

令和5年4月12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が生じる可能性について

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 (終値) との間に重要な乖離が発生する可能性が生じていることから、以下のとおり、お知らせいたします。

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4月12日午前0時 (ロンドン時間 2023年4月11日午後4時) 現在の一口当たりの資産額は、1.153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4月12日午前6時 (ニューヨーク時間 2023年4月11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=133.7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 (4月12日) の東京証券取引所における市場価格 (終値) は 1.2円となっております。

[重大な乖離が生じる可能性とその理由]

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大な乖離が発生する可能性があります。

[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 円を下回る状況で本 ETF 銘柄を購入します
と、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