

【表紙】

【提出書類】	臨時報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2022年 8 月 4 日
【ファンド名】	東京海上・円資産バランスファンド(3倍型)(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・円資産バランスファンド（3倍型）（毎月決算型）」（以下「当ファンド」といいます。）につき、信託終了（繰上償還）に係る手続きを開始することが決定しましたので、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

2022年10月7日（書面決議が可決された場合、繰上償還が実施されます。）

ロ.信託の終了に係る決定に至った理由

(1)当ファンドは2019年12月24日の設定以来運用を行ってまいりましたが、純資産総額が減少し、2022年6月末現在、受益権の総口数は10億口を下回る状態となっております。このまま純資産総額の減少が続いた場合、主要取引対象とする国内の国債先物取引単位の制約から、配分比率調整の精度が低下し、以下のとおり投資信託約款の「運用の基本方針」に定めた比率から乖離することが想定され、商品性の維持が困難な状況になる可能性が高まります。このような状況の場合、株式やREITの占めるリスクが想定以上に高くなる可能性や、純資産総額の3倍を大幅に超える、または下回る投資となることで、ファンド全体のリスク水準が当初設定時の想定と大きく異なることが恒常的に生じる可能性が考えられます。

債券・株式・REITの実質的な配分比率を70:15:15^(注)を基本とする。

株式・REITの組入総額と、国内の国債先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、原則として信託財産の純資産総額の3倍程度となるように投資を行う。

(注)当ファンドの基準価額の変動リスクを委託会社が定める一定の水準に抑制することを目的として、株式とREITの実質的な配分比率をそれぞれ引き下げ、短期金融資産を組入れる場合があります。

(2)当ファンドにつきましては、投資信託約款において、受益権の総口数が10億口を下ることとなったとき、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときには、書面決議の可決をもって、受託会社と合意のうえ、繰上償還させることができると規定しています。今後も当ファンドの純資産総額の大幅な増加は見込み難しく、前述の状況から、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な状況になることが懸念されるため、信託契約を解約し、繰上償還を行うことが受益者の皆様にとって有利である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の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、当ファンドの知っている受益者に対して、繰上償還に関する情報を記載した書面を交付します。