

■外国証券情報■

更新日（年次）：2025/3/10

ティッカー TMF

第一部 証券情報

- (1) ファンドの名称
(英語) Direxion Daily 20+ Year Treasury Bull 3X Shares
(カタカナ) ディレクション・デイリー・20 プラス・イヤー・トレジャリー・ブル・3X・シェアーズ
(日本語名) 目論見書、年次報告書、発行者 HP に記載なし。
- (2) ファンドの形態等：上場投資信託（Exchange Traded Fund (ETF)）
- (3) 有価証券の種類：海外発行受益証券
- (4) 発行地：米国
- (5) 上場している外国の金融商品取引所：NYSE アーカ
- (6) 発行日：2009 年 4 月 16 日
- (7) 売買単位：1 口

第二部 発行者情報

- (1) ファンドの登録上の住所
Rafferty Asset Management, LLC
1301 Avenue of the Americas (6th Avenue), 28th Floor, New York, New York 10019, USA
- (2) ファンドの準拠法：米国デラウェア州法および 1940 年米国投資会社法
- (3) ファンドの目的及び基本的性格
ICE 米国国債 20 年超指数のパフォーマンスの 300%にあたる日々の投資成果（手数料・費用控除前）を追求する。
- (4) ファンドの関係法人の概要及び自己資本の額
管理会社：Rafferty Asset Management, LLC
(ラファティ・アセット・マネジメント)
関係業務：インベストメント・アドバイザー
自己資本の額：目論見書、年次報告書、発行者 HP に記載なし。
受託者：Bank of New York Mellon
(バンク・オブ・ニューヨーク・ Mellon)
関係業務：ファンドの会計帳簿の記録、保管・管理業務、名義書換代理人業務など
自己資本の額：目論見書、年次報告書、発行者 HP に記載なし。
- (5) 投資対象及び投資方針
投資対象：純資産の少なくとも 80%を ICE 米国国債 20 年超指数の構成銘柄や同指数をトラックする ETF など、同指数に対するエクスポージャーを提供する金融商品に投資する。
分配方針：分配がある場合は少なくとも年に 1 度

(6) 投資制限：1940 年米国投資会社法による制限

(7) ファンド資産の概要（単位：米ドル）

	2024年10月31日現在
投資有価証券	6,146,916,940
ファンド受益権売却未収金	26,424,160
未収配当・利息	7,417,765
スワップに係るブローカーへの預け金	2,072,316
スワップ契約の未実現評価益	61,473,937
前払い手数料・その他の資産	638
資産の部合計	6,244,305,756

(8) ファンドに関する報酬及び費用

報酬（経費率）：0.91%

その他の費用・手数料については目論見書（※1）、年次報告書（※2）を参照のこと。

(9) リスク

目論見書（※1）、年次報告書（※2）を参照のこと。

(10) 決算期：10 月

(11) ファンドの運用状況

① 投資状況

上場投資有価証券の持分（単位：米ドル）

	2024年10月31日現在
投資有価証券	6,146,916,940

② 運用実績

純資産額（単位：米ドル）

	2024年10月31日現在
純資産総額	6,061,473,832
1 口当たり純資産額	48.03

③ 配当（分配）状況（単位：米ドル）

	2023年11月1日 ～2024年10月31日
1 口当たり分配金	1.6871

(12) ファンドの経理状況

① 貸借対照表（要約）（単位：米ドル）

	2024年10月31日現在
総資産	6,244,305,756
負債	182,831,924

② 損益計算書（要約）（単位：米ドル）

	2024年10月31日現在
投資収益	214,344,096
純投資収益	165,170,888

■重要な事実

情報源に該当する事項がないため記載なし。

■会計基準：米国会計基準

■備考

(※1) 目論見書

<https://www.sec.gov/Archives/edgar/data/1424958/000119312525039929/d812757d497.htm>

(※2) 年次報告書

https://www.sec.gov/Archives/edgar/data/1424958/000113322825000113/dset-efp11635_ncsr.htm

《ご留意いただきたい事項》

(注 1) 当社で取り扱う外国証券については、国内取引所上場銘柄及び国内非上場公募銘柄等を除き、我が国の金融商品取引法に基づいた発行者開示は行われていません。

(注 2) 本資料は、金融商品取引法に従って作成したものであり、当該証券に関する詳細かつ完全な情報が記載されているものではありません。

(注 3) 株価の下落や発行者の経営・財務状況の変化、及びそれらに関する外部評価の変化等により、損失を被ることがあります。さらに為替相場の変動により、損失を被ることがあります。

(注 4) 本資料は年次報告書などに基づいて作成するため、記載された決算期が直近に終了した決算期より古い場合や、年次報告書などがリリースされた後の決算数字修正や直近の株式分割等を反映していない場合がありますので、ご了承ください。