

투자 위험 등급 2등급(높은 위험)					
1	2	3	4	5	6
매우 높은 위험	높은 위험	다소 높은 위험	보통 위험	낮은 위험	매우 낮은 위험

()

2



BNPP SRI 2 []

BNPP SRI 2 []

1. BNPP SRI 2 []

2. ()

3. [(www.shbnppam.com)]

4. 2020 09 23

5. 2020 09 25

6. () (10)

7. () ()

8. [] : () dart.fss.or.kr
[] : () dart.fss.or.kr
: (www.shbnppam.com) ,
(www.kofia.or.kr)

9. ()

가

가
가
「
」

1. .
2. ,
3. , 가
4. ,
5. , , , 가)
6. 가 가
7. 가
8. 가 가
9. 가
10. 가 가 가(,
11. 가 1 50 () 가 , , ,

12.

가 ,

가

.

· ,
,

Shinhan
신한BNP파리바자산운용

[]

-

1

1.

2.

3.

4.

5.

2

1.

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

11.

12.

13.

14.

3

1.

2.

4

1.

2.

3.

5

1.

2.

3.

4.

5.

6.

가

투자 위험 등급
2등급[높은 위험]

1	2	3	4	5	6
매우 높은 위험	높은 위험	다소 높은 위험	보통 위험	낮은 위험	매우 낮은 위험

BNPP

SRI

2 []

가

[]

1.

94 2 4

2.

(1)

1)

(“ SRI ”)
가

40%

2)

* : KOSPI *95% + *5%

(2)

<p>BNPPTops</p> <p>[SRI]</p>	<p>”)</p> <p>가</p> <p>가 .</p> <p>40%</p>	<p>100%</p>
--------------------------------	---	-------------

, (), (가), 가 (가 가), ,

		가 () (%)			1,000 가 (:)					
						1	2	3	5	10
	(A1)	1.00%	1.2100	0.5000	1.3700	223	350	482	761	1,556
	(C1)		1.9100	1.2000	1.5800	194	384	558	903	1,873
	(A-e)	0.50%	0.9600	0.2500	0.9900	148	250	356	580	1,225
	(C-e)		1.2100	0.5000	1.1800	124	252	385	667	1,468
<div>(1) '1,000 가 , 가 1,000 (+ ()) , , 5% 가 C1 가 (2) A1 C1 1 6 A-e C-e 1 11 가 , (3) (4) 2 13. (5)</div>										

			1	2	3	5	
			2019.08.31 ~ 2020.08.31	2018.08.31 ~ 2020.08.31	2017.08.31 ~ 2020.08.31	2015.08.31 ~ 2020.08.31	
	(A1)	2014.06.05	24.99	3.68	2.65	3.20	2.26
	(A-e)	2014.06.12	25.43	4.06	3.02	3.58	2.64
	(C-e)	2014.06.12	25.24	3.89	2.86	3.41	2.48
	(%)	2014.06.02	17.49	0.25	-0.34	3.63	2.49
	(%)	2014.06.02	28.89	22.73	19.88	17.73	17.77
<div>(1) : KOSPI *95% + *5% (2) (3) () (4) (5) (6)</div>							

	* BNPPTops SRI [] (2020.08.31)									
						(-)				
						1	2	1	2	
	1973		5	3,435	25.38%	3.19%	23.15%	4.18%	17	1

	(1)	,	‘	,	“	”	
	(2)	3	,	가	.		
	(3)	(www.kofia.or.kr)	.	가			
	(4)	‘	,		.		
	(5)				.		
	(6)	가		가			
	-	[]	가	.		
	-	가			가		
	-		,	.			
	-		.		가	,	
	-		.			,	
	-	,			.		
	-	.			.		
	-	가	1	50	()	
	-	가		,	,		
	가	.		.	.		
	가			.	.		
	가		,	가	,		
		가	.				
				가	,		
			,	가	.		
		가	가				
		가	가		()	
					.		
	SRI 가		SRI		SRI	가	
			.				
			,	,			
			.				
	가. 15 30	:	2	(D+1)	가		
	. 15 30	:	3	(D+2)	가		
	가. 15 30	:	2	(D+1)	가	4	(D+3)
	. 15 30	:	3	(D+2)	가	4	(D+3)

																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																							</
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	----

			()
			가 가 . ,
	(s)		가 가 ,
			(C1) (CDSC)
			가
			Wrap Account
			가 가

[
: (dart.fss.or.kr)
: (dart.fss.or.kr), (kofia.or.kr),
(www.shbnppam.com)
(,): (www.fss.or.kr)
(dis.kofia.or.kr)
: (dis.kofia.or.kr)
(www.shbnppam.com)
: (dis.kofia.or.kr) (www.shbnppam.com)
]

1.

()	
<u>BNPP</u> <u>SRI</u> <u>2 []</u>	AS391
<u>- (A1)</u>	AS392
<u>- (A-e)</u>	AS393
<u>- - (C1)</u>	AS394
<u>- - (C2)</u>	AS395
<u>- - (C3)</u>	AS396
<u>- - (C4)</u>	AS397
<u>- (C-e)</u>	AS398
<u>- - , (C-i)</u>	AS400
<u>- - (C-w)</u>	AS401
<u>- (S)</u>	AS402

2.

가. :

· : ()

· : (가 가)

· 가 · : 가 (가 가)

· :

- (가 가)

- ()

1) " " " " 가 ,

2) : " " .

3.

(1) _____ : _____ .
 (2) _____ : _____ .
 1) _____ (www.shbnppam.com)
 2) _____ () _____ 2 "11. _____ .

4.

5.

1.

()		
BNPP	SRI 2 []	AS391
-	(A1)	AS392
-	(A-e)	AS393

1.

()	
- - (C1)	AS394
- - (C2)	AS395
- - (C3)	AS396
- - (C4)	AS397
- (C-e)	AS398
- - , (C-i)	AS400
- - (C-w)	AS401
- (S)	AS402

2.

2014.06.02	
2014.08.14	(1) BNPP [] - : (), () - : (), ()
2015.02.26	(1) BNPP [] - : (), () - : (), ()
2016.05.27	1. 238 가 가 2. 240 1
2016.07.02	(5 ->6)
2016.07.30	(15 -> 15 30)
2016.08.29	- : (), () - : (), ()
2017.09.15	
2017.11.17	1. 가 - BNPP Tops SRI [] 2. (->)
2017.12.15	1. - : BNPP [] - : BNPPTops SRI 2 [] 2. 3. 4. (BNPP [])
2019.04.05	가
2019.06.14	(2 ->3)

2019.09.25	- (2019.08.01)
	- (2019.09.16)
2020.06.12	(3 2)
2020.06.19	(BNPPTops SRI [])
	- : ()
	- : ()
2020.09.25	1.
	- : BNPPTops SRI 2 []
	- : BNPP SRI 2 []
	2.
	3. 가

3.

