

투자 위험 등급
6등급(매우 낮은 위험)

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

()

6

1.

5 []

2.

()

3.

[

(www.shinhanfund.com)

4.

2021 06 14

5.

2021 06 18

6.

()

(10)

(

)

7.

()

(

2017 6 1

)

8.

[

]

:

()

dart.fss.or.kr

[

]

:

()

dart.fss.or.kr

:

(www.shinhanfund.com) ,

(www.kofia.or.kr)

9. (

)

가

가
가
「

」

1.

.

2.

,

.

3.

,

가

,

.

4.

,

.

5.

,

,

,

가

)

(

가

가

.

6.

가

,

가

.

7.

가

.

8.

가

가

.

9.

가

.

10.

가

가

가(

,

가

)

가

.

11.

가

1

50

(

)

가

,

.

,

,

.

[]

-

1

1.

2.

3.

4.

5.

6.

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

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

가 5 []

[]

1. 94 2 4

2. (1) 1) 2) 가

* : KBP (1-1.5) *95% + CALL *5%

(2)

|] | | [| | , , . | | | | | 100% | |
|----------------------------|--------------|--------|--------|--------|--------|------------------|----|-----|------|-----|
| , (), (가), 가 (가 가), , | | | | | | | | | | |
| | 가 () (%) | | | | | 1,000 가 (:) | | | | |
| | | | | | | 1 | 2 | 3 | 5 | 10 |
| (C1) | | 0.3600 | 0.2500 | 0.3800 | 0.3720 | 38 | 78 | 120 | 209 | 470 |
| (C-e) | | 0.2350 | 0.1250 | 0.2600 | 0.2474 | 25 | 52 | 80 | 139 | 315 |

(1) '1,000 가 , 가 1,000
 (+ ())
 , 5% 가 .
 (2)
 (3) 2 13.
 (4) '
 (5) (

| | | 1 | 2 | 3 | 5 | |
|-------|------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|------|
| | | 2020.05.31 ~ 2021.05.31 | 2019.05.31 ~ 2021.05.31 | 2018.05.31 ~ 2021.05.31 | 2016.05.31 ~ 2021.05.31 | |
| (C1) | 2017.06.01 | 0.45 | 1.23 | 1.52 | - | 1.61 |
| (C-e) | 2017.06.13 | 0.58 | 1.36 | 1.63 | - | 1.80 |
| (%) | 2017.06.01 | 0.79 | 1.55 | 1.80 | - | 1.88 |
| (%) | 2017.06.01 | 0.25 | 0.37 | 0.33 | 1.08 | 1.08 |

(1) :
 - 2017.12.21 : , 2017.12.22 : KBP (1-1.5) *95% + CALL *5%
 (2)
 (3) ()
 (4)
 (5)
 (6)

| * [| | | | | | | | | |
|-----|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
|-----|--|--|--|--|--|--|--|--|--|

(1) , 2 , ' , " ,
 가 , 2
 가
 (2) 3 ,
 (www.kofia.or.kr)
 (3) 가
 ,
 (4) '
 (5)

- [] 가
 - 가 가
 - ,
 - 가 ,
 - ,

| | | | | | |
|-----|--|--|------------|--|--|
| | | | | | |
| | 가 | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | | | | | |
| | 가. 17 : 2 (D+1) 가 | | | | |
| | . 17 : 3 (D+2) 가 | | | | |
| | 가. 17 : 3 (D+2) 가 3 (D+2) | | | | |
| | . 17 : 4 (D+3) 가 4 (D+3) | | | | |
| | | | | | |
| 가 | | 가 | | | |
| | | 1,000 4 5 | | | |
| | | (www.shinhanfund.com), , (www.kofia.or.kr) | | | |
| | (15.4%) , (,) | | | | |
| |) 2 가 , (,) | | | | |
| |) 2 | | | | |
| | 가 , , | | | | |
| | 가 | | | | |
| | () (: 02-767-5777 / : www.shinhanfund.com) | | | | |
| () | 2017 6 1 | () | (() : 10 | | |

| | | | | | |
|--|------------------------|-----|---------|-------------------|--|
| | 2021 | 06 | 18 | | |
| | (www.shinhanfund.com), | | | (dis.kofia.or.kr) | |
| | | | | 4 1. | |
| | | | | | |
| | 3 | | | - | |
| | (Class) | | | | |
| | | | 가 | | |
| | | (e) | 가 . , | | |
| | | | () | | |
| | | | 가 가 . , | | |
| | | (s) | 가 가 | | |
| | 가 , | | | | |

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

1.

| () | |
|----------|-------|
| 5 [] | BQ620 |
| - (C1) | BQ614 |
| - (C-e) | BQ615 |
| - (S) | BQ616 |

2.

가.

:

.

:

()

.

:

(가 가)

.

가 .

:

가 (가 가)

.

:

-

(

가

가

)

-

(

)

.

:

X ()

1)

"

"

"

"

가

2

2)

:

"

"

3.

10

가

,

1

(1

=1

,

)

가

1)

(

)

.

2)

(

)

4.

(1)

:

2017

6

1

(2)

:

1)

(www.shinhanfund.com)

2)

(

)

2

"11.

5.

6.

1.

| () | |
|----------|-------|
| 5 [] | BQ620 |
| - (C1) | BQ614 |
| - (C-e) | BQ615 |
| - (S) | BQ616 |

2.

| | |
|------------|---|
| | |
| 2017.06.01 | () |
| 2017.07.31 | - : (), () - : (), () |
| 2017.11.30 | 1. 가(BNPP []) 2. - : (), () - : (), () |
| 2017.12.22 | BNPP 5 [] |
| 2018.07.27 | * BNPP [] - : (), () - : (), () |
| 2019.09.25 | - (2019.08.01) - (2019.09.16) |
| 2020.06.05 | * BNPP [] - : (), () - : (), () |
| 2020.06.12 | () (6 5) |
| 2020.07.17 | * BNPP [] - : (), () - : (), () |
| 2021.02.05 | : () : |
| 2021.06.18 | (5 6) |

3.

