

(무) 알리안츠 마이플랜달러변액적립보험(일시납)/변액적립보험/달러변액적립보험 토탈리턴글로벌채권재간접형(달러화)

※ 공지 사항

1. 자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월)동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.
2. 이 보고서는 자본시장법에 의해 토탈리턴글로벌채권재간접형(달러화)의 자산운용회사인 에이비엘생명(외화)이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 한국씨티은행의 확인을 받아 판매회사인 에이비엘생명을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.
3. 자산은 알리안츠글로벌인베스터스자산운용(주)에 의하여 투자일임 운용됩니다.
4. 각종 보고서 확인 : 에이비엘생명보험 <http://www.abllife.co.kr/02-3787-7000>
 금융투자협회 <http://dis.kofia.or.kr>

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭	토탈리턴글로벌채권재간접형(달러화)		
금융투자협회 펀드코드	A1102		
펀드의 종류	변액보험, 추가형, 일반형	최초설정일	2013.05.09
운용기간	2017.04.01 ~ 2017.06.30	존속기간	최종으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	에이비엘생명보험(외화)	펀드재산보관회사	한국씨티은행
판매회사	에이비엘생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	* 글로벌 시장의 채권에 투자하는 USD 통화표시 채권형 집합투자증권에 펀드 자산의 대부분을 투자하여 투자수익을 추구하는 재간접형 펀드로 글로벌 시장의 우량 채권에 분산 투자하는 펀드에 투자하여 장기적인 이자수익과 자본이득을 추구합니다.		

▶ 재산 현황

아래 표를 통하여 당기말과 전기말 간의 자산총액, 부채총액, 순자산총액 및 기준가격의 추이를 비교하실 수 있습니다.

(단위 : 천USD, 천좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
토탈리턴글로벌채권재간접형(달러화)	자산 총액 (A)	714	733	2.70
	부채 총액 (B)	0	0	-0.02
	순자산총액 (C=A-B)	714	733	2.70
	발행 수익증권 총 수 (D)	68,300	68,789	0.71
	기준가격 (E=C/Dx1000)	10.45	10.65	1.91

* 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령 시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

지난 분기 PIMCO Total Return fund를 88% 편입하고 있는 동펀드는 2% 가까운 수익율을 보이며 상승세를 지속했습니다. 6월 Fed의 금리인상으로 단기 금리는 상승했으나 저유가 속에 인플레이션 우려 속 중장기 금리는 오히려 하락하며 만기별 차별화되는 모습을 보였습니다. 투자등급 채권, 하이일드 및 이머징 마켓 채권의 스프레드 역시 축소세가 유지되는 가운데, 원펀드의 경우 채권 만기구조에 대한 전략, 하이일드, 지방채 등 위험자산에 대한 전략적 투자 등에서 양호한 실적을 보이며 벤치마크를 상회하는 수익률을 보였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

단기금리를 중심으로 금리상승 기조는 계속되는 가운데 전체 듀레이션은 BM 대비 짧게 운용할 계획입니다. 회사채 비중은 상대적으로 낮게 가져가는 대신 하이일드, 지방채에 투자하고 있으며 시장 변동성이 확대되는 시기에 펀더멘털이 견조한 회사채는 전략적으로 추가하는 전략을 고려할 계획입니다. Agency MBS의 비중도 높게 유지하고 있으나 금리수준별로 선택적으로 보유하고 있으며 non-Agency 모기지의 경우에도 매력적인 수익률이 기대되는 경우 추가하고 있습니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
토탈리턴글로벌채권재간접형(달러화)	1.91	3.20	0.85	2.11
(비교지수 대비 성과)	(0.28)	(0.66)	(1.66)	(2.28)
비교지수(벤치마크)	1.63	2.54	-0.81	-0.17

* 비교지수(벤치마크) : Barclays Capital U.S. Aggregate Index(95%)

* 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
토탈리턴글로벌채권재간접형(달러화)	2.11	5.55	5.97	-
(비교지수 대비 성과)	(2.28)	(-0.01)	(-1.52)	-
비교지수(벤치마크)	-0.17	5.56	7.49	-

* 비교지수(벤치마크) : Barclays Capital U.S. Aggregate Index(95%)

* 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

▶ 손익현황

(단위 : 천USD)