(1) 5 " () , ()

4.

	()
	70 18, 19 (: 02-767-5777, : www.shbnppam.com)
1)	4 " "
	() 가

	BNPPTops SRI []
	가
	2002. " "
	2015.01.22 " 가 "
	2016.12.15 ()
	ESG(Environmental(), Social(), Governance()) 가

5. (2020.08.31.)
가.

* BNPPTops		SRI		[]					
					(-)				
					1	2	1	2	

	1973		5	3,435	25.38%	3.19%	23.15%	4.18%	17	1
	◎ - - COMMERZ (97-00.10) - (00.10-02.01) - (02.01-04.08) - (04.08-07.09) - 2 (07.09-13.06) - 가 (14.08-15.08) - BNP 2 (15.08-19.07) - BNP 1 (19.07-20.07) - BNP (20.07-)									

(1) , “ ”
 , “ ”
 가 .

(2) 3 ,
 (www.kofia.or.kr)

(3) 가 ,

(4) ‘ ,

(5)

(6) 가 가 .

가 (2020.08.31.):

(1)

* BNPPTops SRI []

	2017.02 ~ 2020.06
	2020.06 ~

1) 3 .

6. 가. : , (), (가), 가 , ,
) “ 9. , ”

BNPPTops	SRI	[]
----------	-----	-----

BNPP	SRI	2 []
------	-----	-------

BNPP	SRI	2 [](A1)
	(-)	
BNPP	SRI	2 [](A-e)
	(-)	
BNPP	SRI	2 [](C1)
	(- -)	

BNPP	SR I	2 [](C2)
(- -)		
BNPP	SR I	2 [](C3)
(- -)		
BNPP	SR I	2 [](C4)
(- -)		
BNPP	SR I	2 [](C-e)
(-)		
BNPP	SR I	2 [](C-i)
(- - ,)		
BNPP	SR I	2 [](C-w)
(- -)		
BNPP	SR I	2 [](S)
(-)		

가 가

13.

(1) 가

		가
- (A1)	2014.06.05	
- (A-e)	2014.06.12	(On-line)
- (C1)	2014.06.05	
- (C2)	2015.06.05	C1 1 C2
- (C3)	2016.06.07	C1 2 C3
- (C4)	2017.06.05	C1 3 C4
- (C-e)	2014.06.12	(On-line)
- (C-i)	2014.06.02	- 10 2 - 1-4 가 () - 100
- (C-w)	2014.06.02	- (Wrap) - 8 7 - 가 가
- (S)	2014.08.28	가 (가)가 가

(2)

3		
(Class)		
		가 (C1) 1 6 (C1) 1 6
		(A1) 1 6 (A1) 1 6 가 (A1)
(e)		가 ,
	()	가 ,
(s)	가 ,	가 가
	(C1)	(CDSC)
	가	
	Wrap Account	
	가	가

233

[]		
BNPPTops		60%
SR I []		가 94 2 4 가
	-	(“ SR I ”) 가

BNPPTops		가.
SRI	[40%
]		,

7.

	94	2	4
	,	,	,
			.

8.

가.	(4
	가	.
)		

	(%)	
()	
1.	100%	BNPPTops SRI []
	50%	
2.		345 1 30 (1)
3.		268 4
<div> <div>[1], [2]</div> <div>15</div> <div>가.</div> <div>.</div> <div>.</div> <div>.</div> <div>3</div> <div>.</div> <div>가</div> <div>가</div> <div>가</div> <div>1</div> <div>1</div> <div>1</div> <div>[1], [2]</div> <div>10%</div> </div>		

[BNPPTops SRI []

	(%)	
()	
1.	60%	4 4 , , 4 8 (9 15 3) .
2.	40%	4 3 , , , (, , (가 BBB- ,

2.		가 3 ,)
3.	40%	,
4.	40%	(4), , 가 A3- 3 , 3)
5.		가 100% .
6.	40%	110 가 (), 9 21
7.		5 1 2
8.		50%
9.		. 50%
10.	20%	20%
11.		- 가 가 345 1 30 - (1) - () .
12.		268 4
(가 10%) 가 [1], [2], [3], [4], [5], [6] . , . 15 가. 1 . 1 . 1 . 3 가 가 가 10% . 가 [1], [2], [3], [4], [5], [6]		

	10% 84	
	가. 83 4 ()	
	86 가	

[BNPPTops]	SRI []	
	10% 84	
	가. 83 4 ()	
	<div> <div>10% (</div> <div>279 1 ,</div> <div>80 3</div> <div>, 가</div> <div>(債權))</div> <div>()</div> <div>,</div> <div>1. , 69</div> <div>가 가</div> <div>100%</div> <div>2. , (가 1</div> <div>가),</div> <div>[79</div> <div>2 5 , , 가</div> <div>], 79 2 5 가</div> <div>, 가 79 2</div> <div>5 가 (</div> <div>.) ,</div> <div>가 가</div> <div>31 ,</div> <div>(「 」</div> </div>	

	<p>5 가</p> <p>3. () 가</p> <p>100 10 가</p> <p>1 1</p>	1
	10%	
	86 가	
	<p>- 가 100 100</p> <p>- (가 10%)</p> <p>- 가 10%</p>	1
	- 80 5	
	<p>- 100 20 ()</p> <p>100 30</p>	1
	<p>- 100 40</p> <p>- 100 5 ()</p> <p>- 100 20</p> <p>- 가</p> <p>{ ()</p> <p>80 11 }가</p> <p>가</p>	

	가 , , , 3 (가 가) 가. 가	
--	---	--

9. ,
가.
(1)
(“ SRI ”)
가 . 40%
(2)
(BNPTops SRI [])
[BNPTops SRI []]
1. BNPP (SRI) ESG
1) (SRI) : , , 가 ,
, 가 가 , 가
2) ESG(Environmental(), Social(), Governance()) ("ESG") :
, , ESG 가 가
2.
1) 가 : , ,
2) ESG : , ,
3) :
3.
1) 가 (Dual Screening)
- In-depth (, ,)
- SRI 가 (() 가 가) 가 가
2) 가 가 ESG 가 가 가
3)
* (BNPTops SRI [])