(1) 5 " () , ()

4.

| | |
|--|--|
| | () |
| | 70 18, 19 (: 02-767-5777, : www.shinhanfund.com) |

1) 4 " "

5. (2021.05.31.)

가.

*

[]

| | | | | | (-) | | | | |
|--|------|--|----|--------|-------------------|-------|--------|-------|---------|
| | | | | | | | | | |
| | | | | | 1 | 2 | 1 | 2 | |
| | 1973 | | 20 | 45,046 | -0.22% | 1.21% | -0.11% | 1.12% | 15 2 |
| <div>◎</div> <div>KDB</div> <div>BNP</div> <div>BNP</div> <div>-</div> <div>(01.09-06.04)</div> <div>(06.04-08.05)</div> <div>(08.05-12.07)</div> <div>(12.07-14.01)</div> <div>1 (14.01-18.07)</div> <div>(18.07-21.01)</div> <div>(21.01-)</div> | | | | | | | | | |
| | 1983 | | 19 | 21,185 | -0.17% | 1.23% | -0.11% | 1.12% | 4 5 |
| <div>◎</div> <div>-</div> <div>-</div> <div>-</div> <div>-</div> <div>- BNK</div> <div>- BNP</div> <div>-</div> <div>(10.09-12.06)</div> <div>(12.06-14.04)</div> <div>가 가 (14.04-15.16)</div> <div>(15.06-19.05)</div> <div>(19.05-20.06)</div> <div>2 (20.07-21.01)</div> <div>2 (21.01-)</div> | | | | | | | | | |

(1)

(2)

(3)

(4) ‘

(5)

(1)

*

[]

| | 2017.04 ~ 2018.07 |
|--|-------------------|
| | 2018.07 ~ |
| | |
| | 2017.02 ~ 2020.06 |
| | 2020.07 ~ |

1)

3

6.

가. : , (), (가), 가 (가 가), ,
) “ 9. , ” .

[]

5 []

| |
|-------------|
| 5 [](C1) |
| (-) |
| 5 [](C-e) |
| (-) |
| 5 [](S) |
| (-) |

가 가

13.

(1) 가

| | | 가 |
|---------|------------|---------------|
| - (C1) | 2017.06.01 | |
| - (C-e) | 2017.06.13 | (On-line) |
| - (S) | 2017.06.05 |)가 가 (가 가 |

(2)

| (Class) | | |
|---------|-----|----------------|
| | | 가 |
| | (e) | 가 . , . |
| | | () 가 . , 가 |
| | (s) | 가 가 가 . , |

| [] | | [] | |
|-----|--|-----|-----|
| [] | | 60% | 40% |
| | | 94 | 2 4 |
| | | - | , |

7.

94 2 4

,

8.

가.

(4

가

)

| | (%) | |
|--|------|-------------------------------------|
| | () | |
| 1. | 100% | [] |
| | 50% | |
| 2. | 10% | 345 1 30 (1) , 가 40% 10% |
| 3. | | 268 4 |
| <div> <div>[1], [2]</div> <div>15</div> <div>가.</div> <div>.</div> <div>.</div> <div>3</div> <div>.</div> <div>가</div> <div>가</div> <div>가</div> <div>[1], [2]</div> <div>10%</div> </div> | | |

[]

[]

| | (%) () | |
|-----|----------------|----------------------------------|
| 1. | 60% | 4 3 , , () , (가 A- , , , , 3) |
| 2. | 60% | 4 3 (“ ”) 가 . . 가 가 . . . |
| 3. | 40% | , |
| 4. | 40% | (4) , (가 가 A2- 3 . , 3) |
| 5. | | 가 100% . |
| 6. | 20% | 110 가 (.) , 9 21 (.) |
| 7. | | 5 1 2 |
| 8. | | 50% |
| 9. | | . 50% |
| 10. | 20% | 20% |
| 11. | | . |

| | | |
|--|--|--|
| 11. | | - 가 가 - 345 1 30 - (1) - () |
| 12. | | 268 4 |
| 13. | | , 가 , 가 가 , |
| (가 10%) 가 [1], [2], [3], [4], [5], [6] 15 가. 1 1 1 3 가 가 10% 가 [1], [2], [3], [4], [5], [6] | | |

| | | |
|--|--------------------------|--|
| | | |
| | 10% 84 가. 83 4 () | |
| | 86 가 | |

[]

[]

| | | |
|--|-------------------|--|
| | | |
| | 10% 84 가. 83 4 | |

| | | |
|--|--|---|
| | . | |
| | <p>10% (</p> <p>279 1 ,</p> <p>80 3</p> <p>, , 가</p> <p>(債權))</p> <p>(</p> <p>)</p> <p>.</p> <p>1. , 69</p> <p>가 가</p> <p>100%</p> <p>2. , (가</p> <p>가),</p> <p>[79</p> <p>2 5 , , 가 1</p> <p>], 79 2 5 가</p> <p>, 가 2</p> <p>5 가 79 (</p> <p>가 .)</p> <p>가 ,</p> <p>31 , ,</p> <p>(「 」</p> <p>,「 」</p> <p>79 2 5 가</p> <p>), 79 2</p> <p>5 가 .</p> <p>30%</p> | |
| | <p>86</p> <p>가</p> | |
| | <p>- 가 100 100 .</p> <p>- 가 10% 1</p> <p>(가)</p> <p>- 가 10%</p> | |
| | - 80 5 | |
| | <p>- 100 20 (</p> <p>. 가 ,</p> <p>가)</p> <p>100 30 .</p> | 1 |

