

令和5年6月2日

各位

外国投資法人名 ウィズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・  
リミテッド  
代 表 者 クリストファー・フォールズ  
管 理 会 社 名 ウィズダムツリー・マネジメント・ジャージー・  
リミテッド (管理会社コード 16724)  
代 表 者 スティーブン・ロス  
問 合 せ 先 TMI 総合法律事務所  
担 当 者 中川 秀宣 (TEL 03-6438-5660)

基準価額と市場価格の重要な乖離について

ウィズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド (以下「本管理会社」といいます。) を管理会社に、ウィズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド (以下「本発行体」といいます。) を外国投資法人として東京証券取引所に上場する以下の ETF 銘柄 (以下「本 ETF 銘柄」といいます。) について、基準価額と東京証券取引所における市場価格との間に「重要な乖離」(注) が発生しておりますことから、以下のとおり、お知らせいたします。

注：下記の [投資判断上ご留意頂きたい点] 記載のとおり、基準価格が 1 円を下回る状況では、市場で売却しようにも約定が成立せずに売却換価することが困難となる重大なリスクを伴います。

本 ETF 銘柄	コード
WisdomTree 天然ガス上場投資信託 (ガスETF)	1689

[乖離の状況]

本 ETF の令和5年6月2日午前0時 (ロンドン時間 2023年6月1日午後4時) 現在の一口当たりの資産額は、0.996 円 (但し、本 ETF 銘柄一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追随する米国先物市場終了後に確定される指数の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和5年6月2日午前6時 (ニューヨーク時間 2023年6月1日午後5時) 現在のブルームバーグによる為替レート (1米ドル=138.8円) により計算しています。) でありますところ、本 ETF 銘柄の本日 (6月2日) の東京証券取引所における市場価格は、以下の理由記載のとおり、1円を下回ることができません。

[重要な乖離とその理由]

令和5年4月12日付で重要な乖離が生じる可能性についてお知らせしましたとおり、本ETF銘柄の本則市場であるロンドン証券取引所においては呼値が0.0001米ドルである中で、本ETF銘柄が連動指数としているBloomberg天然ガス商品指数(Bloomberg Natural Gas Subindex)が近時急落していることにより、一口当たりの資産額が日本円に換算して1円を下回る状況が、今後も生じ得ます。またドル円の為替レートが円高に動きますと円建てでの基準価額が更に下落します。一方で、本ETF銘柄を含む東京証券取引所における上場ETFの呼値は下限が1円であるため、市場価格が1円を下回ることはありません。これにより、市場価格と基準価額との間に重要な乖離が発生しております。

[投資判断上ご留意頂きたい点]

東京証券取引所における本ETF銘柄の売買は、引き続き通常通り行なわれる予定です。また、本ETF銘柄の上場廃止の予定もありません。

但し、現時点で、Bloomberg天然ガス商品指数(Bloomberg Natural Gas Subindex)は下落基調が続いており、またドル円の為替レートが円高に動きますと円建てでの基準価額が下落しますので、本ETF銘柄の東京証券取引所における基準価額と市場価格がさらに乖離する可能性も否定できません。基準価格が1円を下回る状況では、市場で売却しようにも約定が成立せずに売却換価することが困難となる重大なリスクを伴います。

本ETF銘柄を売買する際には、基準価格に関する日々の開示をご参考の上、基準価額と市場価格の乖離に十分にご注意下さい。

以上