가

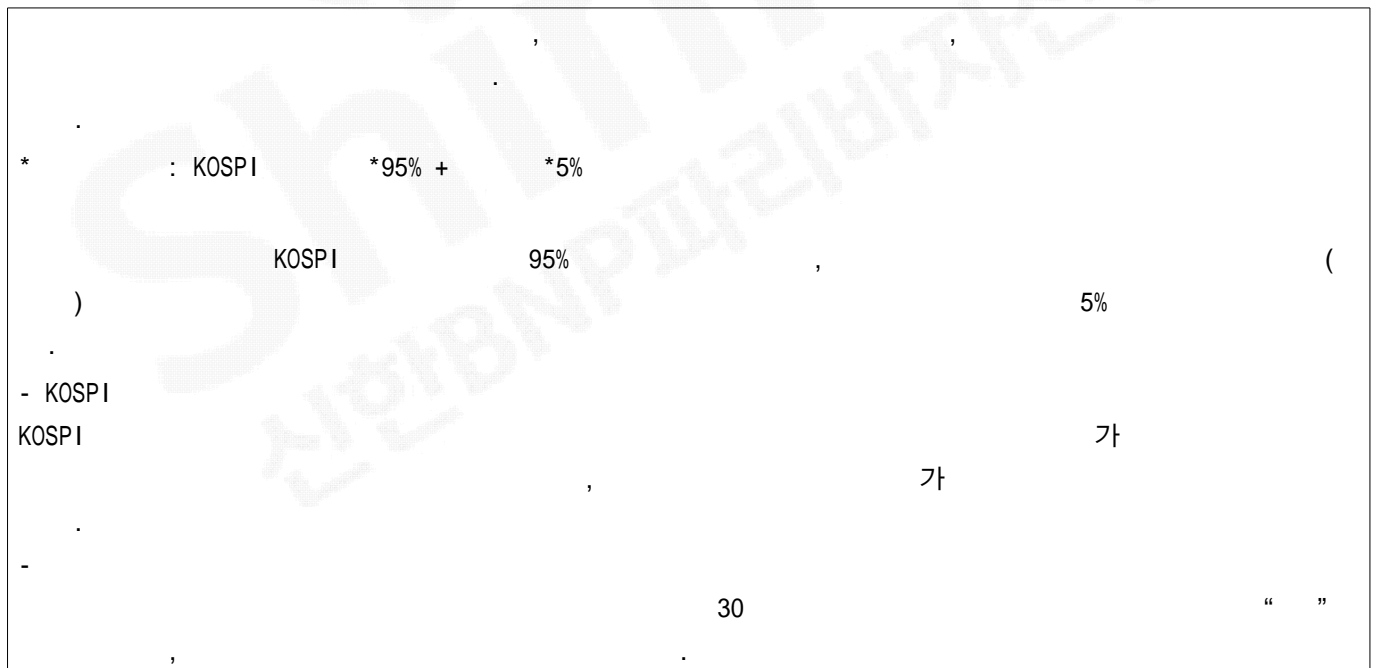
[]

BNPPTops SRI []	- (“ SRI ”) 가 가 40% ,

(3)

(Market Risk), (Credit Risk), (Liquidity Risk)
- Universe()
- (Tracking Error)
-
-

(4)



가

10.

가 ,
 , 가
 가
 ,
 .

가.

	가 , , 가 가 .
가	가 , 가 , 가 .
	가 * : , * :
	가 가 가 가 가 , 가
	가 가 가 , 가 ,
	가 가 .
	가 가 () .

	가 , 가 가 ,
	가 , , .

ETF(Exchange Traded Funds)	
ETF	가 NAV() /
	가 가
SRI 가	SRI SRI
	가
	가
	가 가
	가 가 가 가
가	가 가 가 가
	가
	1. 가
	가.
	2. 가
	가.
	가 가
	3. 가
	4. 가 가
	가
	1 1 50 50
	가

	가
	가
	가

(3 18.86% 2)

가
3 (156)

<	>	
1	2014.06-2016.06	
2	2016.07-2017.05	(5 ->6)
2	2017.06-2019.05	
3	2019.06-2020.05	
2	2020.06-	

	1()	2	3	4	5	6()
()	25%	25%	15%	10%	5%	0.5%

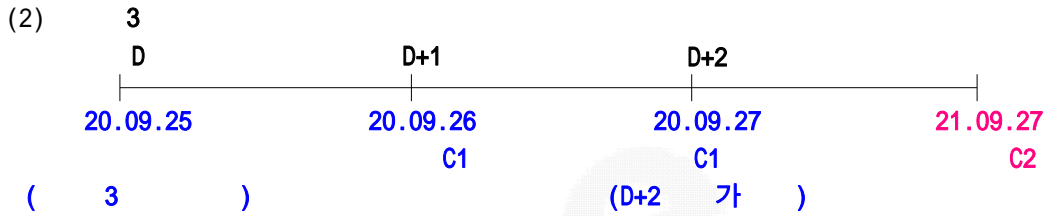
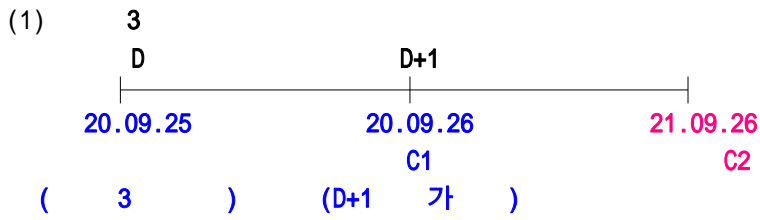
11. ,
가.
(1)

