

【表紙】
【提出書類】 臨時報告書の訂正報告書
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 2020年4月30日
【ファンド名】 資源ツイン ファンド（通貨選択型）ブラジルリアルコース
資源ツイン ファンド（通貨選択型）トルコリラコース
資源ツイン ファンド（通貨選択型）米ドルコース
資源ツイン ファンド（通貨選択型）マネーボールコース

【発行者名】 T & D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 坪井 親弘
【本店の所在の場所】 東京都港区芝五丁目36番7号
【事務連絡者氏名】 富岡 秀夫
【連絡場所】 東京都港区芝五丁目36番7号
【電話番号】 03-6722-4813
【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【提出理由】

「資源ツイン ファンド（通貨選択型）」につき、2020年4月24日付をもって提出した臨時報告書において信託終了（繰上償還）を行うことが決定したことをお知らせしましたが、その信託終了（繰上償還）の年月日が決定しましたので、本臨時報告書の訂正報告書を提出するものです。

2【報告内容】

イ．信託終了（繰上償還）の年月日

2020年5月20日

ロ．信託終了（繰上償還）に係る決定に至った理由

ファンドのうち「ブラジルリアルコース」「トルコリラコース」「米ドルコース」は、J.Pモルガン・マンサール・マネジメント・リミテッド（以下「マンサール」といいます。）が運用する外国投資信託であるパッシブ・トラスト 資源ツインアルファ ブラジルリアルファンド/トルコリラファンド/米ドルファンド（以下「外国投資信託」といいます。）を通じて、実質的に複数のカバードコール戦略への投資を行っております。その中の「原油カバードコール戦略」では、原油先物を保有しつつ、これを原資産とするコールオプションを売り建てるカバードコール戦略を実質的に行っておりますが、足許原油先物価格がマイナスを示す動きまで出ている中で、原油先物価格の動向次第では外国投資信託の価額がゼロとなる可能性が出てまいりました。

外国投資信託の価額がゼロとなった場合は、外国投資信託は強制的に繰上償還となり、これによりファンドも信託約款の規定に従い、書面決議を経ずに繰上償還となります。この場合、ファンドの償還価額は、ゼロ近辺にまで低下することが想定されます。

これらの理由により、マンサールは今後の効率的な運用継続が困難と判断し、外国投資信託がその信託を終了することとなりました。

これを受け、ファンドの信託約款の規定に基づき、ファンドの信託終了（繰上償還）を行うものです。

ハ．法令に基づく信託終了（繰上償還）に係る決定に関する情報の提供または公衆縦覧

委託会社のホームページ（<https://www.tdasset.co.jp/>）にファンドの信託終了（繰上償還）に関するお知らせを掲載します。