

2020年5月15日

各位

不動産投資信託証券発行者名
 東京都港区六本木六丁目10番1号 六本木ヒルズ森タワー
 インヴィンシブル投資法人
 代表者名 執行役員 福田直樹
 (コード番号: 8963)

資産運用会社名
 コンソナント・インベストメント・マネジメント株式会社
 代表者名 代表取締役社長 福田直樹
 問合せ先 企画部長 粉生潤
 (TEL 03-5411-2731)

為替オプション契約の一部解消に関するお知らせ

インヴィンシブル投資法人(以下「本投資法人」といいます。)は、海外不動産であるウェスティン・グランドケイマン・セブンマイルビーチ・リゾート&スパ及びサンシャイン・スイーツ・リゾート(以下、総称して「本海外不動産」といいます。)に係る収益に関して実施した、以下の為替オプション取引(以下「本為替オプション取引」といいます。)の解消(以下「本解消」といいます。)を実施しましたので、下記のとおりお知らせいたします。

本投資法人は、本海外不動産からの収益に係る為替レートの変動をヘッジするため、本海外不動産の想定NOIの85%程度の額をヘッジの対象額として本為替オプション取引を実施していたところ、本海外不動産は新型コロナウイルス感染症の感染拡大の影響により、本年3月下旬より営業休止を余儀なくされており、本年4月から6月の期間にかけての収益が大幅に減少することが想定されます。そのため、本投資法人は、2019年3月4日付「為替オプション契約の締結に関するお知らせ」にてお知らせした為替オプション契約のうち、当該期間の想定収益に対応する本為替オプション取引(想定元本: 7,979 千米ドル)を解消しました。

なお、本解消の対象となる本為替オプション取引を除き、2019年3月4日付及び2020年2月21日付の各「為替オプション契約の締結に関するお知らせ」にてお知らせした為替オプション契約のうち、受渡日(権利行使日)が未到来のものは引き続き維持します。

記

1. 本為替オプション取引の内容

本解消の対象となる本為替オプション取引の内容は、以下のとおりです。

(1) 契約先	野村証券株式会社	(1) 契約先	野村証券株式会社
(2) 契約金額	7,979 千米ドル	(2) 契約金額	7,979 千米ドル
(3) 取引内容	プットオプションの買い	(3) 取引内容	コールオプションの売り
(4) 権利行使価格	1 米ドル=110.00 円	(4) 権利行使価格	1 米ドル=110.00 円
(5) 約定日	2019年3月4日	(5) 約定日	2019年3月4日
(6) 権利行使日	2020年7月8日	(6) 権利行使日	2020年7月8日

2. 本解消の方法及び内容等

本投資法人は、本為替オプション取引を権利行使日前に実行するとともに、本為替オプション取引の契約金額と同額の7,979千米ドル分の円売り・ドル買い取引を本年5月15日時点のスポットレート(1米ドル=107.34円)により行うことで、本為替オプション取引を解消いたしました。

本解消を行うことにより、2020年6月期の営業外費用として約71万円が計上される見込みです。

3. 今後の見通し

本解消に伴う本投資法人の運用状況への影響は軽微です。

以上

* 本投資法人のホームページアドレス: <https://www.invincible-inv.co.jp/>