가

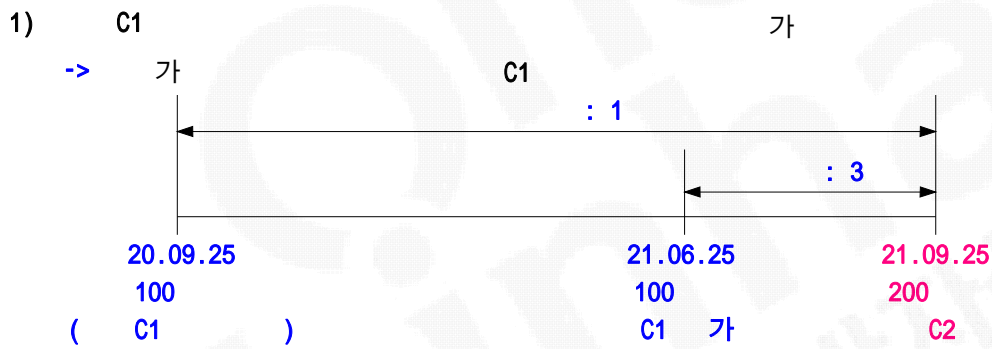
(2) 가
가 가 가

	가
- (A1)	
- (A-e)	(On-line)
- (C1)	
- (C2)	C1 1 C2

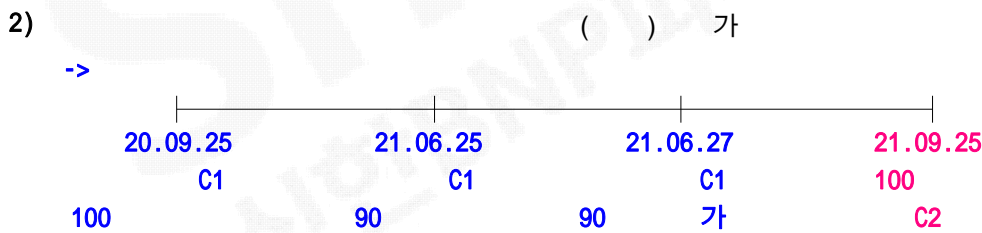
() 가 2020 9 25 C1
 , 가 1 1 , 가



가

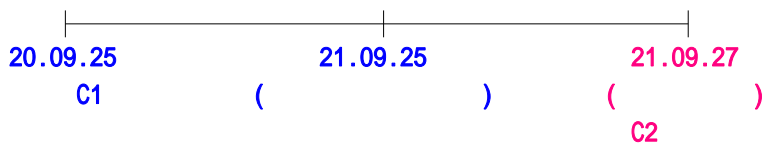


* 21.06.25 가 100 3 ,



10 , 가

< >
 1.

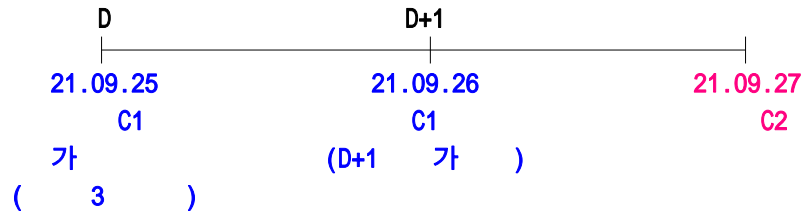


2.

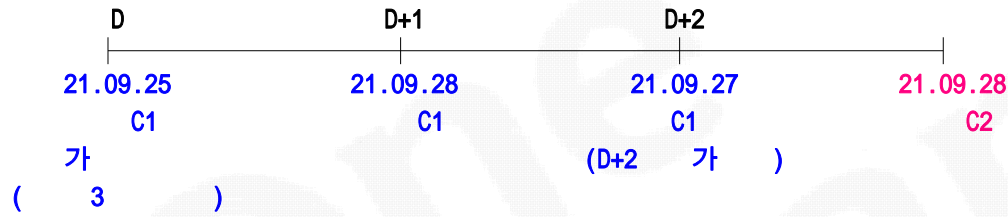
가

가

1) 3 가 , 가 09 25
09 26



2) 3 가 , 가 09 25
09 27



3.

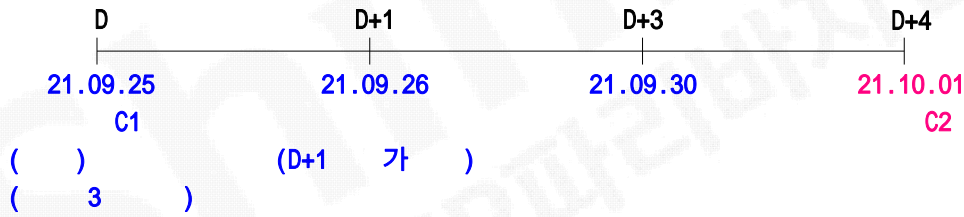
()

()

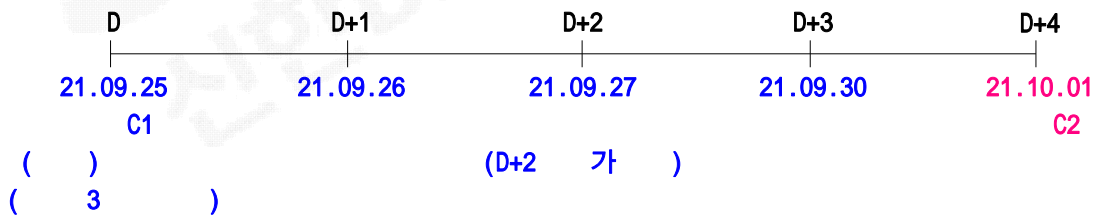
가

()

1) 3 () , () 가 09 25 09
30

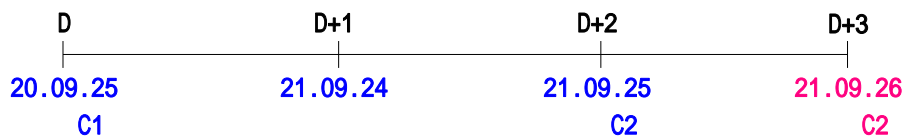


2) 3 () , () 가 09 25
10 01



4.

()



(2) 가 가 .
 * .
 (1) , 가

(2) 가
 A. 15 30 : 2 (D+1) 가
 4 (D+3)
 B. 15 30 : 3 (D+2) 가
 4 (D+3)



C. 가 가 , (" ") 가
 :
 가 가
 (3) 가
 (4) () 15 30
 가 , 15 30
 가 가

(5) 가
 (6)
 (15 30 2)
 가

(7)

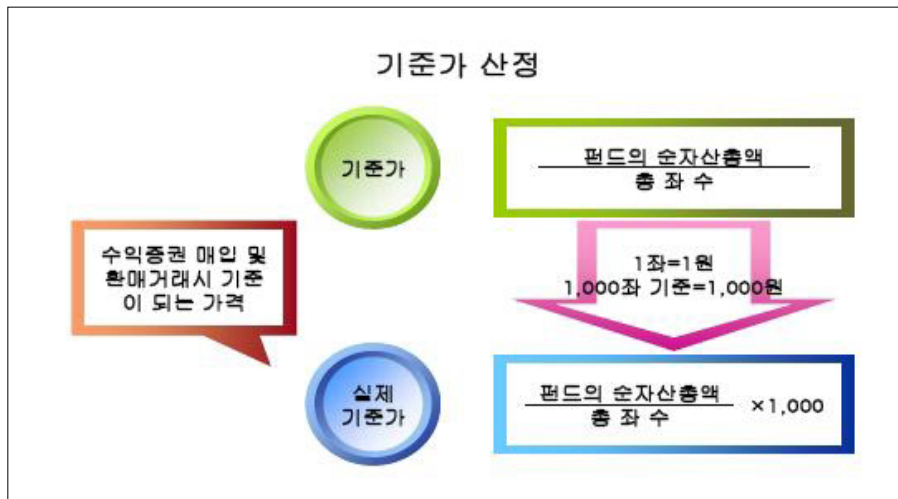
가, 237 258

가.