(3)

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

(4)

· , ,
·
·
* : KBP (1-1.5) *95% + CALL *5%
·
- 2017.12.21 :
2017.12.22 : KBP (1-1.5) *95% + CALL *5%
BP
(1-1.5) 95% ,
5%
* BP
BP 가 ,
BP Index Matrix BP (1-1.5) ,
1 1.5 1 1.5
[] BP Index Matrix ? 가 ,
가 , 가 (www.koreaap.com)
30 “ ”

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 NAV() , / 가 가 . |
| ETF | ETF(Exchange Traded Funds) 가 , NAV() , / 가 가 . |

| | |
|----|---------|
| | |
| | 가 가 |
| | 가 가 가 |
| 가 | 가 가 가 |
| | 가 |
| 1. | 가 |
| 가. | |
| 2. | 가 가 |
| 가. | 가 가가 |
| 3. | 가 가 |
| 4. | 가 가 |
| | 가 50 50 |
| | 가 |
| | 가 |
| | 가 가 |
| | 가 |

(3 0.33% 6)

가

< >

| | | |
|---|-----------------|--|
| | | |
| 5 | 2017.06-2021.05 | |
| 6 | 2021.05- | |

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

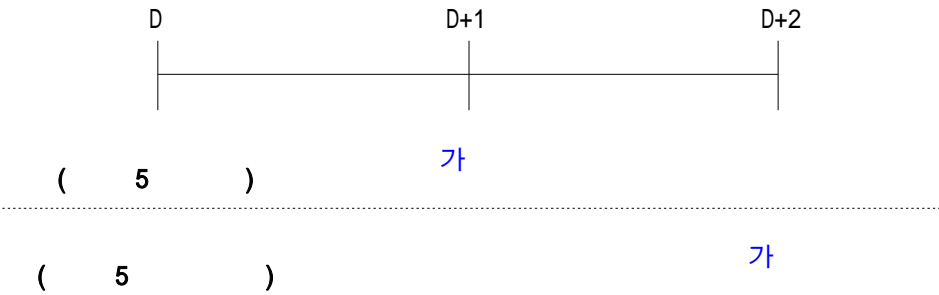
11. ,
가.
(1)

가
(2) 가
가 가
가

| | |
|---------|-----------------|
| | 가 |
| - (C1) | |
| - (C-e) | (On-line) |
| - (S) | 가 () 가 가 |

(3) 가

- A. 17 : 2 (D+1) 가
B. 17 : 3 (D+2) 가



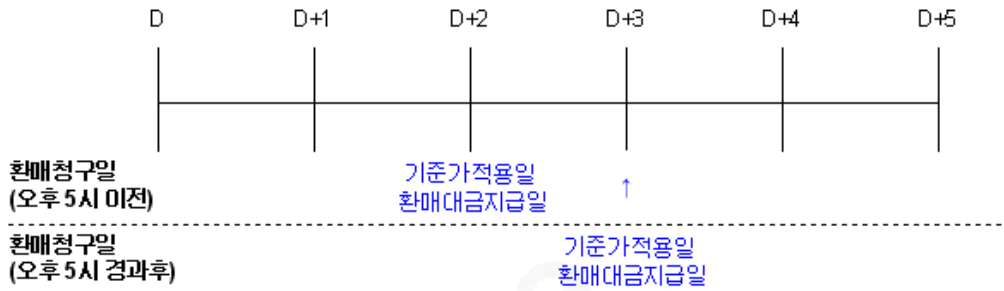
가

C. 가 1,000 .
 : 가 가

(1)

(2) 가

A. 17 : 3 (D+2) 가
 B. 17 : 4 (D+3) 가
 4 (D+3)



C. 가 가 , (")
 , 가

(3)

(4) 가 ()

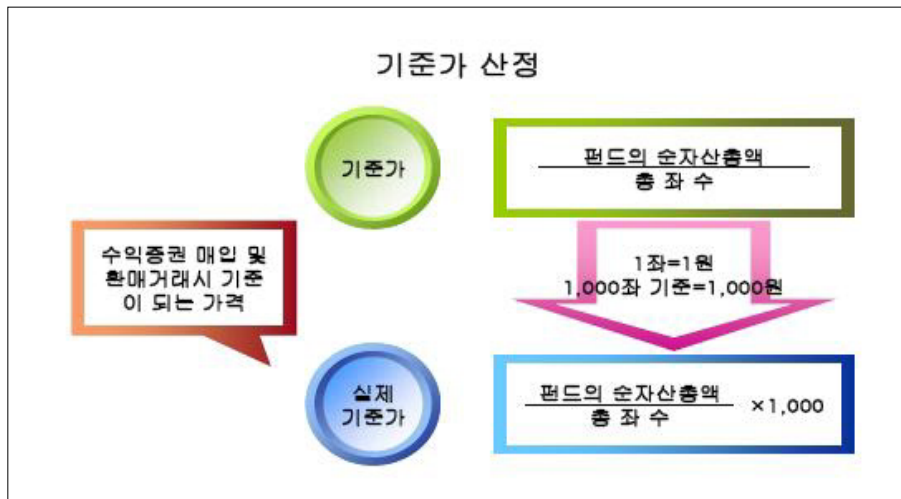
가 , 17 가
 가 .

