S/Gそれぞれに選定された細項目をもとに、E/Sに対しては、エクスポージャー（経済的なリスクの程度）の大きさとそれに対するマネジメントがどの程度なされているかを、Gに対しては、企業統治上のリスクに関する評価を減点方式で勘案し、E/S/Gそれぞれに0～10の点数を付与する。
3. 上記1.で決定したウエイト配分をもとに、上記2.でE/S/Gそれぞれに付与した点数を、加重平均したうえで同業種他社との比較を踏まえ調整を行い、0～10の点数を算出する。
4. 算出された点数を格付表にあてはめ、格付を決定する。



*1：0～10の点数を算出

*2：業種別にMSCI Inc.が独自にE/S/Gそれぞれに設定している細項目(Key Issue)

*3：経済的なリスクの程度

※ MSCI Inc.の資料に基づき、りそなアセットマネジメントが作成。

※ 上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

〈MSCI Inc.のESG細項目(Key Issue)の例〉(ご参考)

E	気候変動	自然資本
	▷ 二酸化炭素排出 ▷ 環境インパクト金融 など	▷ 水資源の枯渇 ▷ 生物多様性と土地の利用 など
	環境汚染・廃棄物	環境に関する市場機会
	▷ 有害物質の排出と廃棄 ▷ 包装材の廃棄 など	▷ クリーンテクノロジー ▷ 再生可能エネルギー など
S	人的資本	製造物責任
	▷ 人材開発 ▷ サプライチェーン上の労働規範 など	▷ 製品の安全性と品質 ▷ 金融商品の安全性 など
	利害関係者の対立	社会に関する市場機会
	▷ 希少資源 など	▷ コミュニケーションの機会 ▷ 金融サービスの利用機会 など
G	企業統治	企業行動
	▷ オーナーシップとコントロール ▷ 議決権行使 など	▷ 納税の透明性 など

