

販売用資料
2021年7月

埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG

愛称: **SaitamaDGs**

四半期運用レポート

(2021年4月～2021年6月)



埼玉県マスコット
「コバトン」「さいたまっち」



SUSTAINABLE
DEVELOPMENT **GOALS**



りそなアセットマネジメント

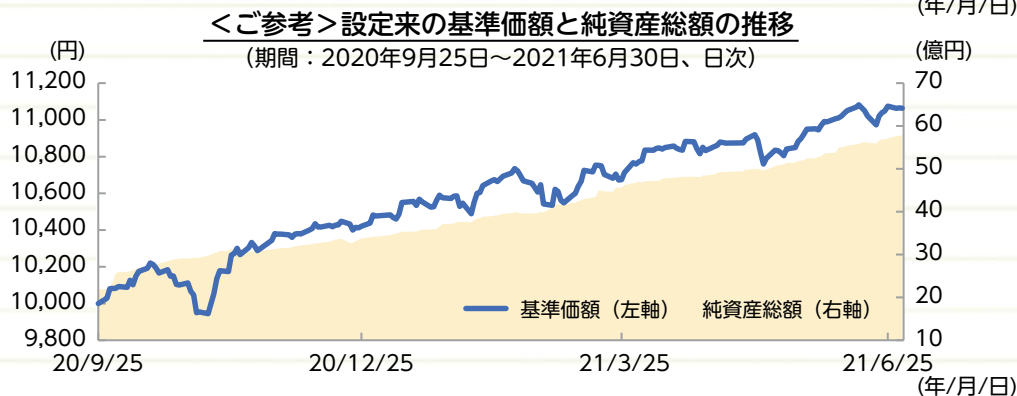
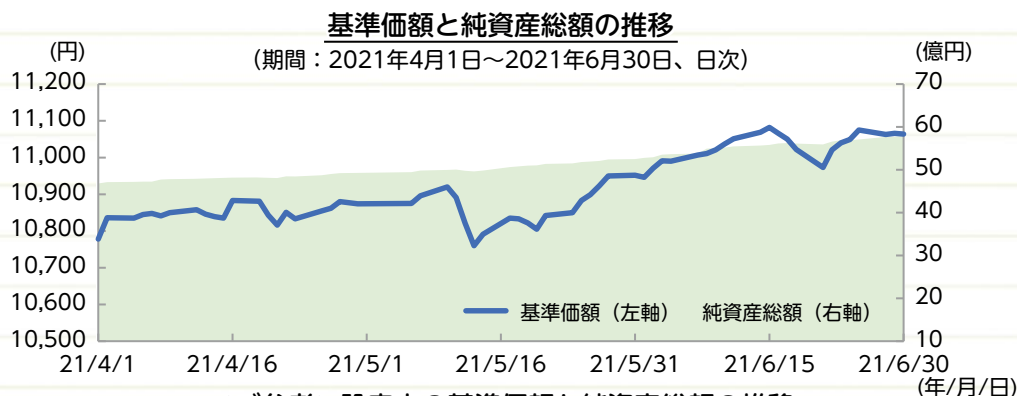
RESONA

SaitamaDGs 2021年4月-2021年6月までの運用状況について

運用状況

先進国株式市場が堅調に推移し、基準価額は大きく上昇

基準価額は堅調に推移し、第2四半期(2021年4月～6月)で約2.7%上昇しました。
先進国株式市場が堅調に推移したことが大きく寄与し、基準価額は大幅に上昇しました。



※基準価額(1万口当たり)は、運用管理費用(信託報酬等)控除後のものです。
※上記はあくまで過去の実績であり、将来の投資成果をお約束するものではありません。

運用環境 (期間：2021年4月1日～2021年6月30日)



株式市場は、先進国市場は上昇した一方、国内市場では小幅に下落しました。4月は、米国の堅調な経済指標や米欧の新型コロナワクチンの接種進展を追い風に、海外の主要市場で株価上昇がみられました。一方国内市場では、新型コロナウイルス感染拡大による緊急事態宣言の再発令などを嫌気し下落基調となりました。5月から6月にかけては、米国の消費者物価指数の上昇や堅調な雇用統計の結果を受けたFRB(米連邦準備制度理事会)の金融緩和政策の行方を巡り、株価が上下動する展開となりましたが、6月下旬にパウエルFRB議長が金融緩和政策の維持を表明したことなどを好感し、以降は主要先進国の株式市場は堅調に推移しました。



