

# A5004 글로벌인덱스RC

## ※ 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 글로벌인덱스RC의 자산운용회사인 ABL생명보험이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 우리은행의 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 금융투자업에 관한 법률			
펀드명칭	글로벌인덱스RC		
금융투자협회 펀드코드	AA502	고난도펀드 여부	해당하지 않음
펀드의 종류	변액보험 변액보험, 개방형, 추가형, 종류형	최초설정일	2012.04.20
운용기간	2023.10.01 ~ 2023.12.31	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간 없음
자산운용회사	ABL생명보험	펀드재산보관회사	우리은행
판매회사	ABL생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	국내의 주식 및 파생상품, 주식형집합투자증권, 상장지수집합투자증권 등 에 순자산(NAV)의 90%이내로 투자하고, 나머지는 채권 및 유동성자산에 투자하는 펀드입니다. 글로벌 주식 인덱스 수익률의 변동성에 따라 펀드 내 글로벌 주식 인덱스 를 추종하는 기초자산의 투자비율을 주기적으로 조절합니다. 일반적으로 변동성이 높을 때에는 펀드 내 글로벌 주식 인덱스를 추종하는 기초자산 의 투자비율을 줄이고, 반대로 변동성이 낮을 때에는 글로벌 주식 인덱스를 추종하는 기초자산의 투자비율을 높이는 전략을 사용합니다.		

### ▶ 재산 현황

아래 표를 통하여 당기말과 전기말 간의 자산총액, 부채총액, 순자산총액 및 기준가격의 추이를 비교하실 수 있습니다.

(단위: 백만원, 백만과, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
글로벌인덱스RC	자산 총액 (A)	265,420	307,901	16.00
	부채 총액 (B)	263	358	36.00
	순자산총액 (C=A-B)	265,158	307,543	15.99
	발행 수익증권 총수 (D)	196,289	215,348	9.71
	기준가격 (E=C/D × 1000)	1,350.86	1,428.12	5.72

※ 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 미국, 한국 주식 시장은 상승하였으나, 홍콩 주식 시장은 하락하였습니다. 분기 초반 이스타라 엘과 하마스 충돌에 따른 지정학적 리스크가 확대되고 미국의 경제 지표 호조로 긴축 우려가 지속되면서 글로벌 주식 시장은 하락 출발하였습니다. 하지만 11월 주요국의 물가 상승률이 둔화되면서 금리 인상 종결에 대한 기대감이 확대되며 미국 주식 시장은 상승하였습니다. 한국 주식 시장에서는 공매도 금지 조치, 원달러 환율 강세, 전기전자 섹터에 대한 매수세 유입 등이 긍정적으로 작용하였습니다. 반면 홍콩 주식 시장은 부동산 경기와 연계된 중장기대출 부진, 무디스의 중국 신용등급 전망 조정, 중국 정부의 게임산업 규제 강화 우려 등으로 하락하였습니다.

### ▶ 투자환경 및 운용 계획

다음 분기에는 기준금리 인하에 대한 기대감이 영향을 줄 수 있는 다양한 글로벌 경제지표의 발표 결과가 금융 시장의 방향성을 결정하는데 중요한 역할을 할 것으로 예상됩니다. 주식 시장의 밸류에이션 측면에서 시장금리의 하락 추세 유지 여부와 기업들의 실적 발표 결과도 주요 요인으로 작용할 것으로 전망됩니다. 그 외에도 지정학적인 리스크의 확대 가능성, 중국의 경기 부양 정도, 국내 기업의 수출 회복 여부 등도 금융 시장에 영향을 주는 요인으로 작용할 것으로 예상됩니다. 펀드에서는 글로벌 주식 시장에 영향을 미칠 수 있는 다양한 요인들을 지속적으로 면밀하게 관찰하여 자산을 운용하겠습니다.

### ▶ 기간(누적)수익률

(단위: %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
글로벌인덱스RC	5.72	3.01	5.00	7.66

※ 비교지수(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
글로벌인덱스RC	7.66	-15.05	-10.70	9.63

※ 비교지수(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	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	-	1,674	-	-102	-9,169	-	-	-	-	265	-29	-7,361
당기	-	4,354	-	351	11,502	-	-	-	-	-450	-330	15,427

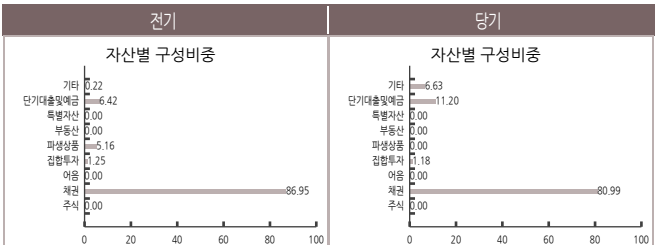
## 3. 자산현황

### ▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
HKD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
(164.85)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)
USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
(1,288.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)
KRW	0	249,372	0	3,648	0	0	0	0	0	34,481	20,400	307,901
(1.00)	(0.00)	(80.99)	(0.00)	(1.18)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(11.20)	(6.63)	(100.00)
합계	0	249,372	0	3,648	0	0	0	0	0	34,481	20,400	307,901