(5)

(6)

(17 2) 1

가



가 : 가 가

(1)

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

(2) 가 : 가(가) 가 가 .

| 가 | |
|---|----------|
| 1 | 가 가(가) |

< 1,000 가 > (:)

| | | 1 | 2 | 3 | 5 | 10 |
|------------|-----|----|----|-----|-----|-----|
| - (C1) | | 38 | 78 | 120 | 209 | 470 |
| | () | 38 | 78 | 120 | 209 | 470 |
| - (C-e) | | 25 | 52 | 80 | 139 | 315 |
| | () | 25 | 52 | 80 | 139 | 315 |
| - (S) | | 17 | 35 | 54 | 95 | 216 |
| | () | 17 | 35 | 54 | 95 | 216 |

(1) 가 1,000 .
 가 , , 가 , 5% ,
 (2)

14.
 가.
 (1)

가
 238 가 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)

-

, , , ,

가

가 ()

,

, 가

가

(3)

-

15.4% (), 15.4% (14%, 1.4%)

15.4% (14% , 1.4%)

(,) 2

가

(,) 2

15.4% (14% , 1.4%) (

)

가

가

1.

| 4 (2020.06.01 - 2021.05.31) | | |
|-----------------------------|--|--|
| 3 (2019.06.01 - 2020.05.31) | | |
| 2 (2018.06.01 - 2019.05.31) | | |

가. (: , %)

| | 4 | 3 | 2 |
|---|----------------|----------------|----------------|
| | (2021.05.31) | (2020.05.31) | (2019.05.31) |
| | 1,709,736,362 | 1,510,130,900 | 218,236,699 |
| | 1,686,412,768 | 1,493,626,881 | 214,789,272 |
| | 0 | 0 | 0 |
| / | 0 | 0 | 0 |
| | 23,323,594 | 16,504,019 | 3,447,427 |
| | 0 | 0 | 0 |
| | 4,272 | 5,634 | 3,232 |
| | 1,709,740,634 | 1,510,136,534 | 218,239,931 |
| | 0 | 0 | 0 |
| | 1,387,778 | 947,771 | 330,286 |
| | 1,387,778 | 947,771 | 330,286 |
| | 1,646,977,996 | 1,435,800,326 | 209,317,536 |
| | -7,422,261 | -3,373,332 | -1,078,959 |
| | 68,797,121 | 76,761,769 | 9,671,068 |
| | 1,708,352,856 | 1,509,188,763 | 217,909,645 |

| | 4 | 3 | 2 |
|---------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | (2020.06.01-2021.05.31) | (2019.06.01-2020.05.31) | (2018.06.01-2019.05.31) |
| | 19,731,938 | 22,186,264 | 4,556,937 |
| | 61,031 | 100,530 | 29,753 |
| | 0 | 0 | 0 |
| / 가 () | 19,670,907 | 22,085,734 | 4,527,184 |
| | 0 | 0 | 0 |
| | 6,556,879 | 3,391,627 | 607,423 |
| | 6,556,879 | 3,391,627 | 607,423 |
| | 0 | 0 | 0 |
| | 53,330 | 19,710 | 1,040 |
| | 13,121,729 | 18,774,927 | 3,948,474 |

| | | | |
|--------|----------|--------|---|
| | 0 | 0 | 0 |
| (1) | 가 | 1 | 가 |
| 100 | 100% () | 가 100 | , |
| (2) | | | |
| (3) " | " " | (BSPL) | " |
| (4) " | " " | (BSPL) | " |
| (5) | | | , |



통 합 대 차 대 조 표

[단위:원]

| 과 목 | 제4기(2021.05.31) | | 제3기(2020.05.31) | | 제2기(2019.05.31) | |
|---------------------------|-------------------|---------------|-------------------|---------------|-------------------|-------------|
| | 금 액 | | 금 액 | | 금 액 | |
| 자 산 | | | | | | |
| 운 용 자 산 | | | | | | |
| 현금및예치금 | | 23,323,594 | | 16,504,019 | | 3,447,427 |
| 1. 현금및현금성자산 | 23,323,594 | | 16,504,019 | | 3,447,427 | |
| 2. 예치금 | | | | | | |
| 3. 증거금 | | | | | | |
| 대출채권 | | | | | | |
| 1. 콜론 | | | | | | |
| 2. 환매조건부채권매수 | | | | | | |
| 3. 매입어음 | | | | | | |
| 4. 대출금 | | | | | | |
| 유가증권 | | 1,686,412,768 | | 1,493,626,881 | | 214,789,272 |
| 1. 지분증권 | | | | | | |
| 2. 채무증권 | | | | | | |
| 3. 수익증권 | 1,686,412,768 | | 1,493,626,881 | | 214,789,272 | |
| 4. 기타유가증권 | | | | | | |
| 파생상품 | | | | | | |
| 1. 파생상품 | | | | | | |
| 부동산과 실물자산 | | | | | | |
| 1. 건물 | | | | | | |
| 2. 토지 | | | | | | |
| 3. 농산물 | | | | | | |
| 4. 축산물 | | | | | | |
| 기타운용자산 | | | | | | |
| 1. 임차권 | | | | | | |
| 2. 전세권 | | | | | | |
| 기 타 자 산 | | 4,272 | | 5,634 | | 3,232 |
| 1. 매도유가증권미수금 | | | | | | |
| 2. 정산미수금 | | | | | | |
| 3. 미수이자 | 4,272 | | 5,634 | | 3,232 | |
| 4. 미수배당금 | | | | | | |
| 5. 기타미수입금 | | | | | | |
| 6. 기타자산 | | | | | | |
| 7. 수익증권청약금 | | | | | | |
| 자 산 총 계 | | 1,709,740,634 | | 1,510,136,534 | | 218,239,931 |
| 부 채 | | | | | | |
| 운 용 부 채 | | | | | | |
| 1. 옵션매도 | | | | | | |
| 2. 환매조건부채권매도 | | | | | | |
| 기 타 부 채 | | 1,387,778 | | 947,771 | | 330,286 |
| 1. 매수유가증권미지급금 | | | | | | |
| 2. 정산미지급금 | | | | | | |
| 3. 해지미지급금 | | | | | | |
| 4. 수수료미지급금 | 1,387,778 | | 947,771 | | 330,286 | |
| 5. 기타미지급금 | | | | | | |
| 6. 기타부채 | | | | | | |
| 부 채 총 계 | | 1,387,778 | | 947,771 | | 330,286 |
| 자 본 | | | | | | |
| 1. 원 본 | 1,646,977,996 | | 1,435,800,326 | | 209,317,536 | |
| 2. 집합투자기구안정조정금 | | | | | | |
| 3. 이월잉여금 | 61,374,860 | | 73,388,437 | | 8,592,109 | |
| (발행좌수 당기: 1,646,977,996 좌 | | 68,797,121 | | 76,761,769 | | 9,671,068 |
| 전기: 1,435,800,326 좌 | | 수익조정금 | | -3,373,332 | | -1,078,959 |
| 전전기: 209,317,536 좌) | | | | | | |
| (기준가격 당기: 1,020.36 원 | | | | | | |
| 전기: 1,019.88 원 | | | | | | |
| 전전기: 1,010.80 원) | | | | | | |
| 자 본 총 계 | | 1,708,352,856 | | 1,509,188,763 | | 217,909,645 |
| 부 채 와 자 본 총 계 | | 1,709,740,634 | | 1,510,136,534 | | 218,239,931 |