구분	증권			집합투자	파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음		장내	장외		실물자산	기타			
전기	0	0	0	9	0	0	0	0	0	0	-1	9
당기	0	0	0	15	0	0	0	0	0	0	-1	14

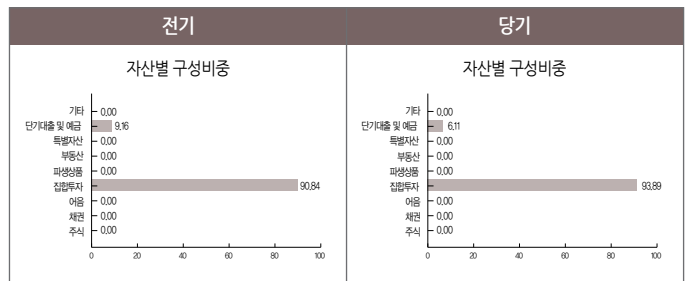
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 천USD, %)

구분	증권			집합투자	파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음		장내	장외		실물자산	기타			
USD (1144.10)	0	0	0	688	0	0	0	0	0	45	0	733
(1144.10)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(93.89)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(6.11)	(0.00)	(100.00)
합계	0	0	0	688	0	0	0	0	0	45	0	733

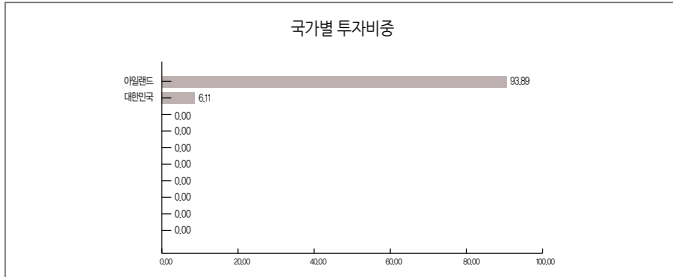
* () : 구성비중



▶ 국가별 투자비중

(단위 : %)

	국가명	비중		비중
1	아일랜드	93.89	6	
2	대한민국	6.11	7	
3			8	
4			9	
5			10	



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : 계약, 천USD)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	해외주식	PIMCO-TOTAL RTRN BD-SINS ACC	93.89	6			
2	해외단기	USD Deposit	6.11	7			
3				8			
4				9			
5				10			

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 천USD, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	USD Deposit	2013.5.9	45	0.00	2999.12.31	대한민국	USD

* 투자대상 상위 10종목 및 평균금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 천USD, %)

구분	전기		당기	
	금액	비율	금액	비율
자산운용사	0	0.02	0	0.02
판매회사	1	0.08	1	0.08
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00
보수합계	1	0.11	1	0.11
기타비용**	0	0.00	0	0.00
매매·중개 수수료	0	0.00	0	0.00
증권거래세	0	0.00	0	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외한 것입니다.

* 성과보수내역 : 없음

* 발행분담금내역 : 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위 : 연환산, %)

	총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
전기	0.4489	0	0.4489
당기	0.449	0	0.449

* 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는'보수'와'기타비용'총액을 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

* 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

5. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위 : 천USD, %)

매수		매도		매매회전을	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	0	0	0.00	0.00

* 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균금액으로 나눈 비율입니다. 매매회전율이 높을 경우 매매거래수수료(0.1% 내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

2016-10-01 ~ 2016-12-31	2017-01-01 ~ 2017-03-31	2017-04-01 ~ 2017-06-30
0.00	0.00	0.00

6. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	나이	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
이현구	부사장	48	68	19,901	-	-	2111000044
남정은	과장	33	69	19,901	-	-	2109001500

* 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임 운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함

▶ 운용전문인력 변경내역

기준일	구분	성명	협회등록번호	등록일	사유
변경내역 없음					

'토달리턴글로벌채권재간접형(달러형)'의 경우, 펀드의 운용규모가 법적 기준 소규모상태(50억원 미만)에 해당하여 운용시 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란할 수 있습니다. 또한, 법적당선에 의거하여 향후 불가피하게 임의해지를 통해 경리될 수 있음을 알려드립니다. (자본시장과 금융투자업에 관한 법률 제192조 제1항, 동법 시행령 제223조 제3호 및 제4호)