投資者の皆さまへ

Monthly Fund Report

NYダウ・トリプル・レバレッジ

愛称 ： 3σ

追加型投信／海外／株式／特殊型（ブル・ベア型）

信託期間 ： 2020年3月30日 から 2030年3月29日 まで　　基 準 日 ： 2025年6月30日

決算日 ： 毎年3月29日（休業日の場合翌営業日）　　回次コード ： 3416

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

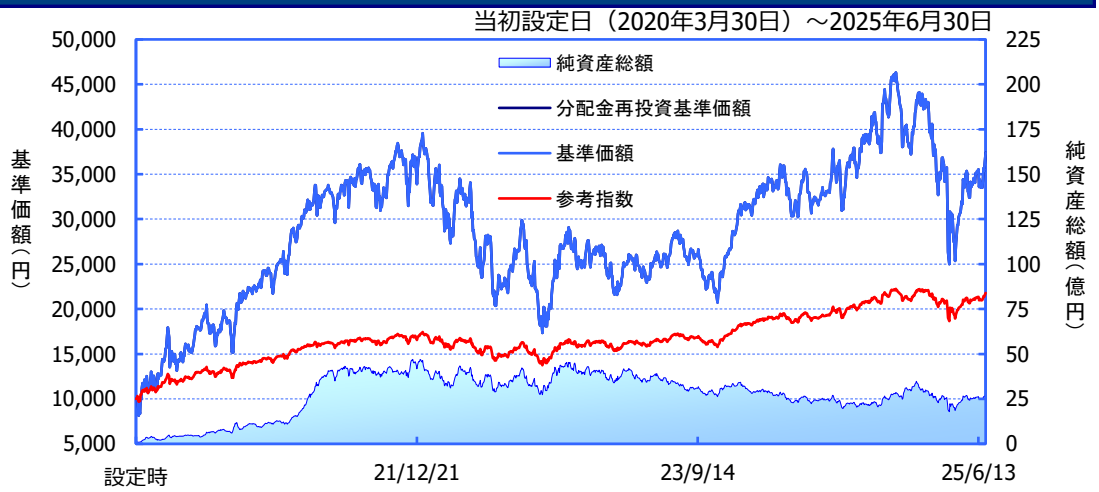
≪基準価額・純資産の推移≫

2025年6月30日現在

基準価額	37,390 円
純資産総額	27億円

期間別騰落率

期間	ファンド	参考指数
1カ月間	+10.7 %	+3.9 %
3カ月間	+9.4 %	+5.7 %
6カ月間	-5.3 %	+2.5 %
1年間	+14.0 %	+13.3 %
3年間	+64.8 %	+47.2 %
5年間	+166.8 %	+83.4 %
年初来	-5.3 %	+2.5 %
設定来	+273.9 %	+117.9 %



※「分配金再投資基準価額」は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
※基準価額の計算において、運用管理費用（信託報酬）は控除しています（後述のファンドの費用をご覧ください）。
※「期間別騰落率」の各計算期間は、基準日から過去に遡った期間とし、当該ファンドの「分配金再投資基準価額」を用いた騰落率を表しています。
※ダウ・ジョーンズ工業株価平均（税引後配当込み、米ドルベース）は当ファンドのベンチマークではありませんが、参考指数として掲載しています。
※グラフ上の参考指数は、グラフの起点時の基準価額に基づき指数化しています。
※実際のファンドでは、課税条件によって投資者ごとの騰落率は異なります。また、換金時の費用・税金等は考慮していません。

≪分配の推移≫

（1万口当たり、税引前）

決算期（年/月）		分配金
第1期	(21/03)	0円
第2期	(22/03)	0円
第3期	(23/03)	0円
第4期	(24/03)	0円
第5期	(25/03)	0円
分配金合計額		設定来： 0円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

≪主要な資産の状況≫

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成

資産	銘柄数	比率
国内債券	1	19.3%
コール・ローン、その他		80.7%
合計	1	100.0%

その他資産別構成

資産	銘柄数	比率
外国株式先物	1	298.9%

通貨別構成

種別	比率
日本円	100.0%
米ドル	0.0%

組入上位10銘柄

銘柄名	資産名	比率
DJIA MINI e-CBOT SEP 25	外国株式 先物	298.9%
1306国庫短期証券	国内債券	19.3%

■当資料は、ファンドの状況や関連する情報等をお知らせするために大和アセットマネジメントにより作成されたものです。当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって投資元本が保証されているものではありません。当ファンドの取得をご希望の場合には投資信託説明書（交付目論見書）を販売会社よりお渡しいたしますので、必ず内容をご確認の上ご自身でご判断ください。後述の当資料のお取り扱いにおけるご注意をよくお読みください。

