

A5004 글로벌인덱스RC

※ 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 글로벌인덱스RC의 자산운용회사인 ABL생명보험이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 우리은행의 확인을 받아 판매회사인 ABL생명보험을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 위탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 위탁된 날 이후 기간에 한합니다.
3. 자산은 이스트프링자산운용에 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	글로벌인덱스RC		
금융투자협회 펀드코드	AA502		
펀드의 종류	변액보험, 추가형, 종류형	최초설정일	2012.04.20
운용기간	2018.04.01 ~ 2018.06.30	존속기간	취항으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	ABL생명보험	펀드재산보관회사	우리은행
판매회사	ABL생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	<ul style="list-style-type: none"> • 국내외 주식 및 주식관련 파생상품, 주식형집합투자증권, 상장지수집합투자증권 등에 순자산(NAV)의 90%이내로 투자하고, 나머지는 채권 및 유동성자산에 투자하는 펀드입니다. 글로벌 주식 인덱스 수익률의 변동성에 따라 펀드 내 글로벌 주식 인덱스를 추종하는 기초자산의 투자비율을 주기적으로 조절합니다. • 일반적으로 변동성이 높을 때에는 펀드 내 글로벌 주식 인덱스를 추종하는 기초자산의 투자비율을 줄이고, 반대로 변동성이 낮을 때에는 글로벌 주식 인덱스를 추종하는 기초자산의 투자비율을 높이는 전략을 사용합니다. 		

▶ 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
글로벌인덱스RC	자산 총액 (A)	317,099	309,046	-2.54
	부채 총액 (B)	255	249	-2.21
	순자산총액 (C=A-B)	316,844	308,797	-2.54
	발행 수익증권 총 수 (D)	226,485	225,215	-0.56
	기준가격 (E=C/D×1000)	1,398.96	1,371.12	-1.99

※ 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

2018년 2분기 한국 및 홍콩증시는 전 분기 대비 하락, 미국증시는 상승 마감 하였습니다. 4월에는 미중 무역분쟁 및 중동 지정학적 리스크, 국제유가 상승에 따른 물가상승 및 장기금리 상승 우려가 증시 변동성 요인으로 작용하였습니다. 5월에 유로존 경기 모멘텀 약화가 지속되는 가운데 이탈리아와 스페인 정치 불안이 유로존 탈퇴 우려로 이어지며 유로화 약세가 두드러졌습니다. 상대적으로 미국의 경기 지표가 견조한 흐름을 보이는 가운데, 기타 통화 약세 영향으로 연초 이후 미달러 상승세가 상당히 강하게 지속되었고, 미국 발 무역분쟁 이슈 역시 이어지며 신흥국 증시는 대체로 부진하였습니다. 6월에는 미중 무역분쟁이 악화되며 글로벌 증시의 변동성이 확대되었습니다. 미국과 유럽의 금리차 확대, 달러 강세가 신흥국 통화 불안을 야기하며 선진국 대비 신흥국 지수가 큰 낙폭을 보였으며, 기업 실적 추경치는 선진시장에서는 미국만 개선세를 지속하였고, 신흥국 대부분은 하향 조정되었습니다.

지난 2분기 동 펀드의 수익률은 전분기 대비 -1.99% 기록하였으며, 같은 기간 KOSPI200지수는 -4.75%, HSCIE지수는 -7.71% 기록하였으며, S&P500지수는 2.93% 상승 하였습니다. 리스크 컨트롤 전략에 따른 각 지수의 투자 비중 조절이 변동성 국면이 지속되는 글로벌 시장 상황에 긍정적으로 기여하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

2018년 6월말 기준 펀드에서는 KOSPI200지수는 15.0% 수준, HSCIE지수는 25.0% 수준 S&P500 지수는 30.0% 수준으로 투자하고 있습니다. 펀드에서는 향후에도 각 주가 지수의 모멘텀과 변동성을 관찰하면서 리스크 컨트롤 전략에 따라 KOSPI200, HSCIE, S&P500 지수에 대한 편입비율을 조절하는 형태로 세 지수에 대한 투자를 지속할 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
글로벌인덱스RC	-1.99	-4.07	-1.33	1.93

※ 비교지수(벤치마크) : 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
글로벌인덱스RC	1.93	19.09	10.72	32.28

※ 비교지수(벤치마크) : 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	1,142	0	-9	-7,729	0	0	0	0	-38	385	-6,248
당기	0	1,106	0	-15	-8,216	0	0	0	0	622	132	-6,372

