

(무)알리안츠 파워인덱스변액연금보험(방카슈랑스) 브릭스인덱스형

※ 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 (무)알리안츠파워인덱스변액연금브릭스인덱스형의 자산운용회사인 ABL생명보험이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 한국씨티은행의 확인을 받아 판매회사인 ABL생명보험을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.
3. 자산은 알리안츠글로벌인베스터스에 의하여 투자일임 운용됩니다.
4. 각종 보고서 확인 : ABL생명보험 <http://www.abllife.co.kr/> 02-3787-7000
 금융투자협회 <http://dis.kofia.or.kr>

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭	(무)알리안츠파워인덱스변액연금브릭스인덱스형		
금융투자협회 펀드코드	86923		
펀드의 종류	변액보험, 추가형 일반형	최초설정일	2008.08.12
운용기간	2017.07.01 ~ 2017.09.30	존속기간	취항으로 별도의 존속기간 없음
자산운용회사	ABL생명보험	펀드재산보관회사	한국씨티은행
판매회사	ABL생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	• 브릭스(브라질, 러시아, 인도, 중국)지역의 주식을 주식인덱스 구성종목 또는 주식형수익증권, 상장지수펀드(ETF) 등에 투자하여 낮은 비용으로 장기투자자와 자산배분을 통한 해당지역의 대표 주식인덱스를 추종 운용하며, 포트폴리오 구성 시에 중목선정 및 비중조정 등을 통한 알파획득을 추구합니다.		

▶ 재산 현황

아래 표를 통하여 당기말과 전기말 간의 자산총액, 부채총액, 순자산총액 및 기준가격의 추이를 비교하실 수 있습니다.
 (단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
파워인덱스va 브릭스인덱스형	자산 총액 (A)	1,345	1,418	5.49
	부채 총액 (B)	9	1	0.00
	순자산총액 (C=A-B)	1,335	1,418	6.17
	발행 수익증권 총 수 (D)	1,107	1,109	0.15
	기준가격 (E=C/D×1000)	1,206.36	1,278.90	6.01

※ 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

글로벌 증시는 3분기에도 견조한 상승세를 이어갔습니다. 기업실적 호조와 안정적인 경기 확장국면 및 완만한 인플레이션 상황 등으로 경제는 골디락스에 가까운 상태를 보였습니다. 전세계 신홍국지수는 9월 27일에 1,081.72p로 마감하며 전분기 대비 7.02% 상승했습니다. 유가가 배럴당 50달러를 넘어서고 비철금속 가격이 연초 박스권을 상향돌파하는 등 원자재 가격이 상승세를 보이면서 경기회복 기대감이 높아졌습니다. 게다가 달러가 지속적으로 약세를 보인 점 역시 신홍국 증시의 상승세를 이끈 요인 중 하나였습니다. 전체 펀드는 기간 중 6.01%의 수익률을 시현하였고, 비교지수 대비로는 0.38%p 상회하는 성과를 거두었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

4분기에 신홍국 증시는 완만한 상승세를 보일 전망입니다. 원자재 가격의 하방경직성이 높아지는 가운데, 신홍국들의 경기 회복 모멘텀은 여전히 유효한 상황입니다. 다만 북한과 미국간의 갈등이 여전히 지속되고, 미 연준이 예상보다 매파적인 모습을 보이고 있는 점들을 감안하면, 상반기 대비 다소 제한적인 상승호를 보일 것으로 예상됩니다. 이에 따라 동 펀드는 비교지수 수준의 편입비중 조절을 통해 안정적인 운용을 유지할 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
파워인덱스va브릭스인덱스형 (비교지수 대비 성과)	6.01 (0.38)	8.43 (-0.79)	10.92 (-1.08)	13.10 (-0.68)
비교지수(벤치마크)	5.63	9.22	12.00	13.78

※ 비교지수(벤치마크) : 종합채권 2-3년(T-1) X 45% + MSCI BRIC Index(KRW) X 45% + CALL X 10%

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

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
파워인덱스va브릭스인덱스형 (비교지수 대비 성과)	13.10 (-0.68)	19.25 (-1.72)	15.17 (-3.55)	16.90 (-6.64)
비교지수(벤치마크)	13.78	20.97	18.72	23.54

※ 비교지수(벤치마크) : 종합채권 2-3년(T-1) X 45% + MSCI BRIC Index(KRW) X 45% + CALL X 10%

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

▶ 추적오차

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 1년
추적오차	3.72	3.30	3.98

※ 추적오차란 일정기간 동안 인덱스펀드가 추종하는 특정 비교지수의 변동을 얼마나 충실히 따라갔는지를 보여주는 지표로서, 비교지수 수익률 대비 해당 인덱스펀드의 일간 수익률 차이의 표준편차로 기재합니다. 추적오차의 수치가 적을수록 해당 기간 동안 인덱스펀드가 비교지수와 유사하게 움직였음을 의미합니다.