통 합 손 익 계 산 서

[단위:원]

| 과 목 | 제4기(2020.06.01-2021.05.31) | | 제3기(2019.06.01-2020.05.31) | | 제2기(2018.06.01-2019.05.31) | |
|-------------------|------------------------------|-------------|------------------------------|------------|------------------------------|------------|
| | 금 액 | | 금 액 | | 금 액 | |
| 운 용 수 익 | | | | | | |
| 1. 투자수익 | | 61,031 | | 100,530 | | 29,753 |
| 1. 이 자 수 익 | 61,031 | | 100,530 | | 29,753 | |
| 2. 배당금수익 | | | | | | |
| 3. 수수료수익 | | | | | | |
| 4. 임대료수익 | | | | | | |
| 2. 매매차익과 평가차익 | | 46,286,511 | | 22,530,922 | | 6,565,763 |
| 1. 지분증권매매차익 | | | | | | |
| 2. 채무증권매매/평가차익 | | | | | | |
| 3. 파생상품매매/평가차익 | | | | | | |
| 4. 지분증권평가차익 | | | 4,356,917 | | 24,109 | |
| 5. 외환거래/평가차익 | | | | | | |
| 6. 현금및대출채권매매/평가차익 | | | | | | |
| 7. 기타거래차익 | 46,286,511 | | 18,174,005 | | 6,541,654 | |
| 3. 매매차손과 평가차손 | | 26,615,604 | | 445,188 | | 2,038,579 |
| 1. 지분증권매매차손 | | | | | | |
| 2. 채무증권매매/평가차손 | | | | | | |
| 3. 파생상품매매/평가차손 | | | | | | |
| 4. 지분증권평가차손 | 21,400,394 | | | | | |
| 5. 외환거래/평가차손 | | | | | | |
| 6. 대손상각비 | | | | | | |
| 7. 현금및대출채권매매차손 | | | | | | |
| 8. 기타거래손실 | 5,215,210 | | 445,188 | | 2,038,579 | |
| 운 용 비 용 | | 6,610,209 | | 3,411,337 | | 608,463 |
| 1. 운용수수료 | 2,347,324 | | 1,015,788 | | 206,818 | |
| 2. 판매수수료 | 3,975,389 | | 2,274,741 | | 380,384 | |
| 3. 수탁수수료 | 234,166 | | 101,098 | | 20,221 | |
| 4. 투자자문수수료 | | | | | | |
| 5. 임대자산관련비용 | | | | | | |
| 6. 기타비용 | 53,330 | | 19,710 | | 1,040 | |
| 당기순이익(또는 당기순손실) | | 13,121,729 | | 18,774,927 | | 3,948,474 |
| 좌당순이익(또는 좌당순손실) | | 0.007967155 | | 0.01307628 | | 0.01886356 |

2. [: ,]

| | | | | () | | | | | | |
|---|-------|-------------------------|---|----------|----|----------|----|----------|----|----|
| | | () | | () | | () | | () | | |
| - | (C1) | 2018.06.01 - 2019.05.31 | 0 | 0 | 8 | 8 | 6 | 7 | 1 | 1 |
| | | 2019.06.01 - 2020.05.31 | 1 | 1 | 13 | 14 | 7 | 7 | 7 | 8 |
| | | 2020.06.01 - 2021.05.31 | 7 | 7 | 10 | 10 | 10 | 11 | 6 | 7 |
| - | (C-e) | 2018.06.01 - 2019.05.31 | 0 | 0 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| | | 2019.06.01 - 2020.05.31 | 1 | 1 | 9 | 9 | 3 | 3 | 7 | 7 |
| | | 2020.06.01 - 2021.05.31 | 7 | 7 | 22 | 23 | 19 | 19 | 10 | 10 |
| - | (S) | 2018.06.01 - 2019.05.31 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | | 2019.06.01 - 2020.05.31 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | | 2020.06.01 - 2021.05.31 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

(1)

3.

