

이지스글로벌공모부동산투자신탁281호(파생형)

환헤지 계약 종료 안내의 건

2024.07.10.

제 목	이지스글로벌공모부동산투자신탁281호(파생형) 환헤지 계약 종료 안내의 건																																							
내 용	<p>이지스글로벌공모부동산투자신탁281호(파생형) Class A 및 운용펀드(이하 "본건 펀드")의 환헤지 계약 종료 및 관련 사항을 다음과 같이 안내 드립니다.</p> <p style="text-align: center;">- 다 음 -</p> <p>■ 환헤지 현황</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 20%;">환헤지 은행 (이하 "환은행")</td> <td colspan="3">Standard Chartered Bank Korea Ltd.(이하 "SC은행")</td> </tr> <tr> <td rowspan="6" style="text-align: center; vertical-align: middle;">잔여 환헤지 내역</td> <td colspan="3">[GBP/EUR 원금 환헤지]</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">환헤지 구분</td> <td style="text-align: center;">통화 / 계약금액</td> <td style="text-align: center;">계약환율</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">CRS / 원금</td> <td style="text-align: center;">GBP 48,250,000</td> <td style="text-align: center;">1,474.8</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">100%</td> <td style="text-align: center;">EUR 114,450,000</td> <td style="text-align: center;">1,322.0</td> </tr> <tr> <td colspan="3" style="text-align: right;">만기일</td> </tr> <tr> <td colspan="3" style="text-align: right;">24.07.10.</td> </tr> <tr> <td colspan="4">[GBP/EUR 배당 환헤지]</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">환헤지 구분</td> <td style="text-align: center;">통화 / 계약금액</td> <td style="text-align: center;">원화 정산금</td> <td style="text-align: center;">만기일</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">CRS / 배당</td> <td style="text-align: center;">GBP 1,331,578</td> <td style="text-align: center;">KRW 1,060,134,120</td> <td style="text-align: center;">24.07.10.</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: center;">EUR 3,502,133</td> <td style="text-align: center;">KRW 2,847,313,314</td> <td></td> </tr> </table> <p>■ 환헤지 계약 종료에 따른 환노출 안내</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 환은행과 체결된 환헤지 계약이 24년 7월 10일 부 종료됨에 따라 본건 펀드는 이후 환율 변동위험에 노출됩니다.</li> </ul> <p>■ 환헤지 정산금 지급 관련 환은행 협의사항</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 본건 펀드 설정 이후, 유로/파운드화는 원화 대비 절상을 이어 나갔으며 24년 7월 9일 기준 EUR/KRW EUR/KRW 1,495.86원, GBP/KRW 1,769.48원으로 계약 환율을 상당 수준 상회하고 있습니다.</li> <li>- 24년 7월 9일 환율이 정산일까지 유지된다고 가정하면 정산금 지급을 위하여 필요한 금액은 약 378억 정도로 예상됩니다. 환헤지 만기일에 환은행에 정산금을 지급해야 하나 현재 펀드내 이를 이행할 재원이 충분하지 않은 상황입니다.</li> <li>- 이에 본건 펀드는 24년 7월 10일 환은행과 협의를 통해 정산금 중 본건 펀드가 보유하고 있는 130억을 정산일에 지급 후 잔여 정산금은 24년 9월 4일까지 지급하는 계약을 체결하였습니다.</li> <li>- 본 계약 체결에 따라 잔여 정산금 지급일까지 잔여 정산금에 대한 4.55% 이자가 발생합니다. 또한, 24년 9월 4일까지 잔여 정산금 지급이 불가할 경우 15%의 Default 이자가 발생합니다.</li> </ul> <p>■ 잔여 정산금 지급 계획</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 본건 펀드는 현재 잠재대주와 차환을 통해 대출 증액을 논의 중입니다. 이에 따라 대출 증액금 중 일부를 활용하여 24년 9월 4일까지 잔여 정산금을 지급할 계획임을 안내 드립니다. 끝.</li> </ul>	환헤지 은행 (이하 "환은행")	Standard Chartered Bank Korea Ltd.(이하 "SC은행")			잔여 환헤지 내역	[GBP/EUR 원금 환헤지]			환헤지 구분	통화 / 계약금액	계약환율	CRS / 원금	GBP 48,250,000	1,474.8	100%	EUR 114,450,000	1,322.0	만기일			24.07.10.			[GBP/EUR 배당 환헤지]				환헤지 구분	통화 / 계약금액	원화 정산금	만기일	CRS / 배당	GBP 1,331,578	KRW 1,060,134,120	24.07.10.		EUR 3,502,133	KRW 2,847,313,314	
환헤지 은행 (이하 "환은행")	Standard Chartered Bank Korea Ltd.(이하 "SC은행")																																							
잔여 환헤지 내역	[GBP/EUR 원금 환헤지]																																							
	환헤지 구분	통화 / 계약금액	계약환율																																					
	CRS / 원금	GBP 48,250,000	1,474.8																																					
	100%	EUR 114,450,000	1,322.0																																					
	만기일																																							
	24.07.10.																																							
[GBP/EUR 배당 환헤지]																																								
환헤지 구분	통화 / 계약금액	원화 정산금	만기일																																					
CRS / 배당	GBP 1,331,578	KRW 1,060,134,120	24.07.10.																																					
	EUR 3,502,133	KRW 2,847,313,314																																						