

令和6年2月19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)

上場ETF(管理会社:WisdomTree、外国投資法人:CSL)に関する日々の開示事項

ウィズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド(WisdomTree)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(CSL)を外国投資法人として上場する
以下のETF銘柄について、令和6年2月16日現在の状況をご報告します。

上場ETF 銘柄(14銘柄)

| 掲載番号 | 銘柄名 | 銘柄コード | 上場取引所 |
|------|---|-------|-------|
| 1 | WisdomTree ブロード上場投資信託(商品ETF) | 1684 | 東 |
| 2 | WisdomTree エネルギー上場投資信託(エナジーETF) | 1685 | 東 |
| 3 | WisdomTree 産業用金属上場投資信託(メタルETF) | 1686 | 東 |
| 4 | WisdomTree 農産物上場投資信託(アグリETF) | 1687 | 東 |
| 5 | WisdomTree 穀物上場投資信託(穀物ETF) | 1688 | 東 |
| 6 | WisdomTree 天然ガス上場投資信託(ガスETF) | 1689 | 東 |
| 7 | WisdomTree WTI 原油上場投資信託(原油ETF) | 1690 | 東 |
| 8 | WisdomTree ガソリン上場投資信託(ガソリンETF) | 1691 | 東 |
| 9 | WisdomTree アルミニウム上場投資信託(アルミETF) | 1692 | 東 |
| 10 | WisdomTree 銅上場投資信託(銅ETF) | 1693 | 東 |
| 11 | WisdomTree ニッケル上場投資信託(ニッケルETF) | 1694 | 東 |
| 12 | WisdomTree 小麦上場投資信託(小麦ETF) | 1695 | 東 |
| 13 | WisdomTree とうもろこし上場投資信託(コーンETF) | 1696 | 東 |
| 14 | WisdomTree 大豆上場投資信託(大豆ETF) | 1697 | 東 |

*各銘柄の状況につきましては、次のページ以降をご参照ください。なお、各銘柄名をクリックいただくと、各銘柄の状況が表示されます。

なお、1690 ガスETF、1695 小麦ETF及び1696 とうもろこしETFにつきましては、令和5年12月1日付効力発生で投資口の併合を行いました(令和5年10月30日付「投資口の併合及び売買単位の変更並びに売買の一時停止等に関するお知らせ」及び令和5年12月5日付「投資口の併合及び売買単位の変更並びに売買の一時停止等に関するお知らせ(続報)」)。

ご参考までに、対象銘柄の状況の末尾に、スケジュール及び併合比率等を掲載しております。

これら3銘柄の基準価額は併合により変わっておりますのでご注意ください。

取引再開後は売買単位も変わりました(100口単位から1口単位へ)。

これに伴い、2023年12月6日の取引開始時より、呼値は1円単位となりました。

株価動向に注意してお取引ください。

以上

[掲載番号1]

令和6年2月19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 |
| (銘柄コード 1684) | |
| 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) |

WisdomTree ブロード上場投資信託(商品ETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

8,178,921 口

2. 上場ETFの資産総額(令和6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

12,863,770,351 円 (85,638,575.00 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF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6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

1,573 円 (10.47 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率

(令和6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

-0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もっとも期近の先物契約ととも期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。))「逆輸(バックワーデーション: backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号2]

令和6年2月19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 |
| (銘柄コード 1685) | |
| 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) |

WisdomTree エネルギー上場投資信託(エナジーETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

12,726,330 口

2. 上場ETFの資産総額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

6,899,092,268 円 (45,929,646.95 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF一口あたりの資産額は、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、指数が追従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 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

542 円 (3.61 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率

(令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

-0.04%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることとなります。もっとも期近の先物契約ともっとも期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)*「逆輸(バックワーデーション: backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号3]

令和6年2月19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・ジャーニー・リミテッド |
| (銘柄コード 1686) | |
| 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) |

