

■外国証券情報■

更新日：2020/12/17

ティッカー TZA 社内コード A8478

第一部 証券情報

- (1) ファンドの名称
(英語) Direxion Daily Small Cap Bear 3X Shares
(カタカナ) ディレクション・デイリー・スモール・キャップ・ベア・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：2008年11月5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
ラッセル2000指数のパフォーマンスのインバース(反転)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：スワップや先物、証券、指数連動型 ETF などの金融商品を組み合わせて投資すること
とで、ラッセル 2000 指数に対して反対のレバレッジ効果を得る。

分配方針：分配がある場合には最低年 1 回

(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）

	2019年10月31日現在
投資有価証券	201,018,965
現金	159,134,310
未収配当・利息	528,658
スワップ契約の未実現評価益	340,863
前払い手数料・その他の資産	20,676
資産の部合計	361,043,472

(8) ファンドに関する報酬及び費用

報酬：投資額の年率 1.07%

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）

	2019年10月31日現在
投資有価証券	201,018,965

② 運用実績

純資産額（単位：米ドル）

	2019年10月31日現在
純資産総額	321,402,755
1口当たり純資産額	43.19

③ 配当（分配）状況（単位：米ドル）

	2018年11月1日 ～2019年10月31日
1口当たり分配金	0.40299

(12) ファンドの経理状況

① 貸借対照表（要約）（単位：米ドル）

	2019年10月31日現在
総資産	361,043,472
負債	39,640,717

② 損益計算書（要約）（単位：米ドル）

	2019年10月31日現在
投資収益	7,387,408
純投資収益	4,267,917

■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/1424958/000119312520052284/d857190d485bpos.htm>

(※2) 年次報告書

https://www.sec.gov/Archives/edgar/data/1424958/000110465919076733/a19-23052_1ncsr.htm

《ご留意いただきたい事項》

- (注1) 当該証券（国内取引所上場銘柄及び国内非上場公募銘柄等を除く）については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おりません。
- (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。