

【表紙】

【提出書類】	臨時報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2024年3月12日
【ファンド名】	東京海上・厳選資産バランスファンド(毎月決算型)
【発行者名】	東京海上アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 横田 靖博
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	尾崎 正幸
【連絡場所】	本店の所在の場所に同じ
【電話番号】	03 - 3212 - 8421
【縦覧に供する場所】	該当なし

【臨時報告書の提出の理由】

追加型証券投資信託「東京海上・厳選資産バランスファンド（毎月決算型）」（以下「当ファンド」といいます。）につき、当ファンドの主要投資対象である親投資信託「東京海上・日系事業債マザーファンド（為替ヘッジあり）」（以下「マザーファンド」といいます。）に関する信託終了（繰上償還）に係る手続きを開始します。当該手続きによりマザーファンドが繰上償還となった場合には、当ファンドを繰上償還することが決定しますので、金融商品取引法第24条の5第4項及び特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令第29条第2項第14号の規定に従い、本臨時報告書を提出するものです。

【報告内容】

イ. 信託の終了の年月日

2024年5月9日

マザーファンドの繰上償還が決定した場合、当ファンドの繰上償還が実施されます。

なお、マザーファンドの繰上償還につきましては、書面決議を経て実施いたします。書面決議の手続きにあたっては、マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンド（^{（ ）}）の受益者に対して賛否を問い、それぞれ賛成または反対の受益権口数をマザーファンドにおける実質的な受益権口数に換算する方法で行います。

（ ）マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドは以下のとおりです。以下同じ。

東京海上・厳選資産バランスファンド（毎月決算型）

東京海上・厳選資産バランスファンド（年1回決算型）

ロ. 信託の終了に係る決定に至った理由

（1）マザーファンドは、2020年12月7日の設定以来、日本の法人が発行する円建ての社債および日系発行体（日本企業もしくはその子会社、日本の政府機関等）が世界で発行する外貨建ての債券等に投資し、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目標として運用を行ってまいりましたが、純資産残高の減少により、一銘柄あたりの投資割合が約款に規定している制限の上限に抵触する状況となっております。今後も純資産総額の大幅な増加は見込み難く、マザーファンドの商品性の維持が困難になることが想定されます。

このような状況を勘案し、マザーファンドを繰上償還することが望ましいと判断いたしました。

（2）当ファンドにつきましては、マザーファンドの繰上償還が決定した後の代替運用を検討致しましたが、現状の純資産残高においては、既に保有している銘柄以外の適切な代替銘柄は見つからず、当ファンド本来の運用目標を達成することおよび商品性の維持が困難となることが懸念されます。

（3）上記の結果、マザーファンドの繰上償還に伴い、マザーファンドを主要投資対象とする全てのベビーファンドを繰上償還し、運用資産を受益者の皆様にお返しすることが望ましいと判断いたしました。

ハ. 法令に基づき信託の終了に係る決定に関する情報を発行者が発行する特定有価証券の所有者に対し提供している場合又は公衆の縦覧に供している場合には、その旨

受益者を対象に書面決議を行うため、当ファンドの知れている受益者に対して、マザーファンドの繰上償還およびマザーファンドの繰上償還に伴い当ファンドが繰上償還となる旨の情報を記載した書面を交付します。