

(무)알리안츠변액유니버설보험/(무)알리안츠변액유니버설보험1형/(무)보너스주는변액적립보험/(무)보너스주는변액적립보험(방카)/(무)알리안츠우리아이꿈을키우는변액유니버설보험/(무)더나은변액유니버설통합건강중신보험/(무)알리안츠글로벌어린이변액유니버설보험/(무)알리안츠투자에게강한변액연금보험/(무)알리안츠꼭필요한직장인변액유니버설보험/(무)알리안츠멀티플변액유니버설통합중신보험/(무)알리안츠뉴글로벌어린이변액유니버설보험/(무)알리안츠뉴파워리턴변액유니버설보험/(무)알리안츠뉴변액유니버설보험/(무)알리안츠파워리턴변액유니버설보험/소중한나를위한(무)알리안츠선지급변액유니버설통합중신보험/(무)알리안츠VP멀티플변액유니버설통합중신보험/(무)알리안츠변액유니버설보험(방카)/(무)알리안츠변액중신보험PLUS/빅데이터국내주식형

※ 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 빅데이터국내주식형의 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 이스트스프링자산운용에 의하여 투자입금 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	빅데이터국내주식형		
금융투자협회 펀드코드	C2640		
펀드의 종류	변액보험, 일반형	최초설정일	2018.01.09
운용기간	2018.01.09 ~ 2018.03.31	존속기간	
자산운용회사	ABL생명보험	펀드재산보관회사	국민은행
판매회사	ABL생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	• 주식 및 주식관련 파생상품에 투자하고 유동성 확보를 위하여 채권 및 유동성 상품에 일부 투자합니다. 포트폴리오 전략은 빅데이터 분석 기법을 활용하여 선별된 종목에 투자하여 수익률을 달성하는 것을 목표로 합니다.		

▶ 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
빅데이터 국내주식형	자산 총액 (A)	0	5,524	0.00
	부채 총액 (B)	0	61	0.00
	순자산총액 (C=A-B)	0	5,463	0.00
	발행 수익증권 총 수 (D)	0	5,563	0.00
	기준가격 (E=C/D×1000)	0.00	982.05	0.00

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

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

지난 1분기 국내 증시는 코스피50지수 기준으로 3.52%, 코스피200지수 기준으로 3.12% 하락하였습니다. 연초 IMF, 세계은행 등이 주요국의 올해 경제성장을 전망치를 일제히 상향조정하면서 긍정적인 경기 모멘텀 속에 위험선호 국면이 이어졌습니다. 외국인 선물 대량 매수 유입과 글로벌 증시 강세가 동반되면서 조선, 기계, 건설 업종 및 코스닥을 중심으로 상승세가 나타났습니다. 하지만 1월 미국 임금상승을 호조로 연준의 금리 인상 가속화 우려 및 미국의 국제 발행 규모 증가 전망 등으로 미국 국제금리가 급등하면서 미 증시가 급락하였습니다. 국내 기업 실적도 조정 영향을 보였습니다. 3월 들

어 남북/북미 정상회담이 성사되며 한반도 경제에 급격한 진전이 이어졌고 한한령 해제 기대감으로 중국 소비 관련주가 강세를 보이면서 국내 증시는 낙폭을 줄이는 모습을 보였습니다.

펀드는 설정일인 1월 9일부터 1.80% 하락하며 시장 대비 낮은 하락 폭을 보였습니다. 펀드에서는 IT 및 금융 섹터에 대한 비중 조절, 소재 섹터에서의 종목 선택 및 헬스케어, 필수소비재, 산업재 등의 섹터에서의 자산 배분 효과로 인하여 시장 대비 하락 폭을 줄일 수 있었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

연초 이후 미 증시를 필두로 글로벌 증시 변동성이 크게 확대되면서 위험선호가 약화된 상황입니다. 글로벌 주요 증시 대비 국내 증시의 여닝 모멘텀 매력이 부각되지 않는 상황을 고려할 때, 국내 증시는 탄력적인 회복세보다는 위험선호 전반의 회복세에 따른 점진적 낙폭 회복 흐름을 예상합니다. 4~5월 남북/북미 정상회담이 진행되는 등 한반도 지정학적 리스크 완화 여건은 국내 증시 디스카운트 해소 요인으로 긍정적입니다. 하지만 미국의 통상 압박 및 4월 재무부 환율보고서 경계감 등으로 원화 강세가 지속될 가능성이 높습니다. 이에 따른 수출주 실적 영향이 2분기 실적 모멘텀 둔화로 반영될 수 있어 경계해야 할 것으로 판단합니다.