WisdomTree 産業用金属上場投資信託(メタルETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

30,976,342 口

2. 上場ETFの資産総額(令和6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

64,196,608,189 円 (427,379,057.25 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF一口あたりの資産額は、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、指数が追隨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6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

2,072 円 (13.80 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率

(令和6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もともと期近の先物契約ともともと期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)¹⁾「逆輸(バックワーデーション: backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

以上

[掲載番号4]

令和6年2月19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 |
| (銘柄コード 1687) | |
| 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) |

WisdomTree 農産物上場投資信託(アグリETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

36,037,794 口

2. 上場ETFの資産総額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

32,665,522,273 円 (217,465,696.51 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF一口あたりの資産額は、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、指数が追隨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 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

906 円 (6.03 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率

(令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることとなります。もっとも期近の先物契約ととも期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)*「逆輸(バックワーデーション: backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号5]

令和6年2月19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 |
| (銘柄コード 1688) | |
| 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) |

WisdomTree 穀物上場投資信託(穀物ETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

5,033,502 口

2. 上場ETFの資産総額(令和6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

2,860,540,511 円 (19,043,609.02 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF一口あたりの資産額は、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、指数が追従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6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

568 円 (3.78 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率

(令和6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることとなります。もっとも期近の先物契約と期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)¹⁾「逆輸(バックワーデーション: backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

以上

[掲載番号6]

令和6年2月19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 |
| (銘柄コード 1689) | |
| 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) |

WisdomTree 天然ガス上場投資信託(ガスETF) に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

12,059,486 口

2. 上場ETFの資産総額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

14,219,387,550 円 (94,663,388.26 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF一口あたりの資産額は、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 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

1,179.10 円 (7.85 米ドル)

注: 当面、小数点以下2桁目まで表示しております。

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることとなります。もっとも期近の先物契約ともっとも期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)[「逆輸(バックワーデーション:backwardation)」「(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)]である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ:contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

6. 投資口の併合について

(1)併合比率

令和5年12月1日付で 1,783口を 1口に 併合しました。

(2)スケジュール

本併合による影響を受けて、株式会社証券保管振替機構は基準日の翌営業日から現地保管機関における併合後の残高を確認し、これを同社が管理する外国株券等振替口座簿に反映させる日までの間、本ETF銘柄の振替を一時停止します。これに伴い、東京証券取引所において、本ETF銘柄の売買の一時停止等が行われます。

2023年11月20日（月） ToSTNeTにおいてT+9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月21日（火） ToSTNeTにおいてT+8～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月22日（水） ToSTNeTにおいてT+7～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月24日（金） ToSTNeTにおいてT+6～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月27日（月） ToSTNeTにおいてT+5～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月28日（火） ToSTNeTにおいてT+4～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月29日（水） ToSTNeTにおいてT+3～9の取引不可
 東証立会市場における取引最終日
 2023年11月30日（木） 東証における取引停止（取引時間前から）
 2023年12月1日（金）（現地時間）欧州における旧証券の基準日/取引最終日
 2023年12月4日（月）（現地時間）欧州での新規証券の取引初日
 2023年12月6日（水） 東証における取引再開（ToSTNeTを含む）（取引時間開始から）
 売買単位を100投資口から1投資口に変更（後述）
 2023年12月4日（月）～2024年1月中旬（予定）基準日時点における外国株券等実質株主と本併合により生じる個々の外国株券等実質株主が保有することとなる端数の判明調査期間
 2024年1月下旬（予定）基準日時点における端数の市場売却（後述）による換金
 2024年2月下旬（予定）市場売却により換金した金銭の外国株券等実質株主への分配（注）
 （注） 但し、外国株券等実質株主数が想定より大幅に多い場合は、日程が後ろ倒しになる可能性もございます。予めご了承ください。

