

G1009 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 위탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 위탁된 날 이후 기간에 한합니다.
3. 자산은 이스트스프링자산운용에 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	빅데이터국내주식형		
금융투자협회 펀드코드	C2640		
펀드의 종류	변액보험, 일반형	최초설정일	2018.01.09
운용기간	2018.04.01 ~ 2018.06.30	존속기간	
자산운용회사	ABL생명보험	펀드재산보관회사	국민은행
판매회사	ABL생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	<ul style="list-style-type: none"> • 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)	5,524	6,060	9.71
	부채 총액 (B)	61	5	-91.72
	순자산총액 (C=A-B)	5,463	6,055	10.84
	발행 수익증권 총 수 (D)	5,563	6,546	17.68
	기준가격 (E=C/D×1000)	982.05	924.96	-5.81

※ 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 분기동안 국내 주식 시장은 하락하였습니다. 미중 무역분쟁 불확실성 및 증세의 지정학적 리스크 부각, 국제유가 상승에 따른 물가상승 및 장기금리 상승 우려, 이탈레스트 우려 등 대외 불확실성 요인이 부각되면서 하방 변동성이 확대되었습니다. 특히 미국은 500억 달러 규모의 중국산 제품에 대한 관세 부과 계획을 발표한 이후, 중국의 보복관세 발생시 추가로 2천억 달러 규모의 관세를 부과할 것을 경고하면서 글로벌 증시의 변동성은 분기 말까지 확대되는 모습을 보였습니다. 이에 따라 신흥국 주식형 펀드 내에서 자금 유출세가 심화되면서 국내 증시에서 외국인의 자금 유출이 확대되었습니다. 4월말 남북 정상회담, 6월초 북미 정상회담 등에도 불구하고 코리아 디스카운트 해소 및 남북 경협 기대감은 호재로 오래 작용하지는 못하였습니다. 국내 주식시장에서는 삼성바이오로직스 회계 감리 이슈, 현대차그룹의 지배구조 개편 불확실성, 은행 채용 비리 등으로 인하여 관련 업종이 약세를 보였습니다. 펀드에서는 산업계에서의 자산 배분과 헬스케어 업종에서의 중목선정 및 자산 배분이 부정적으로 작용하면서 분기 동안 시장 대비 부진한 성과를 보였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

대내외적으로 증시에 비우호적인 환경이 지속되는 상황입니다. 미국은 7월 6일부터 중국산 제품에 25% 관세 부과를 적용할 예정이며, 미중 무역분쟁 외에 유럽산 자동차 및 수입산 철강 등에 대한 관세 부과를 지속적으로 검토하고 있어 무역분쟁 이슈는 장기화될 가능성이 높습니다. 7월은 2분기 실적시

즌 본격적으로 시작하는 시기입니다. 최근 기업들의 2분기 실적 전망은 지속적으로 하향 조정되어, 실적에 대한 기대감은 낮은 상황입니다. 그러나 글로벌 경기 고점 논란에도 불구하고 한국 수출경기는 여전히 긍정적인 흐름을 유지하고 있고, 국내 증시는 신흥국 내에서 상대적으로 낮은 밸류에이션으로 매력도가 높아진 점은 긍정적인 요인입니다. 펀드에서는 IT, 헬스케어, 소재 섹터의 비중을 시장 대비 낮게 유지하고, 소비재, 산업재 및 통신 섹터를 시장 대비 높게 유지할 계획입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
빅데이터국내주식형	-5.81	-	-	-

※ 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	-83	0	0	0	5	0	0	0	0	3	-14	-90
당기	-334	0	0	0	-25	0	0	0	0	4	-14	-369

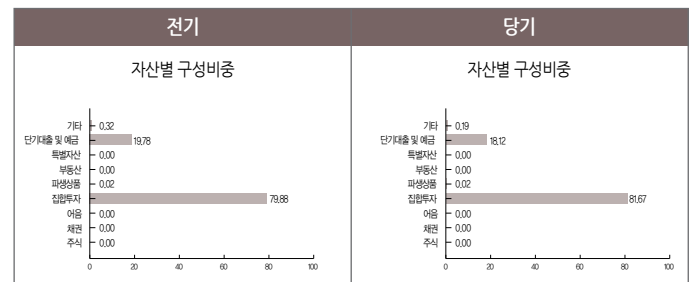
3. 자산현황

▶ 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)	4,949 (81.67)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1 (0.02)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,098 (18.12)	12 (0.19)	6,060 (100.00)
합계	4,949	0	0	0	1	0	0	0	0	1,098	12	6,060

