

平成 19 年 2 月 19 日

各 位

不動産投資信託証券発行者名
東京都千代田区永田町二丁目 11 番 1 号
日本レジデンシャル投資法人
執行役員 西 村 賢
(コード番号：8962)

投資信託委託業者名
東京都千代田区永田町二丁目 11 番 1 号
パシフィック・インベストメント・アドバイザーズ株式会社
代表者名 代表取締役社長 山 内 章
問合せ先 取締役 高 野 剛
(TEL：03-5251-8528)

金利キャップの購入に関するお知らせ

日本レジデンシャル投資法人（以下「本投資法人」といいます。）は、本日、下記のとおり金利キャップを購入することを決定致しましたのでお知らせ致します。

記

1. 金利キャップ購入の理由

平成 18 年 12 月 26 日に借入れました長期借入金 6,000 百万円についての金利上昇リスクをヘッジすることを目的としています。

2. 金利キャップ契約の内容

- | | |
|-----------|-----------------------------------------------------------|
| (1) 購入先 | 株式会社三菱東京 UFJ 銀行 |
| (2) 想定元本 | 3,000 百万円 |
| (3) 開始日 | 平成 19 年 2 月 28 日 |
| (4) 終了日 | 平成 23 年 12 月 26 日 |
| (5) 対象金利 | 3 ヶ月円 TIBOR |
| (6) 金利改定日 | 2 月、5 月、8 月、11 月の各末日（ただし、同日が営業日でない場合は直前の営業日。金利決定は 2 営業日前） |
| (7) ストライク | 1.38% |
| (8) キャップ料 | 55,800,000 円（想定元本に対して 1.86%） |

- | | |
|-----------|-----------------------------------------------------------|
| (1) 購入先 | 中央三井信託銀行株式会社 |
| (2) 想定元本 | 3,000 百万円 |
| (3) 開始日 | 平成 19 年 3 月 1 日 |
| (4) 終了日 | 平成 23 年 12 月 26 日 |
| (5) 対象金利 | 3 ヶ月円 TIBOR |
| (6) 金利改定日 | 2 月、5 月、8 月、11 月の各末日（ただし、同日が営業日でない場合は直前の営業日。金利決定は 2 営業日前） |
| (7) ストライク | 1.38% |

(8) キャップ料 54,600,000 円（想定元本に対して 1.82%）

3. 今後の見通し

平成 19 年 5 月期（平成 18 年 12 月 1 日～平成 19 年 5 月 31 日）における本投資法人の運用状況の見通しについては、修正はありません。

【ご参考：金利キャップについて】

金利キャップを購入すると、対象金利がストライクの金利を上回った場合、金利改定日に対象金利とストライクとの差額分の金利相当額が金利キャップ購入先から本投資法人に支払われます。

そのため、本投資法人はストライクの金利を超える金利負担を実質的にヘッジすることができ、金利上昇リスクを回避することが出来ます。

以 上

※ 本資料の配布先： 兜倶楽部、国土交通記者会、国土交通省建設専門紙記者会

※ 本投資法人のホームページアドレス <http://www.nric.co.jp>