(3) 上記に伴う日本国内での端数の換金処理について

本ETF銘柄に係る株式会社証券保管振替機構を通じて保有されている投資口につきましては、基準日時点における外国株券等実質株主及びその保有する投資口数を確定させた後、本併合により各外国株券等実質株主ごとに生じる端数を総合計して形成される整数の投資口数の投資口を、株式会社証券保管振替機構が市場にて売却換価することにより、当該端数の各外国株券等実質株主に対する分配に充当する予定です。

各外国株券等実質株主の皆様が基準日時点で保有されていることとなる端数に相当する金銭の額及び分配時期については、基準日後に、詳細が分かり次第お知らせします。但し、その換金率については、基準日における基準価額ではなく市場において実際に売却された価格（時価）を基準とした価格となります。

なお、理論的には、各本ETF銘柄について、その各銘柄の併合比率と、現在の売買単位である100との公倍数に相当する口数を、基準日時点で登録保有されている外国株券等実質株主には、本併合による端数は生じません。

(4) 東京証券取引所における売買単位について

本併合に伴い、2023年12月6日（水）の取引再開（ToSTNeTを含みます。）時から、売買単位を、現在適用されている100投資口から1投資口に変更します。

これに伴い、2023年12月6日の取引開始時より、呼値は1円単位となります。

以上

[掲載番号7]

令和6年2月19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 |
| (銘柄コード 1690) | |
| 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) |

WisdomTree WTI 原油上場投資信託(原油ETF) に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

86,885,595 口

2. 上場ETFの資産総額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

127,610,202,879 円 (849,545,322.41 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF一口あたりの資産額は、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、指数が追隨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 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

1,469 円 (9.78 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率

(令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることとなります。もっとも期近の先物契約ともっとも期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします)「逆輸(バックワーデーション: backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号8]

令和6年2月19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 |
| (銘柄コード 1691) | |
| 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) |

WisdomTree ガソリン上場投資信託(ガソリンETF) に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

101,672 口

2. 上場ETFの資産総額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

836,190,554 円 (5,566,810.16 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF一口あたりの資産額は、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、指数が追隨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 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

8,224 円 (54.75 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率

(令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もともと期近の先物契約ともともと期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)¹⁾「逆輸(バックワーデーション: backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号9]

令和6年2月19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 |
| (銘柄コード 1692) | |
| 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) |

WisdomTree アルミニウム上場投資信託(アルミETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

44,029,021 口

2. 上場ETFの資産総額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

19,442,717,920 円 (129,436,907.79 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF一口あたりの資産額は、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 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

442 円 (2.94 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率

(令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もともと期近の先物契約ともともと期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)*「逆輸(バックワーデーション:backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)*である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ:contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号10]

令和6年2月19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・ジャーニー・リミテッド |
| (銘柄コード 1693) | |
| 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) |

WisdomTree 銅上場投資信託(銅ETF) に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

43,889,761 口

2. 上場ETFの資産総額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

226,047,561,758 円 (1,504,876,917.37 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF一口あたりの資産額は、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、指数が追従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 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

5,150 円 (34.29 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率

(令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もともと期近の先物契約ともともと期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)¹⁾「逆輸(バックワーデーション: backwardation)」「(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限のものよりも、期先限のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

以上

[掲載番号11]

令和6年2月19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・ジャーニー・リミテッド |
| (銘柄コード 1694) | |
| 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) |

WisdomTree ニッケル上場投資信託(ニッケルETF) に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

6,557,238 口

2. 上場ETFの資産総額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

14,751,643,444 円 (98,206,800.10 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF一口あたりの資産額は、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 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

2,250 円 (14.98 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率

(令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もともと期近の先物契約ととも期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)*「逆輸(バックワーデーション: backwardation)」「(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)*である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号12]

令和6年2月19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 |
| (銘柄コード 1695) | |
| 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) |

WisdomTree 小麦上場投資信託(小麦ETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

3,587,325 口

2. 上場ETFの資産総額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

12,448,427,523 円 (82,873,493.93 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF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、指数が追従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 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

