

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 이스포츠프링자산운용에 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 금융투자법에 관한 법률

| | | | |
|-------------|---|----------|-------------------|
| 펀드명칭 | 빅데이터국내주식형 | | |
| 금융투자협회 펀드코드 | C2640 | 고난도펀드 여부 | 해당하지 않음 |
| 펀드의 종류 | 변액보험, 추가형, 일반형 | 최초설정일 | 2018.01.09 |
| 운용기간 | 2022.01.01 ~ 2022.03.31 | 존속기간 | 추가형으로 별도의 존속기간 없음 |
| 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 증득을 선택하여 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, 백만좌, %)

| 펀드명칭 | 항목 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-----------|---------------------|----------|----------|-------|
| 빅데이터국내주식형 | 자산 총액 (A) | 7,940 | 7,237 | -8.86 |
| | 부채 총액 (B) | 6 | 10 | 54.30 |
| | 순자산총액 (C=A-B) | 7,934 | 7,227 | -8.91 |
| | 발행 수익증권 총수 (D) | 6,232 | 6,214 | -0.29 |
| | 기준가격 (E=C/D × 1000) | 1,273.11 | 1,163.12 | -8.64 |

※ 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 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 국내 주식 시장은 하락하였습니다. 오미크론 확산 우려, 러시아와 우크라이나 관련 지정학적 리스크 지속, 원자재 가격 상승에 따른 물가 상승세 지속, 예상보다 빠른 국내의 통화정책 정상화 가능성 증가 등은 주식 시장에 부정적인 영향을 주었습니다. 수급 측면에서는 대형 중목 상장화 한국은행의 기준금리 인상으로 불안정성이 높아지는 모습을 보였습니다. 3월 미국 연준이 예상에 부합하는 수준의 기준금리 상승을 인성하며 시장이 안도하였으나, 이후 연준의 긴축 속도를 가속화할 것으로 전망되면서 시장의 불확실성이 지속되는 모습을 보였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

러시아와 우크라이나의 지정학적 리스크가 지속되는 가운데, 물가 상승에 대한 우려 및 주요 중앙은행의 기준금리 인상 가속화 여부 등은 시장의 불확실성을 유지시키는 요인으로 작용할 것입니다. 또한 우호적이지 않은 매크로 환경에서 주요 기업들의 실적 발표 결과도 투자 심리에 영향을 줄 것으로 예상됩니다. 펀드에서는 매일 보유 종목에 대한 빅데이터 분석을 통해서 포트폴리오를 조절하여 자산을 운용할 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 12개월 |
|-----------|--------|--------|--------|---------|
| 빅데이터국내주식형 | -8.64 | -8.91 | -14.29 | -9.72 |

※ 비교자수(벤치마크) : (주)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 | -9.72 | 47.96 | 31.73 | - |

※ 비교자수(벤치마크) : (주)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 | 장내 | 장외 | | 실물 자산 | 기타 | | | |
| 전기 | -43 | - | - | 17 | 14 | - | - | - | 2 | -18 | -29 |
| 당기 | -365 | - | - | -282 | -24 | - | - | - | 2 | -16 | -685 |

| 구분 | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 | 부동산 | 실물 자산 | 기타 | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산 총액 |
|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|--------|----------|
| KRW | 4,719 | 0 | 0 | 1,459 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 965 | 94 | 7,237 |
| (1.00) | (65.21) | (0.00) | (0.00) | (20.16) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (13.33) | (1.30) | (100.00) |
| 합 계 | 4,719 | 0 | 0 | 1,459 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 965 | 94 | 7,237 |