가 ()
259
가 .

12. 가
가. 가

	가 (" ") 1,000 4 5 .
가	(Class) 가 .
	가 .
	가 . , 가 가 가 .
	(www.shbnppam.com) . (www.kofia.or.kr)



가

(1) 가 : 가 가

가	
가	<p>() 가</p> <p>() 가 . ,</p> <p>가 가 3 10 가</p> <p>가 가 가 가</p> <p>2. 가 가 가 가</p>
가	<p>가 가가 가 (가 79 2</p> <p>가 가 가 .) 가 가</p> <p>가</p> <p>1. 가 가</p> <p>2. 가 가</p> <p>3. 가 가</p> <p>가. 가</p> <p>. 「 」</p> <p>. 가 가</p> <p>. 「 가 가 」 가</p> <p>. 가 가 . 가 .</p> <p>. 가</p> <p>4. 가</p> <p>5. 가</p>

(2) 가 : 가(가) 가 가 .

가	
1	가 가

- (C-i)	2014.06.02	- 1-4 10 2 가 (100
- (C-w)	2014.06.02	- 8 7 (Wrap) 가 가
- (S)	2014.08.28	-)가 (가

	()		
- (A1)	1.00%	-	
- (A-e)	0.50%	-	
- (C1)	-	-	
- (C2)	-	-	
- (C3)	-	-	
- (C4)	-	-	
- (C-e)	-	-	
- (C-i)	-	-	
- (C-w)	-	-	
- (S)	-	3 — 0.15%	

*

가 , 가

*
- , 가
-
1.
2.
3.
4.
5.
6. (,)
7. 가
8.
9.

< 1,000 가 > (:)

		1	2	3	5	10
- (A1)		223	350	482	761	1,556
	()	223	350	482	761	1,556
- (A-e)		148	250	356	580	1,225
	()	148	250	356	580	1,225
- (C1)		194	384	558	903	1,873
	()	194	384	558	903	1,873
- (C-e)		124	252	385	667	1,468
	()	124	252	385	667	1,468
- , (C-i)		76	154	237	411	917
	()	76	154	237	411	917
- (C-w)		73	150	230	400	892
	()	73	150	230	400	892
- (S)		109	221	339	587	1,297
	()	109	221	339	587	1,297

(1) 가 1,000 . C1 C2, C3, C4 , 가
, ,) .
5% , 가
가

(2) .

14.
가.
(1)
가
238 가 240 1
0
238 가 가 240 1
2016 4 1
:
가
(,
).

가

가

(,) 2

가

가

가

(2)

(" ")

가

(3)

가

5

(1)

(2)

(3)

-

15.4% (),

15.4% (

14%,

1.4%)

15.4% (14% , 1.4%)

(,) 2

가 , (,) 2

15.4% (14% ,

1.4%)

(

가

가

1.

6 (2019.06.02 - 2020.06.01)		
5 (2018.06.02 - 2019.06.01)		
4 (2017.06.02 - 2018.06.01)		

가. (: , %)

	6	5	4
	(2020.06.01)	(2019.06.01)	(2018.06.01)
	646,548,108	1,423,275,958	1,974,044,119
	645,969,547	1,420,733,694	1,963,873,078
	0	0	0
/	0	0	0
	578,561	2,542,264	10,171,041
	0	0	0
	2,137,765	4,720,710	6,256,178
	648,685,873	1,427,996,668	1,980,300,297
	0	0	0
	2,101,119	4,648,391	6,160,747
	2,101,119	4,648,391	6,160,747
	687,110,268	1,554,073,276	1,744,062,391
	15,625,658	1,570,300	-304,903,836
	-56,151,172	-132,295,299	534,980,995
	646,584,754	1,423,348,277	1,974,139,550

	6	5	4
	(2019.06.02-2020.06.01)	(2018.06.02-2019.06.01)	(2017.06.02-2018.06.01)
	68,492,114	-301,039,620	325,650,554
	17,742	108,078	1,446,588
	0	0	0
/ 가 ()	68,474,372	-301,147,698	324,203,966
	0	0	246
	13,111,596	20,320,870	34,953,683
	13,111,596	20,320,870	34,953,683
	0	0	0
	156,571	276,702	496,828
	55,223,947	-321,637,192	290,200,289

통 합 대 차 대 조 표

[단위:원]

과 목	제6기(2020.06.01)		제5기(2019.06.01)		제4기(2018.06.01)	
	금 액		금 액		금 액	
자 산						
운 용 자 산						
현금및예치금		578,561		2,542,264	10,171,041	10,171,041
1. 현금및현금성자산	578,561		2,542,264			
2. 예치금						
3. 증거금						
대출채권				1,070,001		
1. 콜론			1,070,001			
2. 환매조건부채권매수						
3. 매입어음						
4. 대출금						
유가증권		645,969,547		1,419,663,693		1,963,873,078
1. 지분증권						
2. 채무증권						
3. 수익증권	645,969,547		1,419,663,693		1,963,873,078	
4. 기타유가증권						
파생상품						
1. 파생상품						
부동산과 실물자산						
1. 건물						
2. 토지						
3. 농산물						
4. 축산물						
기타운용자산						
1. 임차권						
2. 전세권						
기 타 자 산		2,137,765		4,720,710		6,256,178
1. 매도유가증권미수금						
2. 정산미수금						
3. 미수이자	3		2,960		320	
4. 미수배당금						
5. 기타미수입금	2,137,762		4,717,750		6,255,858	
6. 기타자산						
7. 수익증권청약금						
자 산 총 계		648,685,873		1,427,996,668		1,980,300,297
부 채						
운 용 부 채						
1. 옵션매도						
2. 환매조건부채권매도						
기 타 부 채		2,101,119		4,648,391		6,160,747
1. 매수유가증권미지급금						
2. 정산미지급금						
3. 해지미지급금						
4. 수수료미지급금	2,101,119		4,648,391		6,160,747	
5. 기타미지급금						
6. 기타부채						
부 채 총 계		2,101,119		4,648,391		6,160,747
자 본						
1. 원 본	687,110,268		1,554,073,276		1,744,062,391	
2. 집합투자기구안정조정금						
3. 이월잉여금	-40,525,514		-130,724,999		230,077,159	
(발행좌수 당기: 687,110,268 좌		-56,151,172		-132,295,299		534,980,995
전기: 1,554,073,276 좌		15,625,658		1,570,300		-304,903,836
전전기: 1,744,062,391 좌)						
(기준가격 당기: 1,000.00 원						
전기: 955.53 원						
전전기: 1,141.68 원)						
자 본 총 계		646,584,754		1,423,348,277		1,974,139,550
부 채 와 자 본 총 계		648,685,873		1,427,996,668		1,980,300,297