※ ( ): 구성비중

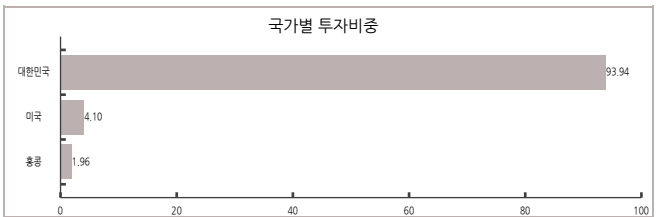


※ 동 펀드의 파생상품 투자는 주로 주가지수 선물을 이용하고 있으며, 파생상품 투자비중은 선물계약금액의 일정 비율인 증거금 금액 기준으로 상기 기타 KRW 구분에 나타내었습니다. 선물을 이용한 투자는 계약금액의 일정 비율인 증거금만으로 거래가 가능하므로 증거금을 제외한 계약금액은 주로 채권, 단기대출 및 예금에 투자하여 운용되고 있습니다.  
 ※ 동 펀드는 당분기말 기준으로 S&P500지수선물 37%, HSCER지수선물 13%, K200지수선물 13%의 포지션을 유지하고 있습니다.

### ▶ 국가별 투자비중

(단위: %)

순위	국가명	비중	순위	국가명	비중
1	대한민국	93.94	6		
2	미국	4.10	7		
3	홍콩	1.96	8		
4			9		
5			10		



### ▶ 투자대상 상위 10종목

(단위: %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	채권	국고03125-2506(22-4)	9.47	6	채권	국고01125-2509(20-6)	5.66
2	채권	국고01875-2412(21-10)	8.02	7	채권	국고02875-2406(22-7)	4.22
3	단기상품	은대(우리은행)	7.18	8	채권	국고05250-2703(07-3)	3.50
4	채권	국고03500-2809(23-6)	7.10	9	채권	국고03365-2509(23-8)	3.30
5	채권	국고03125-2606(23-4)	6.50	10	채권	국고04250-2412(22-15)	3.28

## ■ 각 자산별 보유종목 내역

### ▶ 채권

(단위: 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
국고03125-2506(22-4)	29,200	29,170	대한민국	KRW	2022-06-10	2025-06-10		N/A	9.47
국고01875-2412(21-10)	25,000	24,685	대한민국	KRW	2021-12-10	2024-12-10		N/A	8.02
국고03500-2809(23-6)	21,300	21,848	대한민국	KRW	2023-09-10	2028-09-10		N/A	7.10
국고03125-2606(23-4)	20,000	20,014	대한민국	KRW	2023-06-10	2026-06-10		N/A	6.50
국고01125-2509(20-6)	18,000	17,430	대한민국	KRW	2020-09-10	2025-09-10		N/A	5.66
국고02875-2406(22-7)	13,000	12,989	대한민국	KRW	2022-06-10	2024-06-10		N/A	4.22

국고05250-2703(07-3)	10,000	10,782	대한민국	KRW	2007-03-10	2027-03-10	N/A	3.50
국고03625-2509(23-8)	10,000	10,174	대한민국	KRW	2023-09-10	2025-09-10	N/A	3.30
국고04250-2412(22-15)	10,000	10,102	대한민국	KRW	2022-12-10	2024-12-10	N/A	3.28

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

▶ 주요 비상대응계획

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위: 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	우리은행	2012-04-20	22,066	2.99	-	대한민국	KRW

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

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위: 개, 백만원)

성명	직위	운용중인 펀드 현황		협회등록번호
		펀드개수	운용규모	
최미영	부사장	74	2,344,750	2119000125
김태현	차장	74	2,344,750	2119000109
윤유라	대리	74	2,344,750	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. (인터넷 주소 <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
2019.01.24 ~ 현재	김태현
2021.07.16 ~ 현재	윤유라
2020.09.17 ~ 2023.08.25	이대석

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 백만원, %)

구분	전기		당기		
	금액	비율	금액	비율	
자산운용사	145	0.05	138	0.05	
판매회사	313	0.11	296	0.11	
펀드재산보관회사(신탁업자)	7	-	7	-	
일반사무관리회사	12	-	12	-	
보수합계	478	0.17	453	0.17	
기타비용	1	-	3	-	
매매 중개수수료	단순매매 중개수수료	105	0.04	59	0.02
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0	-	0	-
	합계	105	0.04	59	0.02
증권거래세	0	-	0	-	

\* 펀드의 순자산총액(간편잔) 대비 비율을 나타냅니다.

\* 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경성적, 반복적으로 지출된 비용으로서 매매, 중개수수료는 제외한 것입니다.

\* 성과보수내역: 해당 없음

\* 발행분담금내역: 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위: 연환산, %)

	총보수-비용비율(A)	매매-중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
전기	0.6592	0.1448	0.804
당기	0.6612	0.0851	0.7463

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

\* 매매중개수수료 비율이란 매매중개수수료를 순자산 연평균잔액(보수비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매중개수수료의 수준을 나타냅니다.

6. 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

가. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

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

- 유동성 위험: 이 투자신탁에서 투자하는 증권은 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