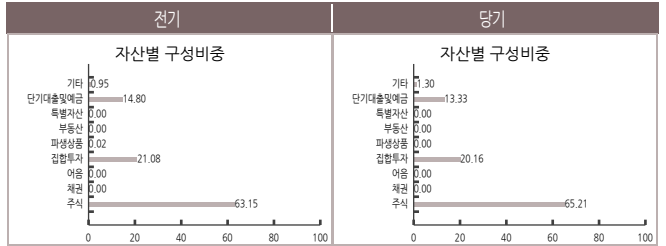
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산 총액 |
|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|--------|----------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 | | 실물 자산 | 기타 | | | |
| KRW | 4,719 | 0 | 0 | 1,459 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 965 | 94 | 7,237 |
| (1.00) | (65.21) | (0.00) | (0.00) | (20.16) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (13.33) | (1.30) | (100.00) |
| 합 계 | 4,719 | 0 | 0 | 1,459 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 965 | 94 | 7,237 |

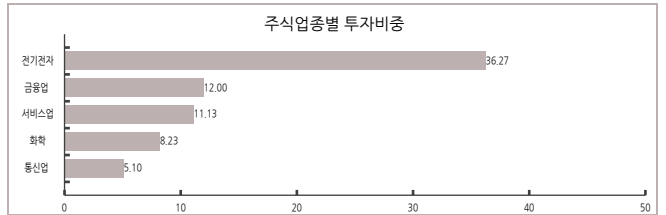
※ () : 구성비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

| 구분 | 업종명 | 비중 | 구분 | 업종명 | 비중 |
|----|------|-------|----|------|-------|
| 1 | 전기전자 | 36.27 | 6 | 의약품 | 4.60 |
| 2 | 금융업 | 12.00 | 7 | 보험 | 3.83 |
| 3 | 서비스업 | 11.13 | 8 | 유통업 | 2.84 |
| 4 | 화학 | 8.23 | 9 | 운수경비 | 2.75 |
| 5 | 통신업 | 5.10 | 10 | 기타 | 13.25 |



※ 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

| 구분 | 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 구분 | 종목명 | 비중 |
|----|--------|-------------------------|-------|----|----|-------|------|
| 1 | 주식 | 삼성전자 | 17.78 | 6 | 주식 | 신한주 | 1.94 |
| 2 | 단기상품 | 은대(국민은행) | 10.56 | 7 | 주식 | 삼성물산 | 1.85 |
| 3 | 집합투자증권 | TIGER코스닥150 | 10.18 | 8 | 주식 | SK텔레콤 | 1.82 |
| 4 | 집합투자증권 | KODEX코스닥150 | 9.98 | 9 | 주식 | KT&G | 1.76 |
| 5 | 단기상품 | KDB지금중7REPO매수(20220331) | 2.76 | 10 | 주식 | SK | 1.74 |

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

(단위 : 주, 백만원, %)

| 종목명 | 보유수량 | 평가금액 | 비중 | 발행국가 | 통화 | 업종 | 비고 |
|-------|--------|-------|-------|------|-----|-----------|----|
| 삼성전자 | 18,491 | 1,287 | 17.78 | 대한민국 | KRW | 전기전자 | |
| 신한지주 | 3,377 | 140 | 1.94 | 대한민국 | KRW | 금융업 | |
| 삼성물산 | 1,177 | 134 | 1.85 | 대한민국 | KRW | 유통업 | |
| SK텔레콤 | 2,309 | 131 | 1.82 | 대한민국 | KRW | 통신업 | |
| KT&G | 1,581 | 128 | 1.76 | 대한민국 | KRW | KOSPI 미분류 | |
| SK | 519 | 126 | 1.74 | 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 | 설정일 | 보유수량 | 평가금액 | 발행국가 | 통화 | 비중 |
|-------------|------|-----|------|------|------|-------|----|
| TIGER코스닥150 | 수익증권 | 705 | 737 | 대한민국 | KRW | 10.18 | |
| KODEX코스닥150 | 수익증권 | 691 | 722 | 대한민국 | KRW | 9.98 | |