3,470 円 (23.10 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率

(令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もともと期近の先物契約ともともと期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)
「逆輸(バックワーデーション: backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

6. 投資口の併合について

(1)併合比率

令和5年12月1日付で 46口を 1口に 併合しました。

(2) スケジュール

本併合による影響を受けて、株式会社証券保管振替機構は基準日の翌営業日から現地保管機関における併合後の残高を確認し、これを同社が管理する外国株券等振替口座簿に反映させる日までの間、本ETF銘柄の振替を一時停止します。これに伴い、東京証券取引所において、本ETF銘柄の売買の一時停止等が行われます。

2023年11月20日（月） ToSTNeTにおいてT+9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月21日（火） ToSTNeTにおいてT+8～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月22日（水） ToSTNeTにおいてT+7～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月24日（金） ToSTNeTにおいてT+6～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月27日（月） ToSTNeTにおいてT+5～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月28日（火） ToSTNeTにおいてT+4～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月29日（水） ToSTNeTにおいてT+3～9の取引不可
 東証立会市場における取引最終日
 2023年11月30日（木） 東証における取引停止（取引時間前から）
 2023年12月1日（金）（現地時間）欧州における旧証券の基準日/取引最終日
 2023年12月4日（月）（現地時間）欧州での新規証券の取引初日
 2023年12月6日（水） 東証における取引再開（ToSTNeTを含む）（取引時間開始から）
 売買単位を100投資口から1投資口に変更（後述）
 2023年12月4日（月）～2024年1月中旬（予定）基準日時点における外国株券等実質株主と本併合により生じる個々の外国株券等実質株主が保有することとなる端数の判明調査期間
 2024年1月下旬（予定）基準日時点における端数の市場売却（後述）による換金
 2024年2月下旬（予定）市場売却により換金した金銭の外国株券等実質株主への分配（注）
 （注） 但し、外国株券等実質株主数が想定より大幅に多い場合は、日程が後ろ倒しになる可能性もございます。予めご了承ください。

(3) 上記に伴う日本国内での端数の換金処理について

本ETF銘柄に係る株式会社証券保管振替機構を通じて保有されている投資口につきましては、基準日時点における外国株券等実質株主及びその保有する投資口数を確定させた後、本併合により各外国株券等実質株主ごとに生じる端数を総合計して形成される整数の投資口数の投資口を、株式会社証券保管振替機構が市場にて売却換価することにより、当該端数の各外国株券等実質株主に対する分配に充当する予定です。

各外国株券等実質株主の皆様が基準日時点で保有されていることとなる端数に相当する金銭の額及び分配時期については、基準日後に、詳細が分かり次第お知らせします。但し、その換金率については、基準日における基準価額ではなく市場において実際に売却された価格（時価）を基準とした価格となります。

なお、理論的には、各本ETF銘柄について、その各銘柄の併合比率と、現在の売買単位である100との公倍数に相当する口数を、基準日時点で登録保有されている外国株券等実質株主には、本併合による端数は生じません。

(4) 東京証券取引所における売買単位について

本併合に伴い、2023年12月6日（水）の取引再開（ToSTNeTを含みます。）時から、売買単位を、現在適用されている100投資口から1投資口に変更します。

これに伴い、2023年12月6日の取引開始時より、呼値は1円単位となります。

以上

[掲載番号13]

令和6年2月19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 |
| (銘柄コード 1696) | |
| 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) |

WisdomTree どうもろこし上場投資信託(コインETF) に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

888,116 口

2. 上場ETFの資産総額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

2,851,180,002 円 (18,981,292.87 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF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 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

3,210 円 (21.37 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることとなります。もっとも期近の先物契約ともっとも期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)
「逆輸(バックワーデーション:backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約より高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ:contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸をもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

