

ELS지수연계솔루션재간접형

※ 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 ELS지수연계솔루션재간접형의 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 한국투자신탁운용에 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	ELS지수연계솔루션재간접형		
금융투자협회 펀드코드			
펀드의 종류	변액보험, 일반형	최초설정일	2017.09.25
운용기간	2017.09.25 ~ 2017.09.30	존속기간	
자산운용회사	ABL생명보험	펀드재산보관회사	국민은행
판매회사	ABL생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	<ul style="list-style-type: none"> • 다양한 지수연계증권 등 주식관련 장외파생상품을 주된 투자대상으로 하는 집합투자증권에 순자산의 100% 이내로 투자하고, 나머지는 예금 및 유동성 자산에 투자됩니다. • 편입되는 ELS관련 집합투자증권은 한국·중국·유럽시장을 대표하는 지수(KOSPI200, HSCFI, EuroStoxx50)를 기초자산으로 한 20개의 동일한 ELS 수익구조 바스켓을 지수화한 장외파생상품에 주로 투자합니다. • 현재 한국투자신탁운용에서 운용하는 한국투자ELS지수연계솔루션 펀드에 재간접형으로 투자합니다. 		

▶ 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
ELS지수연계 솔루션재간접형	자산 총액 (A)	0	78	0.00
	부채 총액 (B)	0	0	0.00
	순자산총액 (C=A-B)	0	78	0.00
	발행 수익증권 총 수 (D)	0	78	0.00
	기준가격 (E=C/D×1000)	0.00	1,001.68	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

해당펀드는 2017년 9월 25일 최초설정되었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

9월 FOMC에서 연준은 미국 경기회복에 대한 자신감을 바탕으로 10월부터 대차대조표 축소를 시작하기로 결정하였고 12월 추가 금리인상이 전망됩니다. ECB 드라기 총재는 10월 통화정책회의 때 통화정책 방향에 대한 입장을 비출 것으로 예측됨에 따라 향후 자산매입 규모 축소 계획에 관심이 주목되고 있습니다. 이는 유로화 강세요인이나 당장 시행이 아닌 계획을 발표할 것임을 감안하면 시장 영향력은 제한적일 것으로 보입니다.

중국인 최근 경기 상승 및 위안화 환율 안정세의 영향으로 해외 자금이 유입되고 있는 것으로 파악됩니다. 10월 18일로 예정된 공산당대회를 앞두고 규제당국이 금융 안정성 유지를 위해 추가적인 조치를 취할 것으로 예상되며, 국내외로 우호적인 환경이 조성되면서 A중시 랠리가 전망됩니다. 국내 경기 역시 대내적으로 북한 리스크가 잠재해 있지만 글로벌 경기의 강한 확장세가 이를 상쇄시켜 줄 것으로 예상된다는 측면에서 수출 경기를 중심으로 완만한 회복세가 유지될 것으로 전망 됩니다. 현재 지수

수준이 10월에도 유지된다고 가정했을 때, 초기상환이 유력해 보이는 1건(연쿠폰 6.0%)의 평가일이 예정되어 있어 펀드 기준가격에 긍정적인 영향을 미칠 것으로 기대됩니다. 하반기에도 지정학적 리스크 및 통화정책 변화 등 세계 증시에 영향을 미칠 변수가 산재해 있음에 따라 이에 대한 면밀한 모니터링을 바탕으로 변동성 확대에 유의하며 운용할 계획입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
ELS지수연계솔루션재간접형	-	-	-	-

※ 동 펀드는 벤치마크를 적용하지 않습니다.

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

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
ELS지수연계솔루션재간접형	-	-	-	-

※ 동 펀드는 벤치마크를 적용하지 않습니다.

* 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

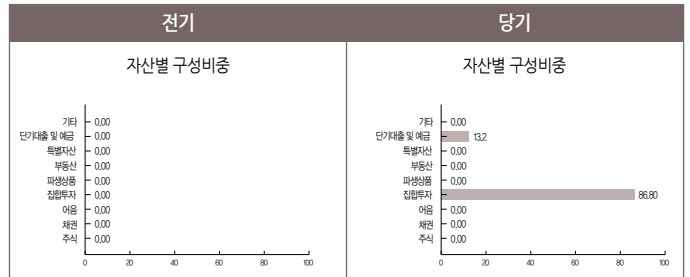
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합 투자	장내	장외		실물 자산	기타			
KRW (1.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	68 (86.80)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	10 (13.20)	0 (0.00)	78 (100.00)
합계	0	0	0	68	0	0	0	0	0	10	0	78

※ () : 구성비중



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	집합투자증권	한국투자ELS지수연계솔루션(주식연계형)	86.80	6		
2	단기상품	은대(국민은행)	13.20	7		
3				8		
4				9		
5				10		

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정일	순자산금액	발행국가	통화	비중
한국투자증권주식투자증권	주식형	한국투자증권	68	68	대한민국	KRW	86.80

※ 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
예금	국민은행	2017-09-25	10	0.92		대한민국	KRW

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

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	부서장	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					

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	0.01
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00
보수합계	0	0.00	0	0.01
기타비용**	0	0.00	0	0.00
매매 중개 수수료	단순매매 · 중개수수료	0	0	0.00
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0	0.00
	합계	0	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 제외된 것입니다.

※ 성과보수내역 : 없음

※ 발행분담금내역 : 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위 : 연환산, %)

	총보수 · 비용비율(A)	매매 · 중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
전기	0	0	0
당기	0.3849	0	0.3849

※ 총보수·비용비율(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 총보수·비용수준을 나타냅니다.

※ 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균 잔액(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 회전을	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	0	0	0.00	0.00

※ 매매회전을이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가격의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가격으로 나눈 비율입니다. 매매회전이 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