※ MSCI Inc.の資料に基づき、りそなアセットマネジメントが作成。
 ※ 上記の記載内容については、今後変更される可能性があります。

(2) 【ファンドの沿革】

<訂正前>

2020年9月25日

- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

<訂正後>

2020年9月25日

- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

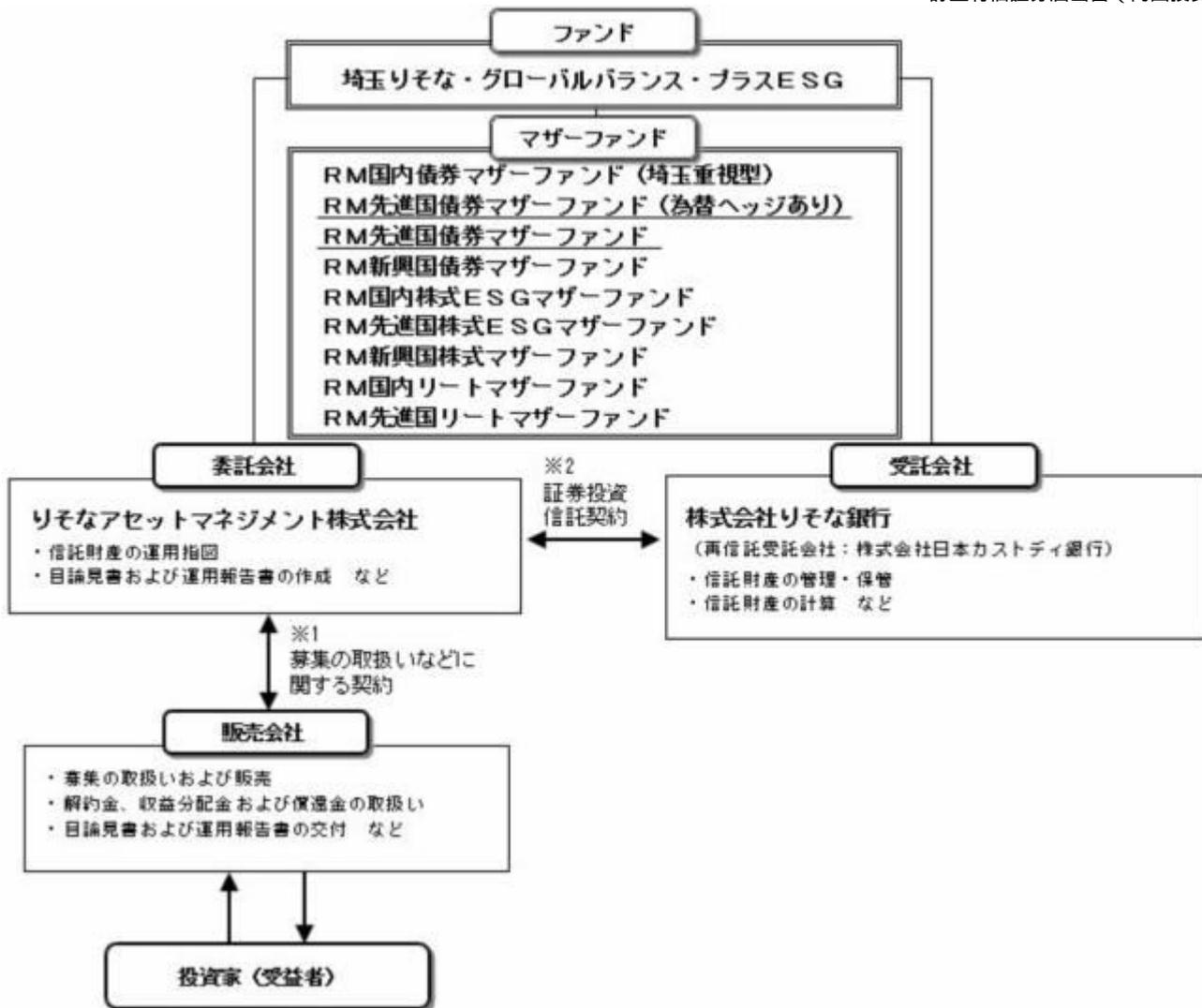
2023年3月23日

- ・ 投資対象に「RM米ドル建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」および「RMユーロ建SDGs債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」を追加し、「RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」および「RM先進国債券マザーファンド」を投資対象から削除する旨の約款変更を実施
- ・ 信託期間を無期限に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