펀드에서는 필수소비재, 통신, 산업재에 대한 비중을 시장 대비 높게 유지하여 운용할 계획입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

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

※ 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
빅데이터국내주식형	-	-	-	-

※ 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	-83	0	0	0	5	0	0	0	0	3	-14	-90

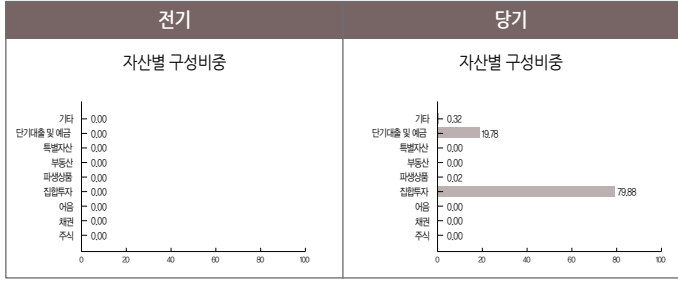
3. 자산현황

▶ 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)	4,412 (79.88)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1 (0.02)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,093 (19.78)	17 (0.32)	5,524 (100.00)
합계	4,412	0	0	0	1	0	0	0	0	1,093	17	5,524

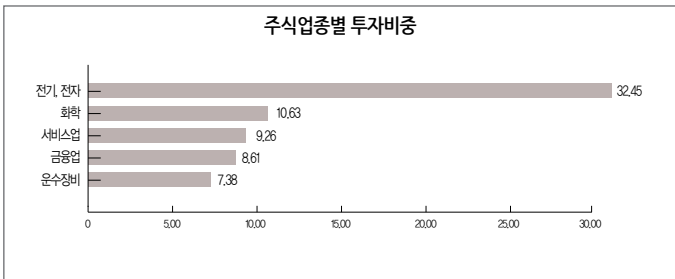
※ () : 구성비중



▶ **주식업종별 투자비중**

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기,전자	32.45	6	보험	5.22
2	화학	10.63	7	유통업	4.35
3	서비스업	9.26	8	KOSPI 미분류	4.21
4	금융업	8.61	9	전기가스업	4.01
5	운수장비	7.38	10	기타	13.88



▶ **투자대상 상위 10종목**

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	주식	삼성전자	19.02	6	주식	한국전력	3.20
2	단기상품	은대(국민은행)	14.35	7	주식	LG전자	2.56
3	파생상품	삼성전자 F201804 (10)	8.04	8	주식	삼성화재	2.33
4	단기상품	한국저금증개REPO매수(20180330)	5.43	9	주식	기아차	2.06
5	주식	KT&G	3.37	10	주식	LG생활건강	2.06

■ **각 자산별 보유종목 내역**

▶ **주식**

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	427	1,051	19.0	대한민국	KRW	전기, 전자	
KT&G	1,859	186	3.4	대한민국	KRW	KOSPI 미분류	
한국전력	5,387	177	3.2	대한민국	KRW	전기가스업	
LG전자	1,293	142	2.6	대한민국	KRW	전기, 전자	
삼성화재	475	128	2.3	대한민국	KRW	보험	
기아차	3,665	114	2.1	대한민국	KRW	운수장비	
LG생활건강	94	114	2.1	대한민국	KRW	화학	

※ 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재 또는 발행주식 총수의 1% 초과 종목

▶ **장내파생상품**

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
삼성전자 F201804 (10)	매수	18	444	

▶ **단기대출 및 예금**

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	국민은행	2018-01-09	792	1.15		대한민국	KRW
REPO매수	삼성증권	2018-03-30	300	1.69		대한민국	KRW

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

4. 투자운용전문인력 현황

▶ **투자운용인력(펀드매니저)**

(단위 : 개, 백만원)

성명	직위	나이	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
이현구	부사장	49	76	2,251,333	-	-	2111000044
정우진	차장	35	76	2,251,333	-	-	2111000336

※ 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임 운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함
 ※ 펀드의 투자운용인력 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고하실 수 있습니다. (인터넷 주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 현회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이 할 수 있습니다.

▶ **운용전문인력 변경내역**

기간	운용전문인력
2011.01.15~현재	이현구
2018.01.15~현재	정우진
2009.02.04~2018.01.12	남경은
2012.11.05~2016.04.22	오인철

5. 비용 현황

▶ **업자별 보수 지급현황**

(단위 : 백만원, %)

구분	전기		당기	
	금액	비율	금액	비율
자산운용사	0	0.00	3	0.06
판매회사	0	0.00	5	0.10
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00
보수합계	0	0.00	8	0.16
기타비용**	0	0.00	0	0.00
매매 중개수수료	단순매매 · 중개수수료	0	0	0.04
	조서분석업무 등 서비스수수료	0	0	0.00
	합계	0	2	0.04
증권거래세	0	0.00	4	0.08

※ 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	0.7274	0.1634	0.8908

※ 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 보수·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.

6. 투자자산매매내역

▶ **매매주식규모 및 회전을**

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매 회전을	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
66,716	5,782	14,103	1,291	31.53	140.34

※ 매매회전을이란 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가격으로 나눈 비율입니다. 매매회전이 높을수록 매매·중개수수료(0.1% 내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.