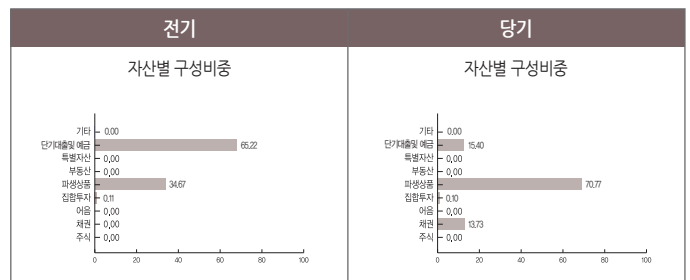
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합 투자	장내	장외		실물 자산	기타			
HKD (142.02)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	77,875 (25.20)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	5,161 (1.67)	0 (0.00)	83,037 (26.87)
USD (1114.50)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	94,109 (30.45)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	4,939 (1.60)	0 (0.00)	99,048 (32.05)
KRW (1.00)	0 (0.00)	42,418 (13.73)	0 (0.00)	316 (0.10)	46,725 (15.12)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	37,503 (12.13)	0 (0.00)	126,962 (41.08)
합계	0	42,418	0	316	218,709	0	0	0	0	47,603	0	309,046

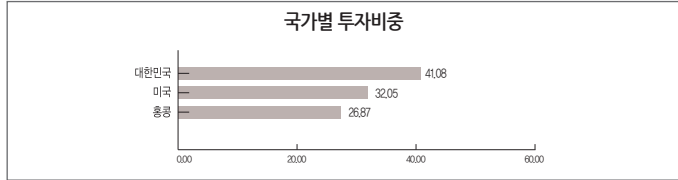
※ () : 구성비중



▶ 국가별 투자비중

(단위 : %)

순위	국가명	비중	순위	국가명	비중
1	대한민국	41.08	6		
2	홍콩	26.87	7		
3	미국	32.05	8		
4			9		
5			10		



주) 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다.

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	파생상품 S&P500 EMINI FUT SEP 18	30.45	6	채권 통안0150-1809-01	8.90
2	파생상품 H-SHARES IDX FUT JUL 18	25.20	7	채권 통안01950-1905-01	8.12
3	파생상품 코스피200 F 201809	15.12	8	채권 산금16신이0300-0111-2	5.52
4	채권 통안01900-1902-01	12.99	9	채권 통안0133-1810-02	5.19
5	채권 통안01960-1903-01	10.38	10	채권 통안0172-1812-02	5.02

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안01900-1902-01	40,000	40,135	대한민국	KRW	2018-02-09	2019-02-09		N/A	12.99
통안01960-1903-01	32,000	32,071	대한민국	KRW	2018-03-09	2019-03-09		N/A	10.38
통안0150-1809-01	27,500	27,520	대한민국	KRW	2017-09-09	2018-09-09		N/A	8.90
통안01950-1905-01	25,000	25,089	대한민국	KRW	2018-05-09	2019-05-09		N/A	8.12
산금16신이0300-0111-2	17,000	17,062	대한민국	KRW	2016-01-11	2019-01-11		AAA	5.52
통안0133-1810-02	16,000	16,041	대한민국	KRW	2016-10-02	2018-10-02		N/A	5.19
통안0172-1812-02	15,500	15,524	대한민국	KRW	2016-12-02	2018-12-02		N/A	5.02

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

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
S&P500 EMINI FUT SEP 18	매수	621	94,109	
H-SHARES IDX FUT JUL 18	매수	1,009	77,875	
코스피200 F 201809	매수	623	46,725	

※ 투자대상 상위 10종목 및 개별계약등의 위험평가액이 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	51	76	2,265,935	-	-	2111000044
차인식	차장	50	76	2,265,935	-	-	2118000653
이하경	과장	34	76	2,265,935	-	-	2118000654

※ 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임투자운용인력이며, '책임투자운용인력'이란 투자운용인력 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
2018.05.29 ~ 현재	차인식
2018.05.29 ~ 현재	이하경
2018.01.15 ~ 2018.05.28	정우진
2009.02.04 ~ 2018.01.12	남정은
2012.11.05 ~ 2016.04.22	오인철

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

구분	전기		당기		
	금액	비율	금액	비율	
자산운용사	165	0.05	157	0.05	
판매회사	355	0.11	339	0.11	
펀드재산보관회사(신탁업자)	9	0.00	8	0.00	
일반사무관리회사	16	0.00	15	0.00	
보수합계	545	0.16	520	0.16	
기타비용**	1	0.00	1	0.00	
매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	116	0.03	96	0.03
	조사분석업무 등 서비스수수료	0	0.00	0	0.00
	합계	116	0.03	96	0.03
증권거래세	0	0.00	0	0.00	

※ 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

※ 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 위탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외합니다.

※ 성과보수내역 : 해당 없음

※ 발행분담금내역 : 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위 : 연환산, %)

	총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
전기	0.6724	0.1014	0.7738
당기	0.6676	0.1185	0.7861

※ 총보수·비용비율(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.