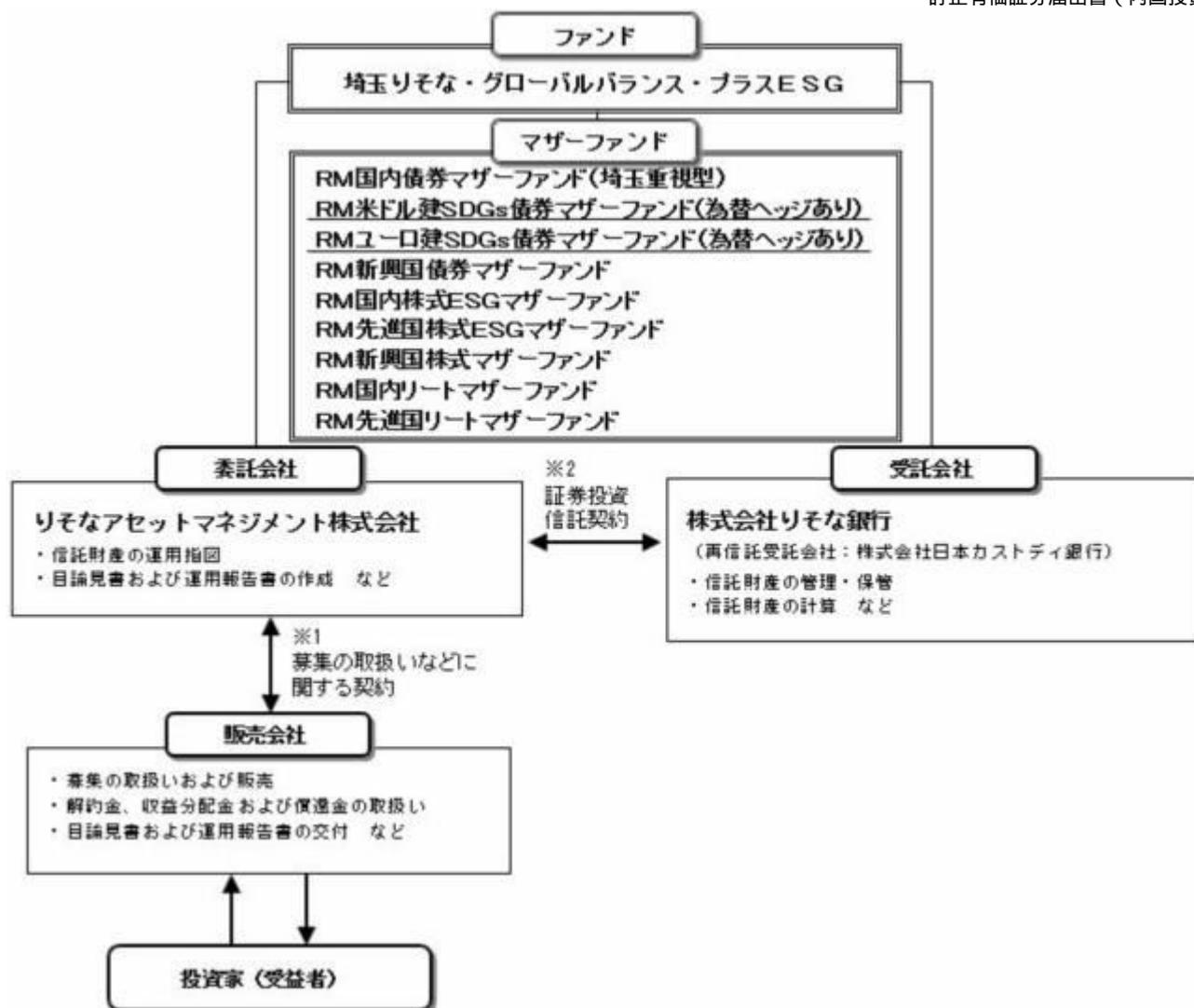
ファンドの仕組み

<訂正前>



(略)

<訂正後>



(略)

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<訂正前>

RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)、RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RM先進国債券マザーファンド、RM新興国債券マザーファンド、RM国内株式ESGマザーファンド、RM先進国株式ESGマザーファンド、RM新興国株式マザーファンド、RM国内リートマザーファンド、RM先進国リートマザーファンド(以下、各々を「マザーファンド」といいます。)の各受益証券を主要投資対象とします。

～ (略)

<訂正後>

RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)、RM米ドル建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RMユーロ建SDGs債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RM新興国債券マザーファンド、RM国内株式ESGマザーファンド、RM先進国株式ESGマザーファンド、RM新興国株式マザーファンド、RM国内リートマザーファンド、RM先進国リートマザーファンド(以下、各々を「マザーファンド」といいます。)の各受益証券を主要投資対象とします。

～ （略）

（２）【投資対象】

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< 訂正前 >

< R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型） >

（略）

< R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券を主要投資対象とします。
投資方針	<p>主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り ます。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年12月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M先進国債券マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券

投資方針	<p>主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使等により取得したものに限り、</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

（以下、略）

< 訂正後 >

< RM国内債券マザーファンド（埼玉重視型） >

(略)

< R M米ドル建 S D G s 債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	米ドル建の S D G s 債および先進国（日本を除く）の国債を主要投資対象とします。
投資方針	<p>主として、米ドル建の S D G s 債および先進国（日本を除く）の国債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。なお、先進国債券（除く日本）を対象とした債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>米ドル建の S D G s 債は、発行体の信用力・ E S G 評価および当該債券の流動性等を勘案して投資を行います。</p> <p>ポートフォリオの構築は、残存期間が10年程度までの米ドル建の S D G s 債および先進国（日本を除く）の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>債券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年5月10日（休業日の場合は翌営業日）

委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R Mユーロ建 S D G s 債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	ユーロ建の S D G s 債および先進国（日本を除く）の国債を主要投資対象とします。
投資方針	<p>主として、ユーロ建の S D G s 債および先進国（日本を除く）の国債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。なお、先進国債券（除く日本）を対象とした債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>ユーロ建の S D G s 債は、発行体の信用力・E S G 評価および当該債券の流動性等を勘案して投資を行います。</p> <p>ポートフォリオの構築は、残存期間が10年程度までのユーロ建の S D G s 債および先進国（日本を除く）の国債を、各残存期間の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>債券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	

決算日	毎年5月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

（以下、略）

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

（3）【信託期間】

<訂正前>

2030年8月20日までとします（2020年9月25日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

<訂正後>

無期限とします（2020年9月25日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。