통 합 손 익 계 산 서

[단위:원]

과 목	제6기(2019.06.02-2020.06.01)		제5기(2018.06.02-2019.06.01)		제4기(2017.06.02-2018.06.01)	
	금 액		금 액		금 액	
운 용 수 익						
1. 투자수익		17,742		108,078		1,446,834
1. 이 자 수 익	17,742		108,078		1,446,588	
2. 배당금수익						
3. 수수료수익					246	
4. 임대료수익						
2. 매매차익과 평가차익		192,076,521		38,349,317		557,799,871
1. 지분증권매매차익						
2. 채무증권매매/평가차익						
3. 파생상품매매/평가차익						
4. 지분증권평가차익	155,275,364					
5. 외환거래/평가차익						
6. 현금및대출채권매매/평가차익			4		986	
7. 기타거래차익	36,801,157		38,349,313		557,798,885	
3. 매매차손과 평가차손		123,602,149		339,497,015		233,595,905
1. 지분증권매매차손						
2. 채무증권매매/평가차손						
3. 파생상품매매/평가차손						
4. 지분증권평가차손			307,646,026		232,996,478	
5. 외환거래/평가차손						
6. 대손상각비						
7. 현금및대출채권매매차손	74		679		17,958	
8. 기타거래손실	123,602,075		31,850,310		581,469	
운 용 비 용		13,268,167		20,597,572		35,450,511
1. 운용수수료	6,285,199		10,953,298		19,581,821	
2. 판매수수료	6,592,721		8,959,922		14,642,217	
3. 수탁수수료	233,676		407,650		729,645	
4. 투자자문수수료						
5. 임대자산관련비용						
6. 기타비용	156,571		276,702		496,828	
당기순이익(또는 당기순손실)		55,223,947		-321,637,192		290,200,289
좌당순이익(또는 좌당순손실)		0.080371302		-0.206963981		0.166393296

2. [: ,]

				()					
		()		()		()		()	
- (A1)	2017.06.02 - 2018.06.01	21	21	1	1	13	15	8	9
	2018.06.02 - 2019.06.01	8	8	1	1	2	2	7	7
	2019.06.02 - 2020.06.01	7	7	0	0	3	3	4	4
- (A-e)	2017.06.02 - 2018.06.01	0	0	0	0	0	0	0	0
	2018.06.02 - 2019.06.01	0	0	0	0	0	0	0	0
	2019.06.02 - 2020.06.01	0	0	0	0	0	0	0	0
- - (C4)	2017.06.02 - 2018.06.01	0	0	7	7	3	3	4	4
	2018.06.02 - 2019.06.01	4	4	0	0	1	1	3	3
	2019.06.02 - 2020.06.01	3	3	0	0	1	1	2	2
- (C-e)	2017.06.02 - 2018.06.01	1	1	0	1	0	0	1	1
	2018.06.02 - 2019.06.01	1	1	0	0	0	0	1	1
	2019.06.02 - 2020.06.01	1	1	0	0	1	1	1	1
- (S)	2017.06.02 - 2018.06.01	0	0	0	0	0	0	0	0
	2018.06.02 - 2019.06.01	0	0	0	0	0	0	0	0
	2019.06.02 - 2020.06.01	0	0	0	0	0	0	0	0

(1)

3.

가. () [2020.08.31 / : %]

		1	2	3	5	
		2019.08.31 ~ 2020.08.31	2018.08.31 ~ 2020.08.31	2017.08.31 ~ 2020.08.31	2015.08.31 ~ 2020.08.31	
- (A1)	2014.06.05	24.99	3.68	2.65	3.20	2.26
- (A-e)	2014.06.12	25.43	4.06	3.02	3.58	2.64

- (C4)	2017.06.05	24.87	3.58	2.55	-	2.12
- (C-e)	2014.06.12	25.24	3.89	2.86	3.41	2.48
- (S)	2014.08.28	25.54	4.14	3.10	3.66	2.15
(%)	2014.06.02	17.49	0.25	-0.34	3.63	2.49
(%)	2014.06.02	28.89	22.73	19.88	17.73	17.77

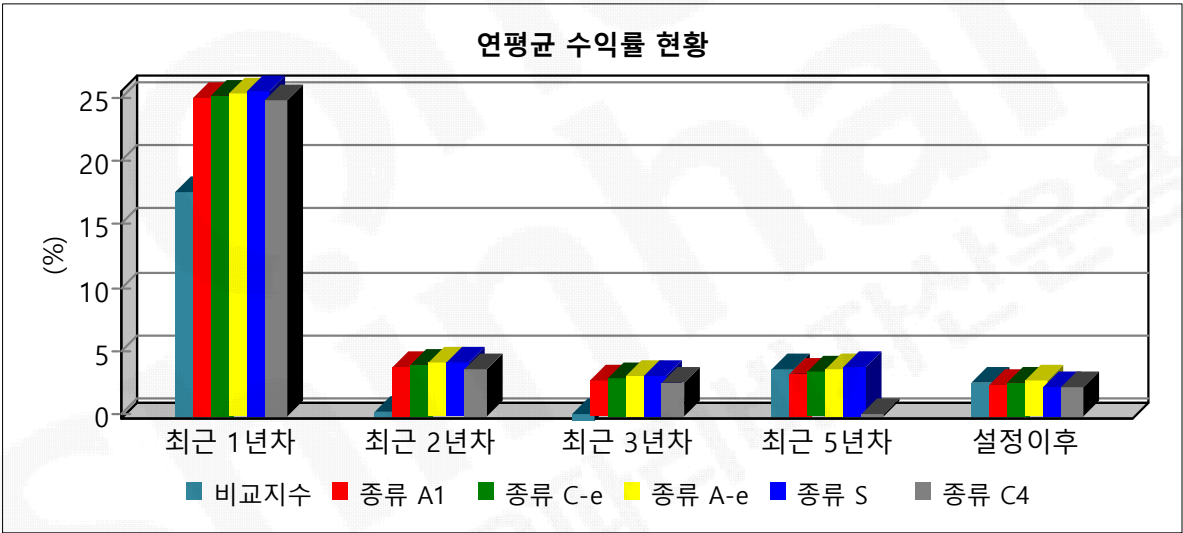
(1) : KOSPI *95% + *5%

(2)

