

문서번호 : 채널컨설팅팀 제 2019-00107

일자 : 2019-10-08

수신 : 수신처 참조

참조 : 집합투자상품 관련 부서

제목 : 한화 단기하이일드증권 펀드 내 보유종목 부실자산 발생의 건

1. 귀 사(행)의 일익 번창하심을 기원합니다.
2. 당사에서 운용 중인 한화 단기하이일드 증권 모투자신탁(채권) 내에 보유하고 있던 종목 중 부실 자산이 2건 발생함에 따라 자본시장과 금융투자업에 관한 법률 제89조에 근거하여 다음과 같이 알려드립니다.

- 다 음 -

(1) 펀드명: 한화단기하이일드증권모투자신탁(채권)

(2) 발생일자: 한국시각 기준 2019년 10월 5일

(3) 부실자산 발생 내용:

유가증권코드	유가증권명	보유수량 (USD)	평가금액(원)	펀드 NAV 대비 비중(%)	상각금액 (원)	상각률 (%)
US268787AE89	EPENEG 8.0 11/29/24	75,000	46,780,158	0.10	0	0
US268787AH11	EPENEG 9.375 05/01/24	162,000	13,362,881	0.03	0	0

* 펀드 NAV 대비 비중(%): 10월 7일 기준

(4) 부실사유: EP Energy의 회생 절차 개시(Chapter 11신청)

(5) 당사 대응 방안: 해당 보유 종목 시장 매각을 통한 부실자산 처분, 첨부문건 참조.

- 첨부 문건: 부도채권 보고 자료 1부. 끝.

한화자산운용주식회사
대표이사 김용현

