

1) 부실자산의 발생

회사코드	회사명	펀드명	펀드코드	설정일
A01021	한화자산운용	한화단기하이일드 증권 모투자신탁 (채권)	KR5237A90343	2012.3.12

발생일	부실사유	부실단계	유가증권코드	유가증권명
2020.4.1*	*파산절차진행	발생단계	US966387AH55	WLL 5.75 03/15/21

보유수량	평가금액	상각금액	상각률(%)
USD 115,000	USD 12,462.44	0원	0%

\* 발생일 : 한국시각 4월 2일(목) (미국시각 4월 1일) Whiting Petroleum이 Chapter 11 신청

\* 부실사유 : Chapter 11 신청

\* 평가금액 : 현재 펀드에서 해당 채권은 미국 시장에서의 거래가격을 반영하여 1달러당 0.1083달러 (10.83센트)로 펀드에서 평가되고 있음

\* 상각금액 : 현재 미국 채권시장에서 거래되는 가격인 약 10.83센트로 매각 시도 예정