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익 합계
	주식	채권	어음	집합 투자	장내	장외		실물 자산	기타			
전기	2	0	0	28	0	0	0	0	0	5	-5	30
당기	0	0	0	92	0	0	0	0	0	0	-5	88

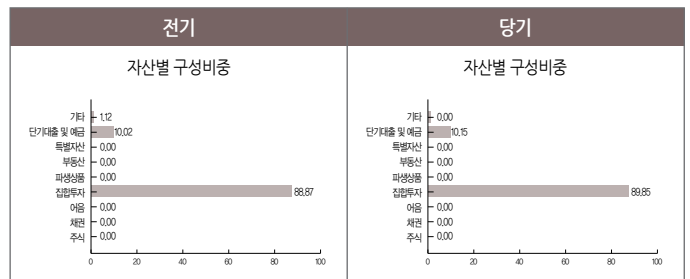
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합 투자	장내	장외		실물 자산	기타			
USD (1145.40)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	631 (44.47)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	631 (44.47)
KRW (1.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	644 (45.39)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	144 (10.15)	0 (0.00)	788 (55.53)
합계	0	0	0	1,274	0	0	0	0	0	144	0	1,418

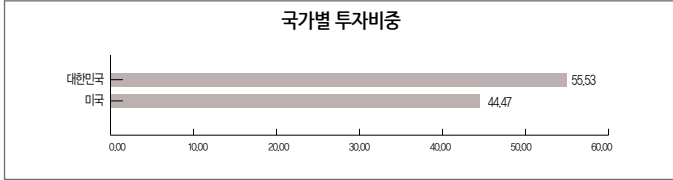
※ () : 구성비중



▶ 국가별 투자비중

(단위 : %)

순위	국가명	비중	순위	국가명	비중
1	대한민국	55.53	6		
2	미국	44.47	7		
3			8		
4			9		
5			10		



주) 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다.

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	종목명	비중
1	집합투자증권	이지스(재)채권(C/C(V))	45.39	6		
2	집합투자증권	ISHARES MSCI BRIC INDEX FUND	44.47	7		
3	단기상품	CMA(신한금융투자)	8.71	8		
4	단기상품	은대(한국씨티은행)	1.43	9		
				10		

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 집합투자증권

(단위 : 최수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
이지스(재)채권(C/C(V))	채권형	말리안초글로벌인베스타자산운용	637	644	대한민국	KRW	45.39
ISHARES MSCI BRIC INDEX FUND	수익증권	ISHARES MSCI BRIC INDEX FUND	503	631	미국	USD	44.47

※ 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
CMA	신한금융투자	2017-09-29	124	1.15	2017-10-10	대한민국	KRW
예금	한국씨티은행	2008-08-12	20	0.92		대한민국	KRW

※ 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

구분	전기		당기	
	금액	비율	금액	비율
자산운용사	0	0.02	0	0.03
판매회사	1	0.11	2	0.11
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00
보수합계	2	0.14	2	0.15
기타비용**	0	0.00	0	0.01
매매· 중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0	0.00
	조서분석업무 등 서비스수수료	0	0	0.00
	합계	0	0	0.00
증권거래세	0	0.00	0	0.00

※ 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.
 ※ 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외된 것입니다.
 ※ 성과보수내역 : 해당 없음
 ※ 발행분담금내역 : 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위 : 연환산, %)

	총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
전기	0.5909	0.0111	0.602
당기	0.5959	0.0145	0.6104

※ 총보수비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균 잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수비용수준을 나타냅니다.
 ※ 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

5. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매 회전율	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	0	0	0.00	0.00

※ 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율입니다. 매매회전율이 높을수록 매매거래수수료(0.1% 내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

2017-01-01 ~ 2017-03-31	2017-04-01 ~ 2017-06-30	2017-07-01 ~ 2017-09-30
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	74	20,018	-	-	2111000044
남정은	과장	33	74	20,018	-	-	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	운용전문인력
	변경내역 없음

‘(무)알리안츠파워인덱스변액연금부릭스인덱스형’의 경우 펀드의 운용규모의 법적 기준 소규모상태(50억원 미만)에 해당하여 운용시 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란할 수 있습니다. 또한 법적당사에 의거하여 향후 불가피하게 임의해지를 통해 정리될 수 있음을 알려드립니다. (자본시장과 금융투자업에 관한 법률 제 192조 제1항, 동법 시행령 제 223조 제3호 및 제4호)