設定・運用： 大和アセットマネジメント Daiwa Asset Management

商号等　大和アセットマネジメント株式会社
金融商品取引業者　関東財務局長（金商）第352号

加入協会　一般社団法人投資信託協会
一般社団法人日本投資顧問業協会
一般社団法人第二種金融商品取引業協会

≪ファンドの目的・特色≫

ファンドの目的

・日々の基準価額の値動きがダウ・ジョーンズ工業株価平均（配当込み、米ドルベース）の値動きの 3 倍程度となることをめざします。

ファンドの特色

・株式の組入総額と株価指数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 倍程度になるように調整します。

・毎年 3 月 29 日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

ダウ・ジョーンズ工業株価平均（「当インデックス」）は S&P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S&P®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®および CDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S&P」）の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスは SPDJI に付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

≪投資リスク≫

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、**投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。投資信託は預貯金とは異なります。**基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

株価指数先物取引の利用に伴うリスク	株価指数先物の価格は、対象指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合の先物価格の下落により損失が発生し、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。また、先物を買建てている場合の株式市場の下落によって、株式市場の変動率に比べて大きな損失が生じる可能性があります。 なお、対象指数の値動き等に変動がなくても、収益または損失が発生することがあります。
価格変動リスク・信用リスク 株価の変動	組入資産の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。 株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。 発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。
価格変動リスク・信用リスク 公社債の価格変動	組入資産の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。 公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。 特に、発行体が債務不履行を発生させた場合、またはその可能性が予想される場合には、公社債の価格は下落します。
為替変動リスク	為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。 為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。
カントリー・リスク	投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。
その他	解約資金を手当てするため組入証券を売却する際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第 37 条の 6 の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。
- 当ファンドはレバレッジ運用を行なうにあたり先物取引を利用するため、借入金利に相当する負担があります。そのため、長期に保有する場合、金利負担が累積されます。
- レバレッジ倍率に比した高リスク商品であり、初心者向けの商品ではありません。長期に保有する場合、対象資産の値動きに比べて基準価額が大幅に値下がりすることがあるため、そのことについてご理解いただける方に適しています。

≪ファンドの費用≫

投資者が直接的に負担する費用			
		料率等	費用の内容
購入時手数料		販売会社が別に定める率 〈上限〉2.2%（税抜2.0%）	購入時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。
信託財産留保額		ありません。	—
投資者が信託財産で間接的に負担する費用			
		料率等	費用の内容
運用管理費用（信託報酬）		年率1.1% （税抜1.0%）	運用管理費用の総額は、日々の信託財産の純資産総額に対して左記の率を乗じて得た額とします。運用管理費用は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。
配分（税抜）（注1）	委託会社	年率0.4875%	ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価です。
	販売会社	年率0.4875%	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価です。
	受託会社	年率0.025%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価です。
その他の費用・手数料		（注２）	監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を信託財産でご負担いただきます。

（注1）「運用管理費用の配分」には、別途消費税率を乗じた額がかかります。
（注2）「その他の費用・手数料」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。
※購入時手数料について、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。
※運用管理費用の信託財産からの支払いは、毎計算期間の最初の6か月終了日（休業日の場合翌営業日）および毎計算期末または信託終了時に行なわれます。
※手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。また、上場投資信託証券は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