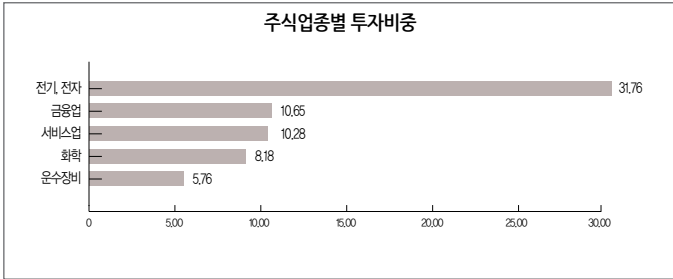
※ () : 구성비중



▶ **주식업종별 투자비중**

(단위: %)

업종명	비중	업종명	비중
1 전기, 전자	31.76	6 통신업	5.49
2 금융업	10.65	7 보험	4.91
3 서비스업	10.28	8 유통업	4.29
4 화학	8.18	9 KOSPI 미분류	3.86
5 운수장비	5.76	10 기타	14.82



▶ **투자대상 상위 10종목**

(단위: %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1 주식	삼성전자	18.93	6 주식	SK텔레콤	2.87
2 단기	은대(국민은행)	13.17	7 주식	삼성SDI	2.53
3 파생상품	삼성전자 F201807 (10)	6.94	8 주식	아모레퍼시픽	2.42
4 단기	KIDB재금융개REPO매수(20180629)	4.95	9 주식	LG전자	2.10
5 주식	KT&G	3.15	10 주식	삼성화재	2.08

■ **각 자산별 보유종목 내역**

▶ **주식**

(단위: 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	24,589	1,147	18.9	대한민국	KRW	전기, 전자	
KT&G	1,785	191	3.2	대한민국	KRW	KOSPI 미분류	
SK텔레콤	747	174	2.9	대한민국	KRW	통신업	
삼성SDI	716	153	2.5	대한민국	KRW	전기, 전자	
아모레퍼시픽	454	146	2.4	대한민국	KRW	화학	
LG전자	1,532	127	2.1	대한민국	KRW	전기, 전자	
삼성화재	478	126	2.1	대한민국	KRW	보험	

※ 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 F201807 (10)	매수	900	420	

▶ **단기대출 및 예금**

(단위: 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	국민은행	2018-01-09	797	1.15		대한민국	KRW
REPO매수	삼성증권	2018-06-29	300	1.77		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	부서장	51	76	2,265,935	0		2111000044
차인식	차장	50	76	2,265,935	0		2118000653
이하경	과장	34	76	2,265,935	0		2118000654

※ 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, 협회 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	3	0.06	4	0.06	
판매회사	5	0.10	7	0.11	
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수합계	8	0.16	11	0.18	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매 중개수수료	단순매매 · 중개수수료	2	0.04	1	0.02
	조사분석업무 등 서비스수수료	0	0.00	0	0.00
	합계	2	0.04	1	0.02
증권거래세	4	0.08	4	0.06	

※ 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

※ 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외함 것입니다.

※ 성과보수내역: 없음

※ 발행분담금내역: 없음

▶ **총보수, 비용비율**

(단위: 연환산, %)

	총보수 · 비용비율(A)	매매 · 중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
전기	0.7274	0.1634	0.8908
당기	0.7275	0.1136	0.8411

※ 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.

6. **투자자산매매내역**

▶ **매매주식규모 및 회전을**

(단위: 백만원, %)

매수		매도		매매 회전을	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
23,444	2,062	14,476	1,180	24.47	98.13

※ 매매회전을이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유된 주식의 평균가액으로 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: %)

2017-10-09 ~ 2018-01-08	2018-01-09 ~ 2018-03-31	2018-04-01 ~ 2018-06-30
0.00	29.83	24.47