수 시 공 시

[한국투자뉴욕오피스부동산투자신탁1호 환헤지 계약 종료 및 부분 정산 합의서
(Partial Settlement Agreement) 체결]

한국투자리얼에셋운용
2025년 7월 1일

한국투자뉴욕오피스부동산투자신탁1호(이하 "본건 펀드")의 환헤지 계약 종료 및 정산금 부분 지급을 위한 합의서 체결과 관련하여 다음과 같이 안내 드립니다.

- 다 음 -

1. 기존 환헤지 내역

- 2019 년 본건 펀드 설정 당시, USD 환율 하락을 대비해 투자 원금 USD96,789,066.27 에 대한 5.7 년물 선물환 매도 계약을 환헤지은행과 체결함

체결일	만기일	만기 계약환율	지급 USD 계약금액
2019 년 10 월 23 일	2025 년 6 월 30 일	1,085.30 원 / 달러	USD96,789,066.27

2. 미지급 정산 금액 발생 배경

- 당사는 환헤지 계약 만기 전(2025 년 6 월 30 일) 투자자산을 매각하여 달러 현금(지분증권 매각자금)을 확보 후 환헤지은행에 달러를 지급 할 계획이었으나, 자산매각이 지연되어 달러 현금을 확보하지 못하였음

- 본건 펀드는 환헤지 계약 만기일 투자자산을 매각하여 USD96,789,066.27 를 지급해야 하나, 자산매각이 지연되어 최초 계약환율(1,085.30 원/달러) 대비 현재 환율(1,356.28 원/달러) 상승으로 발생한 환헤지 정산금을 환헤지은행에 지급해야함

- 펀드내 현금재원이 부족하여 정산차금 약 262.3 억원 중 약 6.8 억원만 환헤지은행에 지급하고, 부분 정산 합의서(Partial Settlement Agreement)를 체결함

3. 부분 정산 합의서(Partial Settlement Agreement) 주요 조건

	내용
환헤지은행	SC 제일은행
체결 내용	- 환헤지은행에 지급해야 할 최종 정산금은 26,227,901,178 원이며 지급 합의서 체결을 위하여, 펀드는 정산금 중에서 678,140,000 원에 대해서만 6 월 30 일 지급해야 하고 미지급 원화 정산금 25,549,761,178 원에 대해서 이자 지급

	- 또한, 2025 년 8 월 14 일까지 잔여 정산금 지급조건에 대한 "Payment Agreement"를 체결해야 함
이자율	6.57%(3 개월 CD 금리 + 가산금리 4.00%)
체결일	2025 년 6 월 30 일
기타 조건	1) 조건 불이행, ISDA(International Swaps and Derivatives Association, 장외파생상품계약) 위반, 본 합의 위반 발생 시, 잔여 금액 전액 즉시 상환 의무 발생 + 연체이자 부과 2) 연체 이자(위반 발생 시 적용): 3 개월 CD 금리 + 연 7%로 변경하여 적용

※ 3 개원 CD 금리 변동시 이자율 변동 가능

4. 향후 환헤지 전략 및 운용 계획

- 본건 펀드는 2024 년 8 월 8 일 개최한 수익자 총회 의결 결과에 따라 환헤지 계약을 체결 할 수 없어 환노출 전략으로 변경 운용될 예정
- 잔여 정산금 지급과 관련하여 환헤지은행과 지급합의서(Payment Agreement) 체결을 추진할 계획임. 끝.