≪お申込みメモ≫

購入単位	最低単位を 1 円単位または 1 口単位として販売会社が定める単位
購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額（1 万口当たり）
購入代金	販売会社が定める期日までにお支払い下さい。
換金単位	最低単位を 1 口単位として販売会社が定める単位
換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額（1 万口当たり）
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して 5 営業日目からお支払いします。
申込受付中止日	① ニューヨーク証券取引所またはシカゴ・マーカンタイル取引所の休業日 ②「委託会社の休業日かつシカゴ・マーカンタイル取引所が休業日でない日」の前営業日 ③ ①②のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日 （注）申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。
申込締切時間	原則として、午後 3 時 30 分まで（販売会社所定の事務手続きが完了したもの） なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の換金申込みには制限があります。
購入・換金申込受付の中止および取消し	●次に該当する場合には、委託会社の判断で、購入、換金の受付けを中止または取消しにすることがあります。 ・株価指数先物取引のうち主として取引を行なうものについて、当該先物取引にかかる金融商品取引所等における当日の立会が行なわれないときもしくは停止されたとき。 ・株価指数先物取引のうち主として取引を行なうものについて、当該先物取引にかかる金融商品取引所等における当日の立会終了時の当該先物取引の呼値が当該金融商品取引所等が定める呼値の値幅の限度の値段とされる等やむを得ない事情が発生したことから、当ファンドの当該先物取引にかかる呼値の取引数量の全部もしくは一部についてその取引が成立しないとき。 ●金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生した場合には、購入、換金の申込みの受付けを中止すること、すでに受付けた購入、換金の申込みを取消すことがあります。
繰上償還	次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了（繰上償還）できます。 ・受益権の口数が 30 億口を下ることとなった場合 ・ダウ・ジョーンズ工業株価平均（配当込み、米ドルベース）が改廃された場合 ・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 ・やむを得ない事情が発生したとき
収益分配	年 1 回、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。 （注）当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金支払いコース」があります。なお、お取扱い可能なコースおよびコース名については異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。
課税関係	課税上は株式投資信託として取扱われます。配当控除、益金不算入制度の適用はありません。 公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に NISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。 当ファンドは、NISA の対象ではありません。 ※税法が改正された場合等には変更される場合があります。

≪基準価額の値動きについて≫

日々の基準価額の値動きは、米国の株式市場の値動きの「ちょうど3倍」になるとはかぎりません。その主な要因は次のとおりです。

イ．米国の株式市場の値動きと、利用する株価指数先物の値動きとの差
ロ．株価指数先物取引の約定価格と終値の差
ハ．株価指数先物取引をロールオーバーする過程における、限月の異なる先物間の価格差の変動
ニ．運用管理費用（信託報酬）、監査報酬、売買委託手数料等の負担
ホ．株価指数先物の流動性が低下した場合における売買対応の影響
ヘ．株価指数先物の最低取引単位の影響
ト．配当利回りと短期金利の差
※将来の米国の金利水準によっては、さらに乖離が拡大する場合があります。
チ．為替変動により、株価指数先物取引の買建ての額を円に換算した額が、目標としている額から乖離することにより、目標とする投資成果が達成できない場合があること

1 ファンド保有期間が2日以上の場合の投資成果は、通常「3倍程度」になるわけではありません。以下の［例1］および［例2］をご参照下さい。

［例1］翌日にダウ・ジョーンズ工業株価平均が10％下落し、翌々日にダウ・ジョーンズ工業株価平均が10％上昇した場合

	基準日	翌日（前日比）		翌々日（前日比）		翌々日と基準日の比較
ダウ・ジョーンズ工業株価平均	100	90	−10%	99	+10%	−1%
当ファンドの基準価額	100	70	−30%	91	+30%	−9%

◇「翌々日」と「基準日」とを比較し、
「当ファンド」の基準価額は（91−100）÷100＝−9%であり、
ダウ・ジョーンズ工業株価平均の値動き（99−100）÷100＝−1%の3倍とはなっていません。

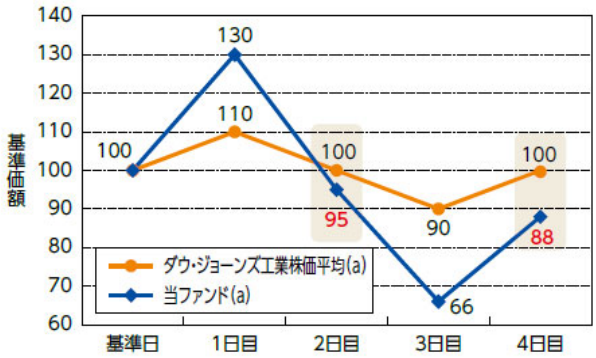
［例2］翌日にダウ・ジョーンズ工業株価平均が10％上昇し、翌々日にダウ・ジョーンズ工業株価平均がさらに10％上昇した場合