債券市場は、米国のインフレ率上昇懸念やFRBが政策金利変更を早期に開始するとの観測が広まり、長期金利が上昇(債券価格は下落)する場面もありましたが、FRBの金融緩和政策維持の見通しが広まったことなどを背景に米国や国内の長期金利は低下しました。一方欧州では、ECB(欧州中央銀行)の資産買入れ継続の表明が金利上昇を抑制する場面もあったものの、経済活動再開への期待などから今期末の長期金利は前期末比で上昇しました。



為替市場は、5月から6月にかけて1年3か月ぶりの水準にまで円安ドル高が進行しました。

※作成基準日現在の見解であり、将来の市況環境等を保証するものではありません。



ESG 関連投資

世界各国の環境関連政策で注目が加速するESG投資

運用環境

国内外のESG関連インデックスはTOPIX(配当込み)やMSCI-KOKUSAI(配当込み、円換算ベース)をやや下回るパフォーマンスとなりました。米国はバイデン政権により温室効果ガスの排出量削減の国際協定である「パリ協定」に正式に復帰、主要国の排出量目標引き下げを主導する方針を示すなど、環境問題への取り組みを強化しています。国内においても、温室効果ガスの排出量を厳格に規制する統一ルールを導入する機運が高まりつつあるほか、株主総会で気候変動や脱炭素社会に対応した企業戦略を求める株主提案が多くなされるなど、企業に変化を求める動きも活発になっています。そうしたなか、相対的にESG評価に優れた企業を選別して構築されるESG関連インデックスは、今後投資家からのさらなる注目や堅調なパフォーマンスが期待されます。

全ての人々に安全な水を

日本では水は安全で清潔なものというのが普通ですが、世界に目を向けると、約22億人が、安全に管理された飲料水を利用できない環境にあります。

浄水処理をしないままの水を飲むと、抵抗力の弱い子どもたちは、汚れた水が原因で命を落とすこともあります。

また、新型コロナウイルス感染症の予防に効果的な手洗いについても、全世界で30億人が基本的な手洗いをする設備が自宅にない状態です。加えて、近年は干ばつによる水不足が深刻化。今後は水不足により2030年までに7億人が住む場所を追われる恐れがあります。

私たちが生きていくうえで様々な場面が必要になる水。水は、「きれい」なだけでは十分ではなく、「安全」でなければ、人々の健康を守ることはできません。

だからこそ、節水を含め今ある水資源を守る事が重要になります。

国内外株価指数のパフォーマンス

(期間：2021年3月31日～2021年6月30日)

	インデックス名称	騰落率
国内株式	MSCIジャパンESGセレクトリーダーズ(配当込み)	-0.49%
	TOPIX(配当込み)	-0.33%
先進国株式	MSCIコクサイESGリーダーズ(配当込み、円換算ベース)	8.98%
	MSCI-KOKUSAI(配当込み、円換算ベース)	9.03%

出所:ブルームバーグのデータを基にリそなアセットマネジメントが作成

世界企業の取り組み

サントリーホールディングス株式会社

「水と生きる」を社会との約束して掲げ、水源を守る為、天然水の源である水をはぐくむ森を「サントリー天然水の森」と名付けて、森を守る活動を行っています。

株式会社エコラボ

エコラボは水、衛生、感染防止のソリューションとサービスにおけるグローバルリーダー。独自の技術を駆使し2060億ガロンの水を節約、13億人に安全な飲料を提供しています。

出所:各種報道機関の情報やデータを基にリそなアセットマネジメントが作成

埼玉県

ファンド設定来、継続して埼玉県債を組入れ

運用環境

当ファンドの主要投資対象である国内債券マザーファンドは、66.4%程度を埼玉県の公募地方債(埼玉県債)に投資しております。(2021年6月末時点)