(3)

(4) (%)

(5)



		[2020.08.31 / :%]				
		1	2	3	4	5
		2019.08.31 ~ 2020.08.31	2018.08.31 ~ 2020.08.31	2017.08.31 ~ 2020.08.31	2016.08.31 ~ 2020.08.31	2015.08.31 ~ 2020.08.31
- (A1)	2014.06.05	24.99	7.51	8.17	27.30	17.10
- (A-e)	2014.06.12	25.43	8.29	9.35	29.15	19.23
- (C4)	2017.06.05	24.87	7.30	7.84	-	-
- (C-e)	2014.06.12	25.24	7.95	8.83	28.34	18.29
- (S)	2014.08.28	25.54	8.46	9.61	29.55	19.70
(%)	2014.06.02	17.49	0.49	-1.03	14.19	19.52

(1) : KOSPI *95% + *5%

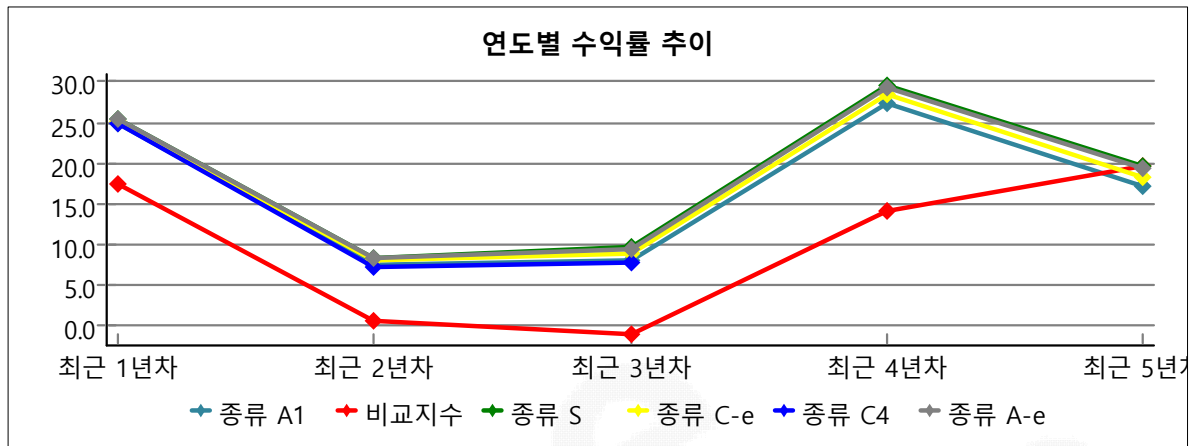
(2)

(3)

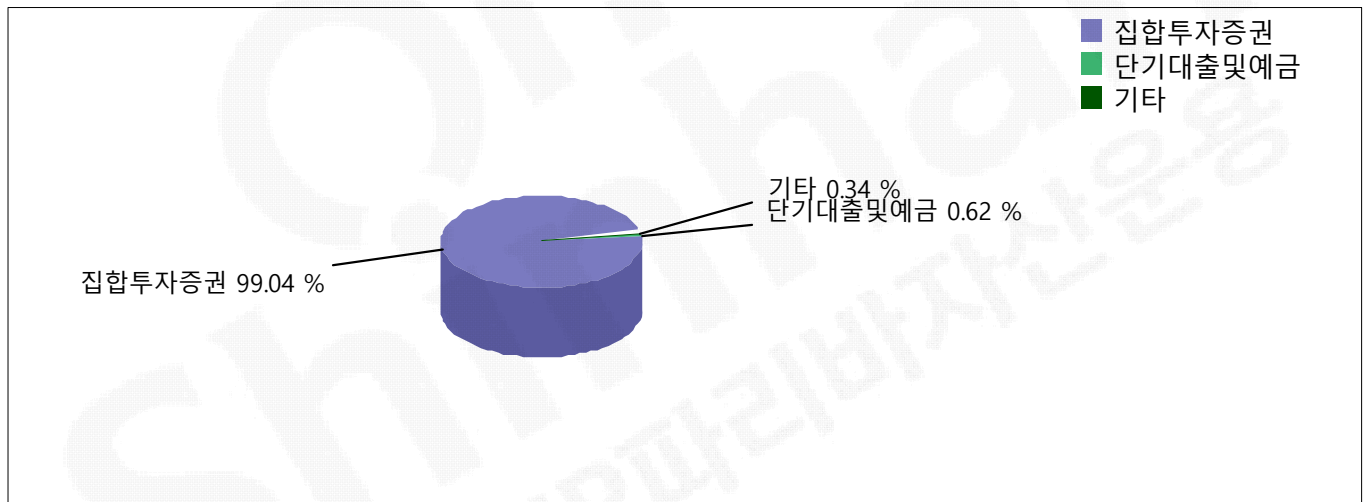
(4) 1 ,

(5)

6	.
6	:
1	:



1) ()



[2020.08.31 / : , %]

KRW	0	0	0	6	0	0	0	0	0	0	0	6
	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(99.04)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.62)	(0.34)	(100.00)
	0	0	0	6	0	0	0	0	0	0	0	6
	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(99.04)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.62)	(0.34)	(100.00)

(1) ()

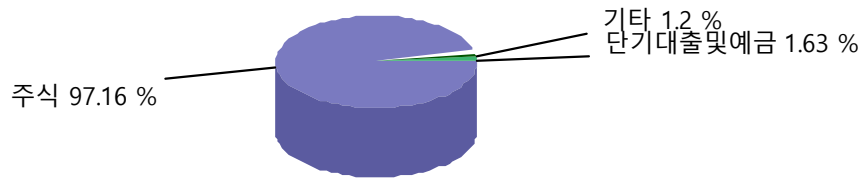
(2) : (CD)

(3) , 가 /

(4) , 가 ()

2) [BNPPTops SRI []]

주식
단기대출및예금
기타



[2020.08.31 / : ,%]