6. 投資口の併合について

(1)併合比率

令和5年12月1日付で 22口を 1口に 併合しました。

(2)スケジュール

本併合による影響を受けて、株式会社証券保管振替機構は基準日の翌営業日から現地保管機関における併合後の残高を確認し、これを同社が管理する外国株券等振替口座簿に反映させる日までの間、本ETF銘柄の振替を一時停止します。これに伴い、東京証券取引所において、本ETF銘柄の売買の一時停止等が行われます。

2023年11月20日（月） ToSTNeTにおいてT+9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月21日（火） ToSTNeTにおいてT+8～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月22日（水） ToSTNeTにおいてT+7～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月24日（金） ToSTNeTにおいてT+6～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月27日（月） ToSTNeTにおいてT+5～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月28日（火） ToSTNeTにおいてT+4～9の取引不可（市場取引は影響なし）
 2023年11月29日（水） ToSTNeTにおいてT+3～9の取引不可
 東証立会市場における取引最終日
 2023年11月30日（木） 東証における取引停止（取引時間前から）
 2023年12月1日（金）（現地時間）欧州における旧証券の基準日/取引最終日
 2023年12月4日（月）（現地時間）欧州での新規証券の取引初日
 2023年12月6日（水） 東証における取引再開（ToSTNeTを含む）（取引時間開始から）
 売買単位を100投資口から1投資口に変更（後述）
 2023年12月4日（月）～2024年1月中旬（予定）基準日時点における外国株券等実質株主と本併合により生じる個々の外国株券等実質株主が保有することとなる端数の判明調査期間
 2024年1月下旬（予定）基準日時点における端数の市場売却（後述）による換金
 2024年2月下旬（予定）市場売却により換金した金銭の外国株券等実質株主への分配（注）
 （注） 但し、外国株券等実質株主数が想定より大幅に多い場合は、日程が後ろ倒しになる可能性もございます。予めご了承ください。

(3) 上記に伴う日本国内での端数の換金処理について

本ETF銘柄に係る株式会社証券保管振替機構を通じて保有されている投資口につきましては、基準日時点における外国株券等実質株主及びその保有する投資口数を確定させた後、本併合により各外国株券等実質株主ごとに生じる端数を総合計して形成される整数の投資口数の投資口を、株式会社証券保管振替機構が市場にて売却換価することにより、当該端数の各外国株券等実質株主に対する分配に充当する予定です。

各外国株券等実質株主の皆様が基準日時点で保有されていることとなる端数に相当する金銭の額及び分配時期については、基準日後に、詳細が分かり次第お知らせします。但し、その換金率については、基準日における基準価額ではなく市場において実際に売却された価格（時価）を基準とした価格となります。

なお、理論的には、各本ETF銘柄について、その各銘柄の併合比率と、現在の売買単位である100との公倍数に相当する口数を、基準日時点で登録保有されている外国株券等実質株主には、本併合による端数は生じません。

(4) 東京証券取引所における売買単位について

本併合に伴い、2023年12月6日（水）の取引再開（ToSTNeTを含みます。）時から、売買単位を、現在適用されている100投資口から1投資口に変更します。

これに伴い、2023年12月6日の取引開始時より、呼値は1円単位となります。

以上

[掲載番号14]

令和6年2月19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 |
| (銘柄コード 1697) | |
| 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) |

WisdomTree 大豆上場投資信託(大豆ETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

333,986 口

2. 上場ETFの資産総額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

1,410,094,760 円 (9,387,489.25 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額 (令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

(上場ETF一口あたりの資産額は、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 6年2月17日午前6時(ニューヨーク時間2024年2月16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=150.21円)により計算しています。)

4,222 円 (28.11 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率

(令和 6年2月17日午前0時(ロンドン時間2024年2月16日午後4時)現在)

0.00%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もっとも期近の先物契約と期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)[逆輸(バックワーデーション: backwardation)](期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸(コンタンゴ: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指数及び単一商品指数の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期近先物契約及び次期先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指数において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸又は順輸を示している場合、両指数に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指数は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

以上