가. () [2021.05.31 / : %]

| | | 1 | 2 | 3 | 5 | |
|---------|------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|------|
| | | 2020.05.31 ~ 2021.05.31 | 2019.05.31 ~ 2021.05.31 | 2018.05.31 ~ 2021.05.31 | 2016.05.31 ~ 2021.05.31 | |
| - (C1) | 2017.06.01 | 0.45 | 1.23 | 1.52 | - | 1.61 |
| - (C-e) | 2017.06.13 | 0.58 | 1.36 | 1.63 | - | 1.80 |
| - (S) | 2017.06.05 | 0.66 | 1.44 | 1.71 | - | 1.79 |
| (%) | 2017.06.01 | 0.79 | 1.55 | 1.80 | - | 1.88 |
| (%) | 2017.06.01 | 0.25 | 0.37 | 0.33 | 1.08 | 1.08 |

(1)

- 2017.12.21 :

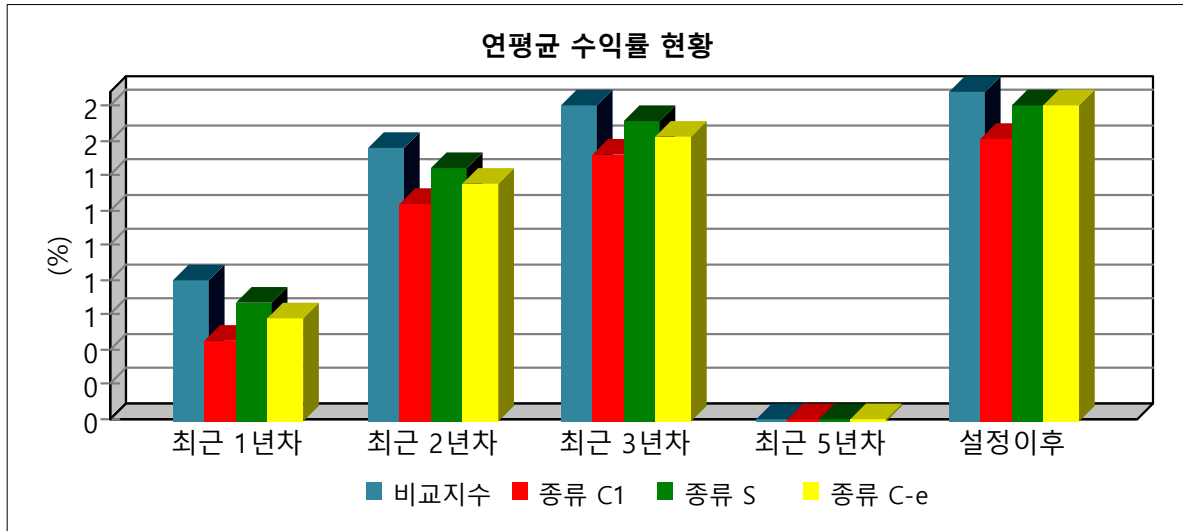
2017.12.22 : KBP (1-1.5) *95% + CALL *5%

(2)

(3)

(4) (%)

(5)



()

[2021.05.31 / :%]

| | | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
|---------|------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| | | 2020.05.31 ~ 2021.05.31 | 2019.05.31 ~ 2021.05.31 | 2018.05.31 ~ 2021.05.31 | 2017.05.31 ~ 2021.05.31 | 2016.05.31 ~ 2021.05.31 |
| - (C1) | 2017.06.01 | 0.45 | 2.48 | 4.64 | 6.60 | - |
| - (C-e) | 2017.06.13 | 0.58 | 2.73 | 4.96 | - | - |
| - (S) | 2017.06.05 | 0.66 | 2.91 | 5.22 | - | - |
| (%) | 2017.06.01 | 0.79 | 3.13 | 5.52 | - | - |

1)

- 2017.12.21 :

2017.12.22 : KBP (1-1.5) *95% + CALL *5%

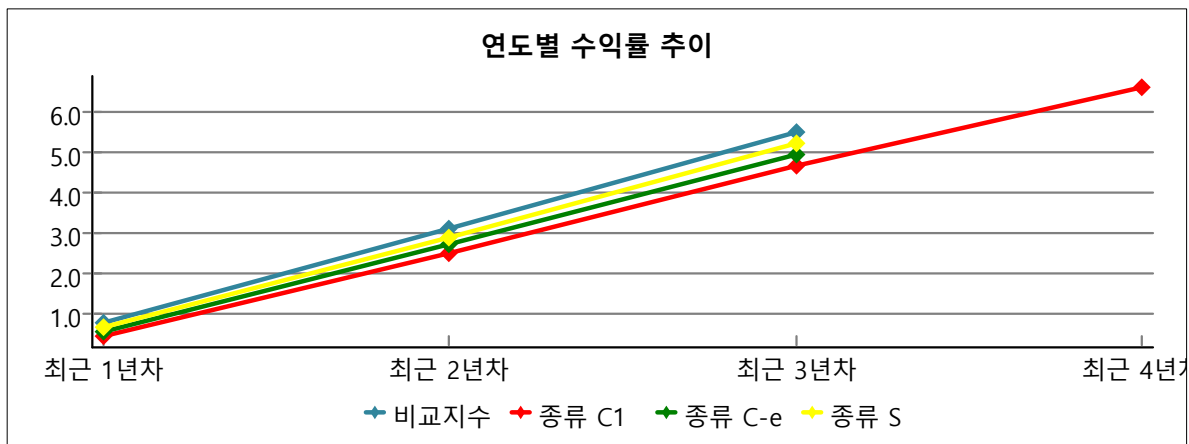
(2)

(3)

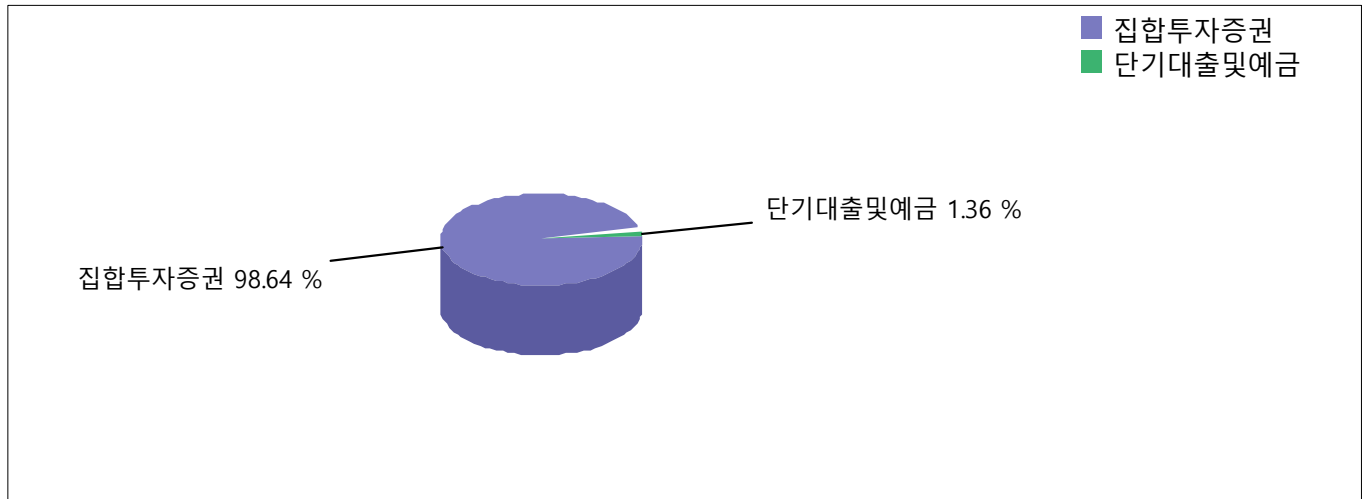
(4)

(5)

| 6 | |
|---|---|
| 6 | : |
| 1 | : |



1) ()



[2021.05.31 / : , %]

| KRW | 0 | 0 | 0 | 17 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 17 |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|----------|
| | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (98.64) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (1.36) | (0.00) | (100.00) |
| | 0 | 0 | 0 | 17 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 17 |
| | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (98.64) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (1.36) | (0.00) | (100.00) |

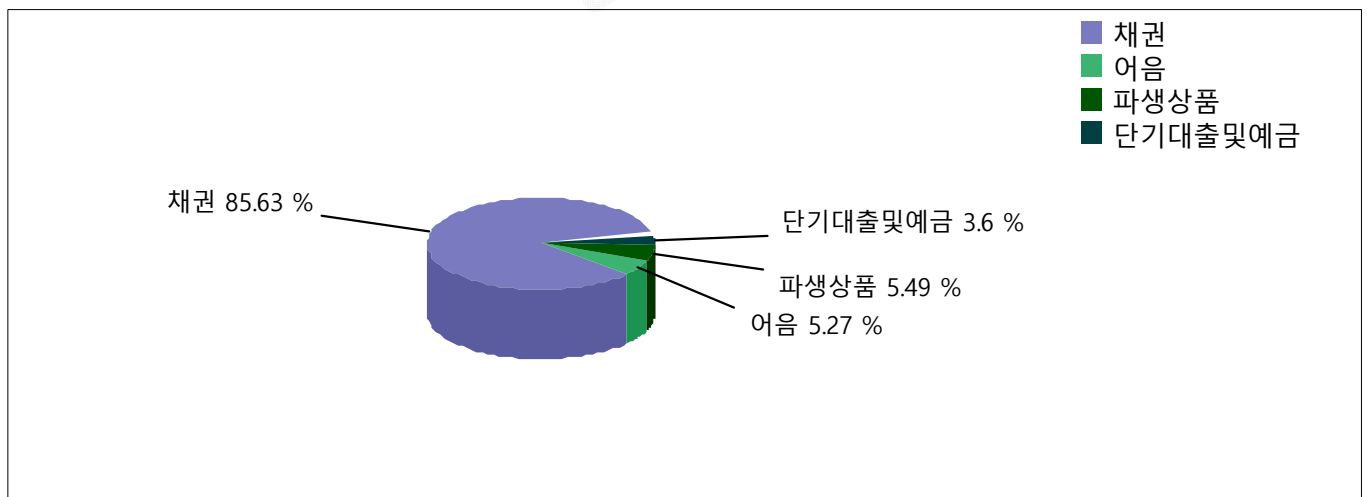
(1) ()

(2) : (CD)

(3) , 가 /

(4) , 가 ()
/

2) [[]]



[2021.05.31 / : , %]

| KRW | 0 | 405 | 25 | 0 | 26 | 0 | 0 | 0 | 0 | 17 | -26 | 447 |
|-----|--------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|----------|
| | (0.00) | (90.60) | (5.58) | (0.00) | (5.81) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (3.81) | (-5.79) | (100.00) |
| | 0 | 405 | 25 | 0 | 26 | 0 | 0 | 0 | 0 | 17 | -26 | 447 |
| | (0.00) | (90.60) | (5.58) | (0.00) | (5.81) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (3.81) | (-5.79) | (100.00) |

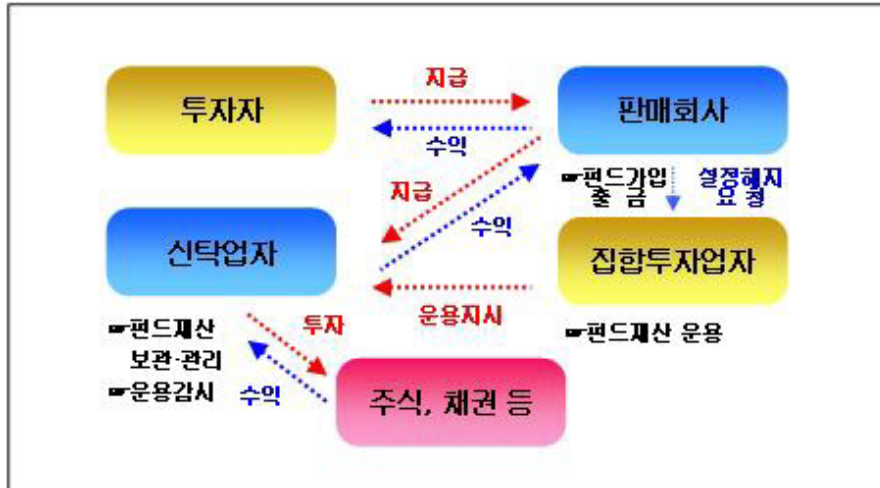
(1) ()

(2) : (CD)

(3) , 가 /

(4) , 가 ()
/

One
Shinhan
신한자산운용



1.

가.

| | |
|--|---|
| | () |
| | 70 18, 19 (: 02-767-5777, : www.shinhanfund.com) |
| | 2021.01 (() ()) 2009.01 () (() SH ()) 2008.09 , MOU |
| | 754 |
| | (100%) |

[]

, / , /

[]

,

[]

가 ,

()

가 가

[]

, , 가

가

2 (:)

[]

| | 25 2020 12 | 24 2019 12 |
|-----|---------------|---------------|
| 가 | 139,673 | 133,815 |
| 가 | 17,834 | 23,441 |
| 가 | 3,378 | 3,699 |
| | 27,526 | 20,848 |
| | 2,716 | 2,400 |
| | 191,127 | 184,203 |
| | 20,530 | 19,678 |
| | 20,530 | 19,678 |
| | 75,374 | 75,374 |
| | 29,177 | 29,177 |
| | 385 | 76 |
| | -578 | -578 |
| () | 66,240 | 60,477 |
| | 170,597 | 164,525 |
| | 191,127 | 184,203 |

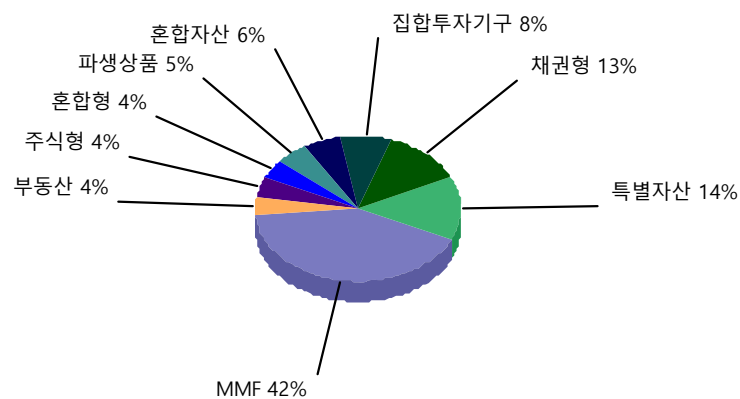
[]

| | 25 (20.01.01- 20.12.31) | 24 (19.01.01- 19.12.31) |
|-----|-------------------------------|-------------------------------|
| | 88,870 | 84,256 |
| | 53,994 | 53,069 |
| () | 34,876 | 31,187 |
| | 966 | 574 |
| | 542 | 478 |
| | 35,299 | 31,283 |
| | 8,636 | 8,193 |
| () | 26,663 | 23,090 |
| () | | |
| () | 26,663 | 23,090 |

(2021.05.31 / :) ()

| | | | | | | | | | MMF | |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|
| | 16,623 | 16,684 | 48,294 | 30,349 | 19,836 | 15,526 | 54,291 | 22,895 | 160,551 | 385,050 |

유형별 운용자산규모



2. 가. ()

3.

가.

1)

| | |
|--|---------------------------|
| | |
| | 8 10 (: 02-3770-8800) |
| | www.ksfc.co.kr |

2)

(1)

(2) 가
()

가 / / 가가 / 가
/ 가
() 가 ,
() 가
() 가
가

.

1)

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

2)

(1)

가

(2)

가

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

-

,

가

가

2

-

가

-

4

1

-

,

5

1

-

가

(

“

”

)

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
(www.kofia.or.kr)

2.

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

3.

가.

(1)

[]

2

1)

2)

3)

4)

.

[]

가

87 8 1 2

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

2

3

, 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

37

2

3

1.

가

2.

가

3.

가

1

180

가

(

,

)

가

5

1

가

(

,

)

가

5

,

2

3

가

(

35

4

가

)

(2)

(www.shinhanfund.com) .

(www.kofia.or.kr)

1.

(

,

)

2.

3.

93

2

4.

5.

,

123

3

2

6. , , 가 가
 7. 가 가
 (262 1 ,)
 8. 가 (가 50
 .) 1
 가 192 1
 9. 가 가 1 1
 50 가 192 1
 10. (.
)
 1) 242 2
 2)
 3) .
 4)
 11. 가
 (3)

- , , , :
 - (“ ”) 100 5 100 :
 - :
 - 4 30 4
 1 1
 - ()

4. 가. (2020.06.01 - 2021.05.31) :
 . (2020.06.01 - 2021.05.31) :
 .

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

| | |
|--|----------------------|
| | - - IT/ - . |
|--|----------------------|

5.

.

6.

가

.



[()]

1. ()

2. ()

가.

. ()

[가]

1.

2.

One
Shinhan
신한자산운용

[]

| | |
|---|-----------------------|
| | |
| | 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 가 (10) |
| | 가 가 가 가 가 () |
| | 가 |
| | 가 5 |
| | Active |
| | |
| | 가 |
| | |
| | 가 가 가 |
| | |
| | 가 |
| | 가 |
| / | : : : |