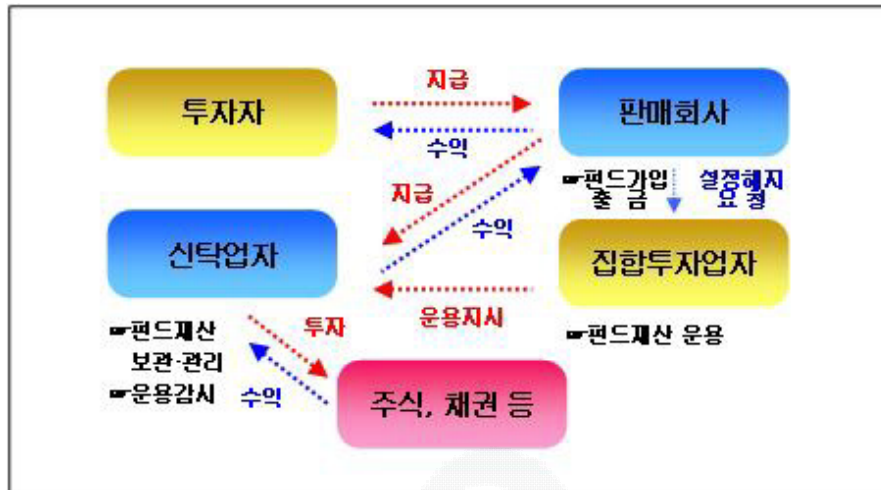
KRW	476	0	0	0	0	0	0	0	0	8	6	490
	(97.16)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(1.63)	(1.20)	(100.00)
	476	0	0	0	0	0	0	0	0	8	6	490
	(97.16)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(1.63)	(1.20)	(100.00)

(1) ()

(2) : (CD)

(3) , 가 /

(4) , 가 ()



1.

가.

	()
	70 18, 19 (: 02-767-5777, : www.shbnppam.com)
	2009.01 () () SH ()) 2008.09 , MOU
	754
	(65%), (35%)

.

[]

,

/

,

/

[]

,

[]

가

,

(

)

가

가

[]

,

,

,

가

가

.

2 (:)

[]

	24 2019 12	23 2018 12
가	133,815	132,035
가	23,441	17,740
가	3,699	3,728
	20,848	18,914
	2,400	1,547
	184,203	173,964
	19,678	14,841
	19,678	14,841
	75,374	75,374
	29,177	29,177
	76	229
	-578	-143
()	60,477	54,487
	164,525	159,124
	184,203	173,964

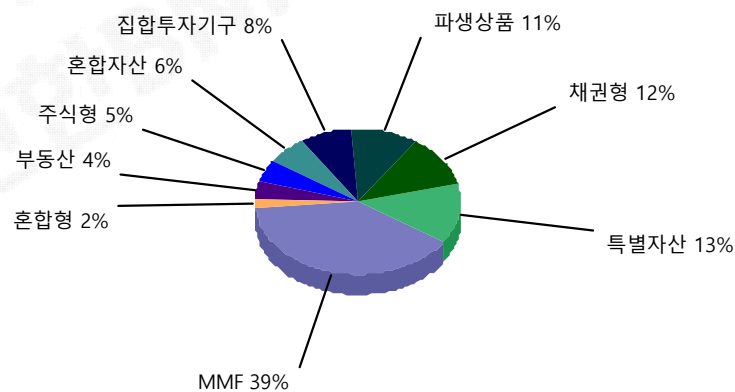
[]

	24 (19.01.01- 19.12.31)	23 (18.01.01- 18.12.31)
	84,256	78,378
	53,069	53,798
()	31,187	24,580
	574	568
	478	553
	31,283	24,594
	8,193	5,726
()	23,090	18,868
()		
()	23,090	18,868

(2020.08.31 / :)()

									MMF	
	16,887	6,186	40,392	27,522	37,661	15,103	45,504	22,312	137,161	348,727

유형별 운용자산규모



2. 가. ()

3.

가.

1)

	35(1가) (: 02-1588-1111)
	www.hanabank.co.kr

2)

(1)

(2)

()

, ,
가 , ,

가 , / 가가 / 가
/ / 가
가

()

가 , 가
() 가

()

, , ,
가

.

1)

	70 (: 2180-0400)
	www.shinhanaitas.com

2)

(1)

가

(2)

가

가

()

, , , 가

가

1)

가	88	02-399-3350	www.koreaap.com
	70 19	02-398-3900	www.nicepni.co.kr
KIS 가	6 38	02-3215-1400	www.bond.co.kr
가()	5 29	02-721-5300	www.fnpricing.com

2)

가 가

가

가

, ,

가()

(CD, CP)

가

)

(

()

, , , 가

가

1.

가.

(1)

-

-

-

가

가

(2)

-

100

5

가

가

1

가

100

5

-

-

-

-

-

-

-

1.

221

6

가

2.

3.

가

10

1

4.

221

7

-

-

6

,

-

-

-

가

2

(

“

”

)

8

1

10

1

가
가
(2),

가
가
가

가
가
(www.kofia.or.kr)

2.

/ 가 1 224 2 6 6 /
/ 가 1 224 2 6 6 /
/ 1 1 (50) 50 50 /
48
가

3.

가.

(1)

[

]

2

1)

2)

3)

4)

.

[

]

가

가

2

1)

2)

3)

(2)

-

3

1

2

가

100

가

가

-

0

3

가

0

0

0

0

가

92

3

3

3

2

, 6

7

, 9

-

가

1)

가

2)

1

3)

3

1

4)

가

가

10

(3)

가

2

가

가

1)

2)

3)

4)

247

5

5)

270

2

가

1)

가

2)

1

3)

3

1

4) 가 가 10

(4) 가

(1)

1. ,
2. (216)
3. (
)
4.
5.
6. (217 3)
7.
8.

2 6 42 1 2 3
37

1. 가
2. 가
3. 가
1 180
가 (,)
가 5
1 가
(,) 가
5 2 3 가
, 35 4 가 ()
)

(2)

(www.kofia.or.kr)

(www.shbnppam.com) .

1. ()
2. ,
3. 93 2
4.
5. ,
, 123 3 2

6. , , 가 가

7. 가 가

8. (262 1 ,) 가

가 (가 1 50

가 192 1 1

가 가 1 1

50 가 192 1

10. (.

1) 242 2

2) 가 . ,

3) .

4) 가

11. 가

(3)

- , , , , :

- (“ ”) 100 5 100 :

- :

- 4 30 4

1 1

- (

4. 가. (2019.09.01 - 2020.08.31) :

. (2019.09.01 - 2020.08.31) :

.

	(가) (Broker Committee)
	-
	-
	-
	- 가
	- /
	-

	- - IT/ -
--	-----------------

5.

6. 가

One
Shinhan
신한BNP파리바자산운용

[()]

1. ()

2. ()

가. ()

[가]

1.

2.

[]

	가
	2
	가
	()
	50%
	가 가
	가 가
가	가 가
	() 가
	() ()
가	가
	가 가 ,
	가 가 () 가 가
	가 가 , 가 가
	가
	가 ,
	가 가
	가

	가
	가
	,
	()가 , 가 () 가 가 (10)
	가 가 가 가 가 가 ()
	가
	가
	5
	Active
	가
	가 가 가
	가
	가
/	:
	: