

# 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 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	
펀드명칭	빅데이터국내주식형
금융투자협회 펀드코드	C2640
펀드의 종류	변액보험, 추가형 일반형
운용기간	2021.04.01 ~ 2021.06.30
자산운용회사	ABL생명보험
판매회사	ABL생명보험
상품의 특징	주식 및 주식관련 파생상품에 투자하고 유동성 확보를 위하여 채권 및 유동성 상품에 일부 투자합니다. 포트폴리오 전략은 빅데이터 분석 기법을 활용하여 종목을 선별하여 투자하며 벤치마크 대비 초과 수익률을 달성하는 것을 목표로 합니다.

### ▶ 재산 현황

아래 표를 통하여 당기말과 전기말 간의 자산총액, 부채총액, 순자산총액 및 기준가격의 추이를 비교하실 수 있습니다.  
 (단위: 백만원, 백만원, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
빅데이터국내주식형	자산 총액 (A)	8,349	8,700	4.20
	부채 총액 (B)	18	5	-71.11
	순자산총액 (C=A-B)	8,332	8,695	4.37
	발행 수익증권 총수 (D)	6,467	6,407	-0.92
	기준가격 (E=C/D × 1000)	1,288.31	1,357.11	5.34

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

## 2. 운용경과 및 수익률현황

### ▶ 운용경과

지난 분기 동안 펀드는 시장 지수 대비 양호한 성과를 거두었습니다. 미국 연준의 완화적인 통화정책 기조가 유지되는 가운데, 국내의 경제지표 개선은 주식 시장에 긍정적으로 작용하였습니다. 백신 접종 증가에 따른 국내외 경기 개선으로 주요 기업의 실적 회복세가 지속되었습니다. 공급 병목현상에 따른 인플레이션 우려가 축소되고 국내 경제성장률 전망이 상당히 긍정적 증가와 코로나 변이 바이러스 확산에 대한 우려는 분기 후반 조정 요인으로 작용하였습니다. 펀드에서는 6월 시장 지수의 경기 변경에 따라 종목 교체를 실시하였습니다. 섹터별로는 소재, 금융 등의 섹터에서 자산 배분과 종목 선택이 성과에 긍정적으로 작용하였습니다.

### ▶ 투자환경 및 운용 계획

빠른 백신 보급과 바이든 정부의 인프라 투자 등 주요국 정부의 재정 지출 계획 등은 주식 시장에 긍정적으로 작용할 것입니다. 고용 회복에는 다소 시간이 걸릴 수 있겠으나 큰 이변이 없는 한 회복 기조를 이어갈 것으로 예상합니다. 다만, 장기간 이어진 국내 주식 시장의 상승 피로감 및 코로나 델타 변이로 인한 재유행 우려 등이 중시 상단을 제한할 수 있는 요인으로 작용할 것으로 예상됩니다. 펀드에서는 매일 빅데이터 분석을 통해 포트폴리오를 조정하여 운용할 계획입니다.

### ▶ 기간(누적)수익률

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
빅데이터국내주식형	5.34	12.13	36.55	46.90

※ 비교지수(벤치마크): (주)동 펀드는 벤치마크를 적용하지 않습니다.  
 \* 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
빅데이터국내주식형	46.90	53.40	46.72	-

※ 비교지수(벤치마크): (주)동 펀드는 벤치마크를 적용하지 않습니다.  
 \* 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

### ▶ 손익현황

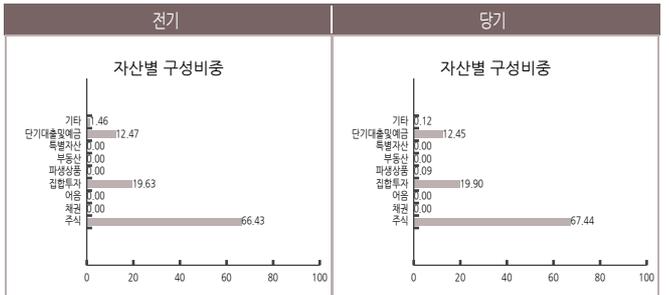
구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익 합계
	주식	채권	어음	기타	장내	장외		실물 자산	기타			
전기	460	0	0	83	1	0	0	0	0	1	-19	525
당기	331	0	0	131	0	0	0	0	0	1	-19	443