	基準日	翌日（前日比）		翌々日（前日比）		翌々日と基準日の比較
ダウ・ジョーンズ工業株価平均	100	110	+10%	121	+10%	+21%
当ファンドの基準価額	100	130	+30%	169	+30%	+69%

◇「翌々日」と「基準日」とを比較し、
「当ファンド」の基準価額は（169−100）÷100＝69%であり、
ダウ・ジョーンズ工業株価平均の値動き（121−100）÷100＝21%の3倍とはなっていません。

2 一般に、ダウ・ジョーンズ工業株価平均が上昇・下落をしながら動いた場合には、基準価額は押下げられることになります。以下の［例1］および［例2］をご参照下さい。

［例1］ダウ・ジョーンズ工業株価平均が±10の範囲で上昇・下落を繰返した場合



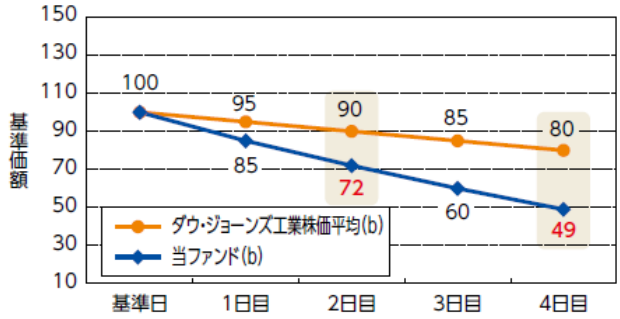
左図の「2日目」、「4日目」において「ダウ・ジョーンズ工業株価平均(a)」は「基準日」と同じ「100」ですが、「当ファンド(a)」はそれぞれの時点において「100」以下となっています。このように、「ダウ・ジョーンズ工業株価平均(a)」が上昇・下落を繰返した場合には、「当ファンド(a)」の基準価額は時間の経過とともに押下げられることとなります。

※上記グラフにおいて示される各数値は、小数点以下を四捨五入して算出した値です。

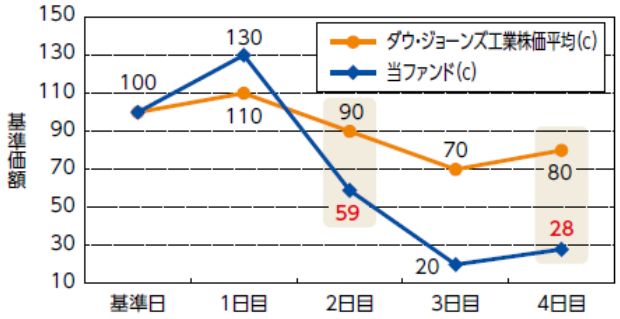
※上記は、基準価額の値動きをわかりやすく説明するため、細部を省略し抽象化して説明した例であり、実際とは異なりますのでご注意下さい。

[例2] ダウ・ジョーンズ工業株価平均が
「(1) 一方的に推移した場合」および「(2) 上昇・下落しながら次第に推移していった場合」

(1-1) 一方的に下落した場合



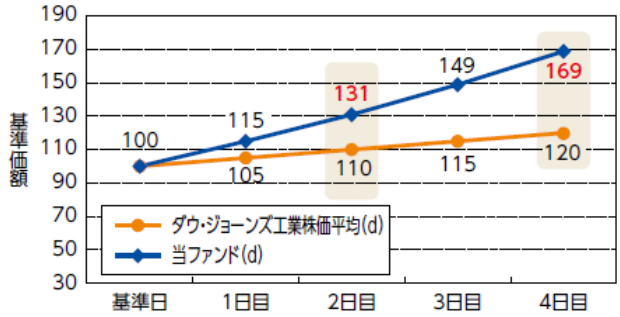
(2-1) 上昇・下落しながら次第に下落していった場合



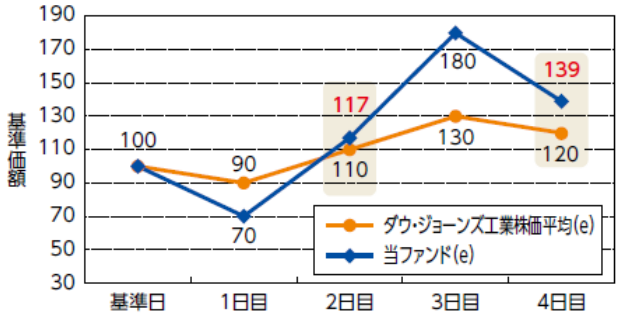
当ファンド		基準日	2日目	4日目
ダウ・ジョーンズ工業株価平均		100	90	80
(1) 一方的に下落した場合	当ファンド(b)	100	72	49
(2) 上昇・下落しながら次第に下落していった場合	当ファンド(c)	100	59	28

