

유럽주식재간접형

※ 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 유럽주식재간접형의 자산운용회사인 ABL생명보험이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 국민은행의 확인을 받아 판매회사인 ABL생명보험을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.
3. 자산은 키움투자자산운용에 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	유럽주식재간접형		
금융투자협회 펀드코드	BX464		
펀드의 종류	변액보험, 일반형	최초설정일	2017.09.11
운용기간	2017.07.01 ~ 2017.09.30	존속기간	
자산운용회사	ABL생명보험	펀드재산보관회사	국민은행
판매회사	ABL생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징			

▶ 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
유럽주식재간접형	자산 총액 (A)	0	3	0.00
	부채 총액 (B)	0	0	0.00
	순자산총액 (C=A-B)	0	3	0.00
	발행 수익증권 총 수 (D)	0	3	0.00
	기준가격 (E=C/D×1000)	0.00	1,024.61	0.00

※ 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

2017년 3분기 초반 유럽증시는 9월 초 드라기 ECB 총재의 자산매입 축소 전환 언급으로 하락세를 보였습니다. 하지만 이후 미 연준의 10월 자산매입 축소 시행 계획 발표 및 12월 기준금리 인상 기대감, 트럼프 행정부의 세계 개혁안 발표로 유로는 약세로 시현하였고 이에 수출 개선 기대감이 부각되며 유럽 증시는 상승세를 시현하였습니다. 동 펀드 역시 우호적인 시장 환경에 힘입어 상승하였습니다. 동 펀드는 9월 11일 설정되었으며 설정일 이후 2.46%의 수익을 거두었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

10월 ECB 통화정책회의에서 테이퍼링 계획 발표 가능성이 염두해야 할 것으로 보이나 미국의 자산 매입 축소 시행, 12월 기준금리 추가 인상 가능성 부각으로 유로는 약세를 지속할 것으로 보입니다. 이에 유럽 증시는 유로화 약세 및 견조한 경기 지표 속에 상승세를 지속할 것으로 예상됩니다. 동 펀드는 소규모로 인한 운용상의 어려움으로 환헤지를 수행하고 있지 않습니다. 환헤지를 수행하기 위한 적정 규모에 도달할 시 바로 환헤지를 수행할 계획입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
유럽주식재간접형 (비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

※ 비교지수(벤치마크) : MSCI_Daily_TR_Net_EMU_Local(T-1) X 90% + CALL X 10%

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

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유럽주식재간접형 (비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

※ 비교지수(벤치마크) : MSCI_Daily_TR_Net_EMU_Local(T-1) X 90% + CALL X 10%

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

▶ 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	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
당기	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0

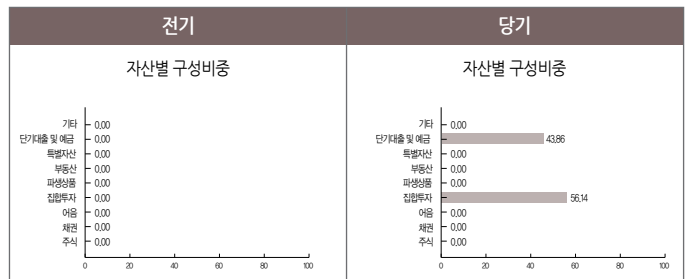
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합 투자	장내	장외		실물 자산	기타			
EUR (1350.94)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	2 (56.14)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	41.24 (0.00)	0 (0.00)	3 (97.38)
KRW (1.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	2.62 (0.00)	0 (0.00)	0 (2.62)
합계	0	0	0	2	0	0	0	0	0	1	0	3

※ () : 구성비중

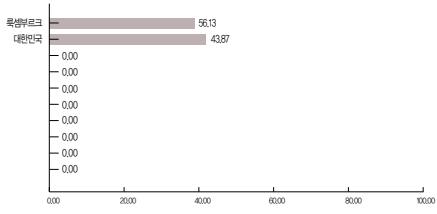


▶ 국가별 투자비중

(단위 : %)

	국가명	비중		국가명	비중
1	룩셈부르크	56.13	6		
2	대한민국	43.87	7		
3			8		
4			9		
5			10		

국가별 투자비중



5. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위: 백만원, %)

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		

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위: %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	종합투자증권 SCHRODER INTL EURO EQT-C ACC	56.14	6		
2	단기상품 EUR Deposit(CITM-KR)	41.24	7		
3	단기상품 은대(국민은행)	2.62	8		
4			9		
5			10		

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 집합투자증권

(단위: 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
SCHRODER INTL EURO EQT-C ACC	수익증권	SCHEUCA LX	2	2	룩셈부르크	EUR	56.14

※ 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
외화예치금	한국씨티은행	2017-09-29	1	0.00		대한민국	EUR
예금	국민은행	2017-09-11		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	0.00	0	0.00	
판매회사	0	0.00	0	0.02	
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수합계	0	0.00	0	0.03	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매 중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0.00	0	0.00
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
	합계	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	0	0
당기	0.4754	0	0.4754

※ 총보수비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균 잔액(보수비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총보수비용수준을 나타냅니다.

※ 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균잔액(보수비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.