※ 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 | 764 | 0.92 | - | 대한민국 | KRW |
| REPO매수 | 삼성증권 | 2022-03-31 | 200 | 1.39 | - | 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 | |
| 최미영 | 부서장 | 43 | 81 | 2,479,256 | - | - | 2119000125 |
| 이대석 | 차장 | 40 | 81 | 2,479,256 | - | - | 2120001220 |
| 김태현 | 과장 | 39 | 81 | 2,479,256 | - | - | 2119000109 |
| 윤유라 | 대리 | 30 | 81 | 2,479,256 | - | - | 2121001284 |

※ 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://dis.kofia.or.kr>) 단, 현회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 적성기준일이 상이할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

| 기간 | 운용전문인력 |
|-----------------|--------|
| 2019.01.25 ~ 현재 | 최미영 |
| 2020.09.17 ~ 현재 | 이대석 |
| 2019.01.24 ~ 현재 | 김태현 |
| 2021.07.16 ~ 현재 | 윤유라 |

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 백만원, %)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | |
|----------------|------------------|------|------|------|------|
| | 금액 | 비율 | 금액 | 비율 | |
| 자산운용사 | 5 | 0.06 | 4 | 0.06 | |
| 판매회사 | 9 | 0.11 | 8 | 0.11 | |
| 펀드재산보관회사(신탁업자) | 0 | - | 0 | - | |
| 일반사무관리회사 | 0 | - | 0 | - | |
| 보수합계 | 14 | 0.18 | 13 | 0.18 | |
| 기타비용 | 0 | - | 0 | - | |
| 매매 중개수수료 | 단순매매 중개수수료 | 1 | 0.02 | 2 | 0.02 |
| | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0 | - | 0 | - |
| | 합계 | 1 | 0.02 | 2 | 0.02 |
| 증권거래세 | 3 | 0.04 | 1 | 0.01 | |

※ 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

※ 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 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 | 0.7269 | 0.0784 | 0.8053 |
| 당기 | 0.7269 | 0.0732 | 0.8001 |

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

※ 매매 중개수수료 비율이란 매매 중개수수료를 순자산 연평균액(보수비용 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 |
| 4,109 | 515 | 9,391 | 431 | 9.11 | 36.93 |

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

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위: %)

| 2021-07-01 ~ 2021-09-30 | 2021-10-01 ~ 2021-12-31 | 2022-01-01 ~ 2022-03-31 |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 14.74 | 23.05 | 9.11 |

7. 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 유동성 위험 등 운용관련 주요 위험 현황

가. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

- 시장위험 및 개별증권위험: 이 투자신탁은 집합투자증권, 주식, 채권 등 증권에 투자함으로써 개별 증권 가격 변동 및 기타 거시경제지표의 변화에 따른 위험에 노출됩니다. 또한 예상하지 못한 정치경제상황 등도 운용에 영향을 미칠 수 있으며, 이에 따른 투자원금 손실이 발생할 수 있습니다.

- 유동성 위험: 이 투자신탁에서 투자하는 증권 시장의 시장규모 등을 감안할 때 거래량이 풍부하지 못한 종목에 투자하는 경우 유동성 부족에 따른 환금성 제약이 발생할 수 있으며, 이로 인한 환매 연기나 거래비용 증가 등으로 기회비용 발생과 함께 투자원금 손실이 발생할 수 있습니다.

▶ 주요 위험 관리 방안

가. 펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 등

- 신탁약관 및 법규에 따라 투자한도 및 모든 법적 규제 등이 철저히 준수되도록 관리 되고 있으며, 내부 투자 가이드라인에 의거하여 투자 전략의 점검, 성과 측정과 위험 관리가 이루어지고 있습니다.

나. 재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한과 수단 등
 해당사항 없음

▶ 주요 비상대응계획

- 재해 등의 위기상황 발생 시 리스크 관리, 투자자산 모니터링 등 회사의 주요 기능이 계속 수행 될 수 있도록 사업연속성계획(BCP)을 마련하고 있습니다.