## 3. 자산현황

### ▶ 자산구성현황

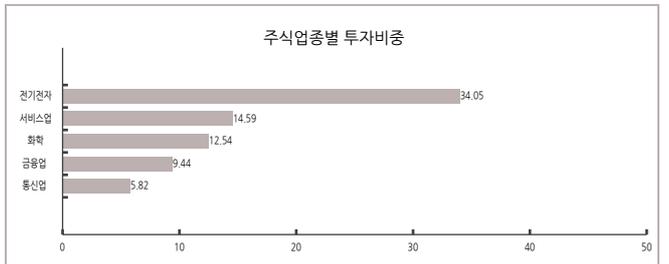
구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	기타	장내	장외		실물 자산	기타			
KRW	5,867	0	0	1,732	8	0	0	0	0	1,083	11	8,700
(1.00)	(67.44)	(0.00)	(0.00)	(19.90)	(0.09)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(12.45)	(0.12)	(100.00)
합계	5,867	0	0	1,732	8	0	0	0	0	1,083	11	8,700

※ ( ): 구성비중



### ▶ 주식업종별 투자비중

업종명	비중	업종명	비중
1 전기전자	34.05	6 보험	3.93
2 서비스업	14.59	7 운수경비	3.29
3 화학	12.54	8 유통업	3.13
4 금융업	9.44	9 의약품	2.80
5 통신업	5.82	10 기타	10.41



※ 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다

### ▶ 투자대상 상위 10종목

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	주식 삼성전자	16.22	6	주식 LG생활건강	2.51
2	집합투자증권 TIGER코스닥150	10.02	7	주식 삼성물산	2.11
3	집합투자증권 KODEX코스닥150	9.88	8	주식 LG전자	2.04
4	단기상품 연대(국민은행)	9.00	9	주식 SK텔레콤	1.89
5	단기상품 KDB저금증(개별EPO매수20210630)	3.45	10	주식 신한지주	1.86

## ■ 각 자산별 보유종목 내역

구분	종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
	삼성전자	17,488	1,411	16.22	대한민국	KRW	전기전자	

LG생활건강	124	218	2.51	대한민국	KRW	화학
삼성물산	1,345	184	2.11	대한민국	KRW	유통업
LG전자	1,086	178	2.04	대한민국	KRW	전기전자
SK텔레콤	513	164	1.89	대한민국	KRW	통신업
신한지주	3,996	162	1.86	대한민국	KRW	금융업

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

▶ **집합투자증권** (단위: 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
TIGER코스닥150	수익증권	839	872	대한민국	KRW	10.02
KODEX코스닥150	수익증권	827	860	대한민국	KRW	9.88

※ 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	783	0.23	-	대한민국	KRW
REPO매수	삼성증권	2021-06-30	300	0.67	-	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	
최미영	부서장	42	81	2,633,760	-	-	2119000125
이대석	차장	39	81	2,633,760	-	-	2120001220
김태현	과장	38	81	2,633,760	-	-	2119000109

※ 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. (인터넷주소: <http://dcs.kofia.or.kr>) 단, 현회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▶ **운용전문인력 변경내역**

기간	운용전문인력
2019.01.25 ~ 현재	최미영
2020.09.17 ~ 현재	이대석
2019.01.24 ~ 현재	김태현

5. 비용 현황

▶ **업자별 보수 지급현황** (단위: 백만원, %)

구분	전기		당기		
	금액	비율	금액	비율	
자산운용사	5	0.06	5	0.06	
판매회사	9	0.11	10	0.11	
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수합계	15	0.18	15	0.18	
기타비용	0	0.00	0	0.00	
매매 중개수수료	단순매매 중개수수료	2	0.03	1	0.02
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
	합계	2	0.03	1	0.02
증권거래세	2	0.03	2	0.02	

※ 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

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

※ 성과보수내역: 해당 없음

※ 발행분담금내역: 해당 없음

▶ **총보수, 비용비율** (단위: 연환산, %)

	총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
전기	0.7273	0.1029	0.8302
당기	0.7271	0.0998	0.8269

※ 총보수비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평잔액(보수비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총보수비용수준을 나타냅니다.

※ 매매 중개수수료 비율이란 매매 중개수수료를 순자산 연평잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매 중개수수료의 수준을 나타냅니다.

6. 투자자산매매내역

▶ **매매주식규모 및 회전율** (단위: 백만원, %)

매수		매도		매매 회전율	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
7,924	928	12,542	929	15.98	64.11

※ 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율입니다. 매매 회전율이 높을 경우 매매거래수수료(0.1% 내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ **최근 3분기 매매회전율 추이** (단위: %)

2020-10-01 ~ 2020-12-31	2021-01-01 ~ 2021-03-31	2021-04-01 ~ 2021-06-30
28.45	18.21	15.98