

(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(달러형)의 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 알리안츠글로벌인베스터스자산운용(주)에 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	토탈리턴글로벌채권재간접형(달러형)		
금융투자협회 펀드코드	AJ102		
펀드의 종류	변액보험, 추가형, 일반형	최초설정일	2013.05.09
운용기간	2017.07.01 ~ 2017.09.30	존속기간	최종으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	ABL생명보험	펀드재산보관회사	한국씨티은행
판매회사	ABL생명보험	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(달러형)	자산 총액 (A)	733	737	0.53
	부채 총액 (B)	0	0	0.00
	순자산총액 (C=A-B)	733	737	0.53
	발행 수익증권 총 수 (D)	68,789	68,347	-0.64
	기준가격 (E=C/D*1000)	10.65	10.78	1.22

* 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 91% 편입하고 있는 동펀드는 1%대 수익율을 보이며 상승세를 지속했습니다. 12월 금리 추가인상 가능성이 확대되며 금리는 단기를 중심으로 전반적으로 상승했으나 견조한 경제지표를 바탕으로 신용 스프레드는 축소되며 투자등급 채권, 하이일드 및 이머징마켓 채권은 모두 양호한 수익률을 보였습니다. 원펀드 벤치마크 대비 듀레이션을 짧게 가져가며 금리 상승에 대비하였고, 하이일드, 지방채 등 위험자산에 대한 전략적 투자 분야에서 양호한 실적을 보이며 벤치마크를 상회하는 수익률을 보였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

단기금리를 중심으로 금리상승 기조는 계속되는 가운데 단기채권 비중은 줄이고, 고평가된 장기물보다는 중기 채권 위주로 포트폴리오를 구성할 것입니다. 시장의 물가상승 기대감이 낮은 가운데 저평가된 것으로 판단되는 물가연동채권의 선택적 투자 및 시장 변동성이 확대되는 시기에 펀더멘털이 확실한 회사채, 하이일드 채권 등을 지속적으로 추가할 계획입니다. Agency MBS(정부기관 주택저당증권)의 비중도 높게 유지하고 있으나 금리수준별로 선택적으로 보유하고 있으며 non-Agency 모기지(민간 주택저당증권)의 경우에도 매력적인 수익률이 기대되는 경우 추가하고 있습니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
토탈리턴글로벌채권재간접형(달러형)	1.22	3.16	4.46	2.08
(비교지수 대비 성과)	(0.55)	(0.84)	(1.23)	(2.23)
비교지수(벤치마크)	0.67	2.32	3.23	-0.15

* 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(달러형)	2.08	7.16	8.02	-
(비교지수 대비 성과)	(2.23)	(2.17)	(0.17)	-
비교지수(벤치마크)	-0.15	4.99	7.85	0.00

* 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				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익 합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	0	0	0	15	0	0	0	0	0	0	(1)	14
당기	0	0	0	9	0	0	0	0	0	0	(1)	8

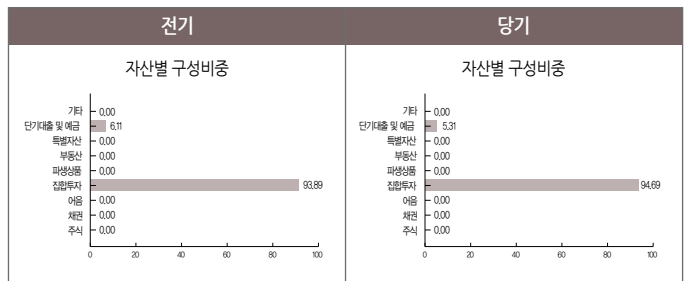
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 천USD, %)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
USD (1145.40)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	698 (94.69)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	39 (5.31)	0 (0.00)	737 (100.00)
합계	0	0	0	698	0	0	0	0	0	39	0	737

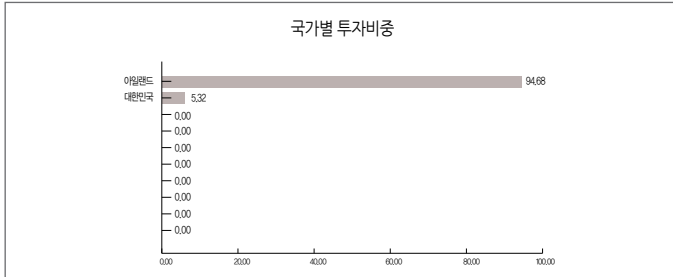
* () : 구성비중



▶ 국가별 투자비중

(단위 : %)

	국가명	비중		국가명	비중
1	아일랜드	94.68	6		
2	대한민국	5.32	7		
3			8		
4			9		
5			10		



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : 계약, 천USD)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	집합투자증권	PIMCO-TOTAL RTRN BD-SINS ACC	94.69	6			
2	해외단기	USD Deposit	5.31	7			
3				8			
4				9			
5				10			

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
PIMCO-TOTAL RTRN BD-SINS ACC	수익증권	PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited	664	698	아일랜드	USD	94.69

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 천USD, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
외화예치금	한국씨티은행	2013-05-09	39	0.00		대한민국	USD

* 투자대상 상위 10종목 및 평균금액이 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	0.02
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 중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0	0.00
	조선분석업 등 서비스 수수료	0	0	0.00
	합계	0	0.00	0
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	0.449	0	0.449
당기	0.449	0	0.449

* 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 총보수·비용수준을 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 : 천USD, %)

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

* 매매회전을이란 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율입니다. 매매회전이 높을경우 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	구분	성명	협회등록번호	등록일	사유
					변경내역 없음

'토달리턴글로벌채권재간접형(달러형)'의 경우 펀드의 운용규모의 법적 기준 소규모대상(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)