(1-1)、(2-1) の「2日目」、「4日目」において、「ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (b)」および「ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (c)」はそれぞれ「90」、「80」で同じですが、「ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (b)」に対応する「当ファンド (b)」と「ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (c)」に対応する「当ファンド (c)」では、「当ファンド (b)」の方が高い水準となっています。このように、ダウ・ジョーンズ工業株価平均が一方的に下落する場合と上昇・下落を繰返しながら次第に下落する場合とでは、最終的にダウ・ジョーンズ工業株価平均が同じ水準になったとしても、上昇・下落をしながら次第に下落した場合の基準価額が押下げられることとなります。

(1-2) 一方的に上昇した場合



(2-2) 上昇・下落しながら次第に上昇していった場合



当ファンド		基準日	2日目	4日目
ダウ・ジョーンズ工業株価平均		100	110	120
(1) 一方的に上昇した場合	当ファンド(d)	100	131	169
(2) 上昇・下落しながら次第に上昇していった場合	当ファンド(e)	100	117	139

(1-1)、(2-1)と同様に、ダウ・ジョーンズ工業株価平均が一方的に上昇する場合と上昇・下落を繰返しながら次第に上昇する場合とでは、最終的にダウ・ジョーンズ工業株価平均が同じ水準になったとしても、上昇・下落をしながら次第に上昇した場合の基準価額が押下げられることとなります。

※上記グラフにおいて示される各数値は、小数点以下を四捨五入して算出した値です。

※上記は、基準価額の値動きをわかりやすく説明するため、細部を省略し抽象化して説明した例であり、実際とは異なりますのでご注意下さい。

≪当資料のお取り扱いにおけるご注意≫

- 当資料は、ファンドの状況や関連する情報等をお知らせするために大和アセットマネジメントにより作成されたものです。
- 当ファンドのお申込みにあたっては、販売会社よりお渡しする「投資信託説明書（交付目論見書）」の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。
- 投資信託は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではありません。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。投資信託は預貯金とは異なります。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。証券会社以外でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。
- 当資料は、信頼できると考えられる情報源から作成していますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。運用実績などの記載内容は過去の実績であり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。また、税金、手数料等を考慮していませんので、投資者のみなさまの実質的な投資成果を示すものではありません。
- 当資料の中で記載されている内容、数値、図表、意見等は資料作成時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。
- 分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

販売会社等についてのお問い合わせ

- 大和アセットマネジメント　フリーダイヤル　0120-106212（営業日の 9:00～17:00）

当社ホームページ

- https://www.daiwa-am.co.jp/

取扱い販売会社

2025年6月30日　現在

NYダウ・トリプル・レバレッジ（愛称：3σ）

販売会社名（業態別、50音順） （金融商品取引業者名）		登録番号	加入協会			
			日本証券業協会	一般社団法人金融先物取引業協会	一般社団法人日本投資顧問業協会	一般社団法人第二種金融商品取引業協会
株式会社イオン銀行 (委託金融商品取引業者 マネックス証券株式会社)	登録金融機関	関東財務局長(登金)第633号	○			
株式会社SBI新生銀行 (委託金融商品取引業者 株式会社SBI証券)	登録金融機関	関東財務局長(登金)第10号	○	○		
株式会社SBI新生銀行 (委託金融商品取引業者 マネックス証券株式会社)	登録金融機関	関東財務局長(登金)第10号	○	○		
PayPay銀行株式会社	登録金融機関	関東財務局長(登金)第624号	○	○		
あかつき証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第67号	○	○	○	
株式会社SBI証券	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第44号	○	○		○
岡三証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第53号	○	○	○	○
松井証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第164号	○	○		
マネックス証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第165号	○	○	○	○
三菱UFJ　eスマート証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第61号	○	○	○	○
moomoo証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第3335号	○		○	
楽天証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第195号	○	○	○	○

上記の販売会社は今後変更となる場合があります。また、販売会社によって、新規のご購入の取扱いを行っていない場合や、お申込み方法・条件等が異なります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。