※国内債券マザーファンドの残高は約9.8億円(うち、埼玉県債への投資は約6.5億円)

<投資リスク>

当ファンドの基準価額は、実質的に組み入れている有価証券等の値動きにより影響を受けますが、**運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。**したがって、**投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。**また、**投資信託は預貯金と異なります。**当ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重にご判断くださいますようお願いいたします。

- 市場リスク(株価変動リスク、金利(債券価格)変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスク)、●資産配分リスク、●信用リスク、●流動性リスク、●カントリーリスク(基準価額の変動要因は、左記に限定されるものではありません。)

※詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「投資リスク」をご覧ください。

<ファンドの費用>

お客さまが直接的にご負担いただく費用

購入申込総金額に応じて下記料率を乗じて得た金額となります。				
購入時手数料	購入申込総金額	1億円未満	1億円以上3億円未満	3億円以上
	手数料	1.10%(税抜1.0%)	0.55%(税抜0.5%)	なし
※マイゲート(インターネットバンキング)または定時定額購入プラン(積立投資信託)でご購入の場合は、表記手数料率から30%優遇となります。				
信託財産留保額	ありません。			

お客さまが間接的にご負担いただく費用

運用管理費用(信託報酬)	ファンドの純資産総額に対して、 年率0.88%(税抜0.80%) を乗じて得た額とします。信託期間を通じて毎日費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産から支払われます。			
運用管理費用の配分	支払先	委託会社	販売会社	受託会社
	配分(税抜)	年率0.385%	年率0.385%	年率0.030%
※運用管理費用の配分には、別途消費税等相当額がかかります。				
その他の費用・手数料	監査費用、有価証券等の売買にかかる売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用、信託財産に関する租税および信託事務の処理に必要な費用等(これらの消費税等相当額を含みます。)は、その都度(監査費用は日々)ファンドが負担します。これらその他の費用・手数料は、信託財産の運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額またはその計算方法の概要等を記載することができません。			

※上場投資信託証券、上場不動産投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、これら費用を表示することができません。

※上記の手数料等の合計額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

<本資料についてのご留意事項>

本資料は、りそなアセットマネジメント株式会社が作成した販売用資料です。ご購入の際は、投資信託説明書(交付目論見書)および一体としてお渡しする「目論見書補完書面」等を販売会社よりお渡ししますので、必ず内容をご確認のうえ、ご自身でご判断ください。

- 投資信託は値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、投資元本を割り込むことがあります。
- 運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。
- 投資信託は預金や保険契約ではなく、預金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また証券会社以外でご購入された場合は、投資者保護基金の対象にはなりません。
- 投資信託のお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- 本資料は、当社が信頼できると判断した情報をもとに作成しておりますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。
- 運用実績および市場環境の分析等の記載内容は過去の実績および将来の予測であり、将来の運用成果および市場環境等を示唆・保証するものではありません。
- また、将来の市場環境の変動等により、運用方針が変更される場合があります。
- 本資料に指数・統計資料等が記載される場合、それらの知的財産権、その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。
- 本資料の記載内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

<本資料で使用している各インデックスについて>

- ・「東証株価指数(TOPIX、配当込み)」は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利は東京証券取引所に帰属します。
- ・「MSCIジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)」は、国内株式を対象とした株価指数であるMSCIジャパン IMI Top 700指数の構成銘柄から、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。なお、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。
- ・「MSCI-KOKUSAI 指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI-KOKUSAI 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、MSCI Inc. が開発した、日本を除く世界の先進国の株式から構築される指数で、配当を考慮したものです。なお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。
- ・「MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)」は、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、MSCI Inc. が開発した、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する指数で、配当を考慮したものです。なお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。

※本資料の内容は2021年6月30日作成基準日のものであり、将来予告なく変更されることがあります。

【販売会社】

商号等:株式会社埼玉りそな銀行
登録金融機関 関東財務局長(登金)第593号
加入協会:日本証券業協会、一般社団法人金融先物取引業協会

【委託会社】

商号等:りそなアセットマネジメント株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第2858号
加入協会:一般社団法人投資信託協会、一般社団法人日本投資顧問業協会

