

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	2018.07.01 ~ 2018.09.30	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)	6,060	6,120	0.99
	부채 총액 (B)	5	12	129.58
	순자산총액 (C=A-B)	6,055	6,108	0.88
	발행 수익증권 총 수 (D)	6,546	6,568	0.33
	기준가격 (E=C/D×1000)	924.96	930.02	0.55

* 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 분기에 미중 무역 분쟁 이슈 장기화, 미국의 경제지표 호조에 따른 금리 인상 가속화에 대한 우려, 외국계 증권사의 반도체 업황 둔화에 대한 경고 등은 평가 기간 내내 국내 주식시장의 부담 요인으로 작용하였습니다. 하지만 미국-멕시코-캐나다간의 무역협상 성공, 국내 8월 및 9월 수출 지표 호조, 북미정상회담에 대한 기대감 증가에 따른 지정학적 리스크 감소 등이 투자심리에 긍정적인 영향을 주면서 국내 주식 시장은 소폭 상승하였습니다.

지난 분기 펀드는 0.55%의 성과를 달성하면서 벤치마크지수 대비 양호한 성과를 달성하였습니다. 금융과 경기소비재 섹터에서의 종목 선택과 에너지와 산업재 섹터에서의 자산 배분이 펀드 성과에 긍정적인 영향을 주었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

국내 주식 시장은 대내외적인 다양한 변동성 요인으로 인하여 불확실성이 높은 환경에 놓일 것으로 보입니다. 미국의 금리 인상 지속과 양호한 경제지표는 달러화 강세 요인이지만, 10월 재무부의 환율 보고서 발표가 예정되어 있는 점을 감안할 때 달러화의 향방에 대한 불확실성이 높은 편입니다. 미국과 중국의 무역 분쟁이 관세 부과 외의 다른 영역으로 확대되는 모습을 보이는 점, 국내 기준금리 인상 여부 및 높은 가계 부채 수준, 재정 건정성이 낮은 신흥 국가의 위험 지표와 글로벌 자금 흐름도 투자심리에 영향을 줄 수 있는 만큼 대내외 상황에 대한 면밀한 관찰이 필요할 것입니다.

펀드에서는 매월 초 빅데이터 분석에 근거하여 포트폴리오 내 보유 주식에 대한 리밸런싱을 실시하고 월 3회 중소형주 빅데이터 전략을 추가하여 리밸런싱을 실시할 계획입니다. 다음 분기에는 산업재, 필수소비재, 금융 등의 비중을 전 분기 대비 확대할 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
빅데이터국내주식형	0.55	-5.30	-	-

* 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	-332	0	0	0	-25	0	0	0	0	4	-15	-369
당기	46	0	0	9	-3	0	0	0	0	3	-22	33

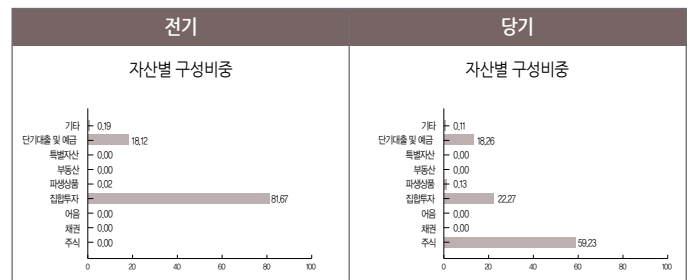
3. 자산현황

▶ 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)	3,625 (59.23)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,363 (22.27)	8 (0.13)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,117 (18.26)	7 (0.11)	6,120 (100.00)
합계	3,625	0	0	1,363	8	0	0	0	0	1,117	7	6,120

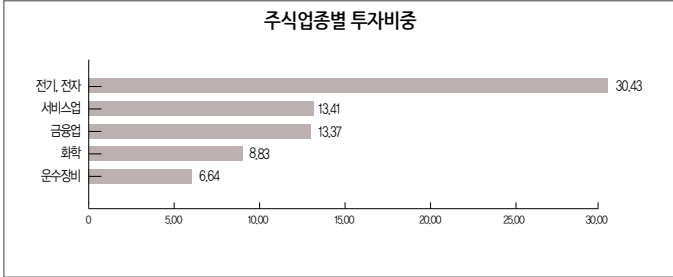
* () : 구성비중



▶ **주식업종별 투자비중**

(단위 : %)

업종명	비중	업종명	비중
1 전기전자	30.43	6 철강및금속	4.78
2 서비스업	13.41	7 보험	4.48
3 금융업	13.37	8 통신업	4.03
4 화학	8.83	9 유통업	3.94
5 운수장비	6.64	10 기타	10.09



▶ **투자대상 상위 10종목**

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1 주식	삼성전자	15.39	6 주식	SK이노베이션	2.92
2 단기	은대(국민은행)	11.72	7 주식	기아차	2.15
3 집합투자증권	TIGER 코스닥150	11.18	8 주식	NAVER	2.12
4 집합투자증권	KODEX 코스닥 150	11.10	9 주식	한국전력	2.11
5 단기	KDB저금증기REPO매수(20180928)	6.54	10 주식	KT	1.58

■ **각 자산별 보유종목 내역**

▶ **주식**

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	20,277	942	15.4	대한민국	KRW	전기전자	
SK이노베이션	831	179	2.9	대한민국	KRW	금융업	
기아차	3,743	131	2.2	대한민국	KRW	운수장비	
NAVER	181	130	2.1	대한민국	KRW	서비스업	
한국전력	4,409	129	2.1	대한민국	KRW	전기가사업	

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

▶ **집합투자증권**

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
TIGER 코스닥150	수익증권	미래에셋자산운용	684	684	대한민국	KRW	11.18
KODEX 코스닥 150	수익증권	삼성자산운용	682	679	대한민국	KRW	11.10

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

▶ **장내파생상품**

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
삼성전자 F201810 (10)	매수	840	390	

▶ **단기대출 및 예금**

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	국민은행	2018-01-09	716	1.15		대한민국	KRW
REPO매수	삼성증권	2018-09-28	400	1.92		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 일임계약운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
이현구	부서장	51	76	2,305,168	0		2111000044
차인식	차장	50	76	2,305,168	0		2118000653
이하경	과장	34	76	2,305,168	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	4	0.06	4	0.06	
판매회사	7	0.11	7	0.11	
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수합계	11	0.18	11	0.18	
기타비용	0	0.00	0	0.00	
매매 중개수수료	단순매매 · 중개수수료	1	0.02	2	0.04
	조사분석업무 등 서비스수수료	0	0.00	0	0.00
	합계	1	0.02	2	0.04
증권거래세	4	0.06	9	0.15	

※ 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

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

※ 성과보수내역 : 없음

※ 발행보증금내역 : 없음

▶ **총보수, 비용비율**

(단위 : 연환산, %)

	총보수 · 비용비율(A)	매매 · 중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
전기	0.7275	0.1136	0.8411
당기	0.7275	0.1311	0.8586

※ 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
17,931	1,634	40,381	2,996	65.72	260.75

※ 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 : %)

2018-01-01 ~ 2018-03-31	2018-04-01 ~ 2018-06-30	2018-07-01 ~ 2018-09-30
34.34	24.47	65.72