

G1009 빅데이터국내주식형

※ 공지 사항

1. 자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특장기간(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 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	2018.10.01 ~ 2018.12.31	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)	6,120	5,352	-12.55
	부채 총액 (B)	12	3	-71.34
	순자산총액 (C=A-B)	6,108	5,348	-12.44
	발행 수익증권 총 수 (D)	6,568	6,477	-1.38
	기준가격 (E=C/D×1000)	930.02	825.69	-11.22

※ 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

미국과 중국간의 무역 분쟁이 지속되는 가운데, APEC에서의 공동성명서 채택 무산 및 화웨이 CFO 체포 등으로 향후 무역 협상에 대한 우려가 확대되었습니다. 미국에서는 장단기 금리가 역전되고 기술주 중심으로 조정세가 나타나면서 기업 실적 둔화 및 경기 둔화에 대한 불안감이 확산되었습니다. 유럽에서는 정치적인 불확실성이 증가하는 가운데 주요 경제 지표의 부진이 지속되는 모습을 보였습니다. 11월 금융위에서는 1년 만에 기준금리를 인상하였습니다. 펀드에서는 IT, 소재, 유틸리티 섹터에서의 종목선택과 자산배분이 긍정적으로 작용하면서 시장 대비 낮은 폭으로 하락하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

국내 기업의 이익 추정치가가파르게 하락하는 모습을 보이고 있어 저평가 매력력이 부각되기는 쉽지 않은 환경입니다. 미국의 정치적 불확실성이 높아지는 가운데, 미국과 중국간의 무역 협상 진행 상황은 향후 투자 심리를 결정하는 주된 요인으로 작용할 것으로 보입니다. 다만, 글로벌 경기 둔화에 대한 우려 증가로 인하여 중국의 추가적인 경기부양책 도입, 미 연준의 금리인상 속도 조절 가능성이 제기되고 있는 점은 긍정적인 요인입니다.

펀드에서는 매 10영업일마다 중소형주 빅데이터 전략을 검토하여 리밸런싱을 진행하고 있습니다. 1월 초에는 지난 한 달간의 빅데이터 분석을 통해서 포트폴리오 전체에 대한 리밸런싱을 실시하였습니다. 섹터별로는 필수소비재, 커뮤니케이션, 소재 섹터의 비중을 축소하였고, 헬스케어와 금융 섹터의

비중을 확대하였습니다. 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
밸류고배당주식FOFS (비교지수 대비 성과)	-11.22	-10.73	-15.92	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

※ 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
빅데이터국내주식형 (비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

※ 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			
전기	46	0	0	9	-3	0	0	0	3	-22	33
당기	-403	0	0	-240	-26	0	0	0	3	-14	-680

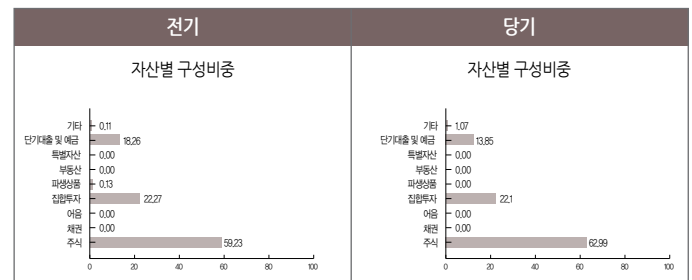
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

구분	증권			파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합 투자	장내		장외	실물 자산			
KRW (1.00)	3,371 (62.99)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,183 (22.10)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	741 (13.85)	57 (1.07)	5,352 (100.00)
합계	3,371	0	0	1,183	0	0	0	0	741	57	5,352

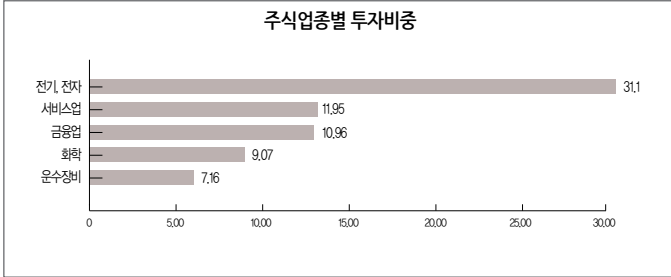
※ () : 구성비중



▶ **주식업종별 투자비중**

(단위 : %)

업종명	비중	업종명	비중
1 전기전자	31.10	6 보험	5.61
2 서비스업	11.95	7 유통업	4.82
3 금융업	10.96	8 KOSPI 미분류	4.52
4 화학	9.07	9 철강및금속	4.29
5 운수장비	7.16	10 기타	10.52



▶ **투자대상 상위 10종목**

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1 집합투자증권	TIGER 200	22.10	6 주식	한국전력	2.21
2 주식	삼성전자	15.70	7 주식	기아차	1.82
3 단기상품	은대(국민은행)	8.24	8 주식	삼성화재	1.75
4 단기상품	KDB저금증개REPO매수(20181231)	5.61	9 주식	SK	1.67
5 주식	KT&G	2.85	10 주식	KT	1.62

■ **각 자산별 보유종목 내역**

▶ **주식**

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	21,716	840	15.7	대한민국	KRW	전기전자	
KT&G	1,501	152	2.9	대한민국	KRW	KOSPI 미분류	
한국전력	3,566	118	2.2	대한민국	KRW	전기가공업	
기아차	2,891	97	1.8	대한민국	KRW	운수장비	
삼성화재	348	94	1.8	대한민국	KRW	보험	
SK	343	89	1.7	대한민국	KRW	금융업	
KT	2,912	87	1.6	대한민국	KRW	통신업	

* 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 200	수익증권	미래에셋자산운용	1,191	1,183	대한민국	KRW	22.10

* 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	2018-01-09	440	1.38		대한민국	KRW
REPO매수	삼성증권	2018-12-31	300	1.96		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	78	2,226,717	-	-	2111000044
차인식	차장	50	78	2,226,717	-	-	2118000653
이하경	과장	34	78	2,226,717	-	-	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	3	0.06	
판매회사	7	0.11	6	0.11	
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수합계	11	0.18	10	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	9	0.15	3	0.05	

* 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	0.7275	0.1311	0.8586
당기	0.7276	0.122	0.8496

* 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균잔액(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
13,986	1,207	10,796	1,001	28.91	114.71

* 매매회전을이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율입니다. 매매회전이 높을수록 매매거래수수료(0.1% 내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ **최근 3분기 주식 매매회전을 추이**

(단위 : %)

2018-04-01 ~ 2018-06-30	2018-07-01 ~ 2018-09-30	2018-10-01 ~ 2018-12-31
24.47	65.72	28.91