



당신이 어느 곳에 있든지, 인생의 중요한 순간마다, 알리안츠가 당신의 자신감이 됩니다.



(무)알리안츠 파워인덱스변액연금보험 코리아인덱스형

※ 공지 사항

1. 자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 '자본시장법')에 의해 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월)동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.
2. 이 보고서는 자본시장법에 의해 (무)알리안츠파워인덱스변액연금코리아인덱스형의 자산운용회사인 '알리안츠생명보험(주)'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '한국씨티은행'의 확인을 받아 판매회사인 '알리안츠생명'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.
3. 자산은 알리안츠글로벌인베스트자산운용(주)에 의하여 투자일임 운용됩니다.
4. 각종 보고서 확인 : 알리안츠생명보험(주) <http://www.allianzlife.co.kr/> 02-3787-7000
금융투자협회 <http://dis.kofia.or.kr>

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

| | | | |
|-------------|--|----------|-------------------|
| 펀드 명칭 | (무)알리안츠파워인덱스변액연금코리아인덱스형 | | |
| 금융투자협회 펀드코드 | 86924 | | |
| 펀드의 종류 | 변액보험, 추가형, 일반형 | 최초설정일 | 2008.08.12 |
| 운용기간 | 2015.07.01 ~ 2015.09.30 | 존속기간 | 취항으로 별도의 존속기간이 없음 |
| 자산운용회사 | 알리안츠생명보험(주) | 펀드재산보관회사 | 한국씨티은행 |
| 판매회사 | 알리안츠생명 | 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스 |
| 상품의 특징 | <ul style="list-style-type: none"> • 국내 KOSPI200 해당주식 및 상장지수펀드(ETF) 등에 투자하여 낮은 비용으로 장기투자자와 자산배분을 통한 주식인덱스를 추종하며, 비중 조절을 통한 알파획득을 추구하는 특징이 있습니다. | | |

▶ 재산 현황

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

| 펀드명칭 | 항목 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|---------------------|-------------------------|----------|----------|-------|
| Az 파워인덱스 코리아인덱스형 | 자산 총액 (A) | 1,169 | 1,136 | -2.86 |
| | 부채 총액 (B) | 1 | 1 | -3.01 |
| | 순자산총액(C=A-B) | 1,168 | 1,135 | -2.86 |
| | 발행 수익증권 총수 (D) | 893 | 890 | -0.37 |
| | 기준가격 (E = C / D x 1000) | 1,308.06 | 1,275.41 | -2.50 |

※ 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금)포함 수령 시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행된 수익증권 총자수로 나눈 가격을 말합니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

KOSPI200 Index를 추종하는 Korea Index Fund는 KOSPI200 Index 45%, 채권 45%, 유동성 10%에 원화로 투자되고 있습니다. 지난분기 국내 주식 시장은 미국 금리 인상에 대한 우려, 위안화 절하에 따른 중국발 경기 둔화 우려, 원화 약세에 따른 외국인 투자 심리 위축으로 하락세를 이어 갔으나 9월 들어 지수 급락에 따른 반발 매수와 원화 약세에 따른 수출 종목들의 실적 기대감으로 하락 폭을 일부 완화하는 모습을 보였습니다. 해당 기간동안 KOSPI200 지수는 하락하였습니다. 이에 따라 당사 펀드도 하락하여, 벤치마크와 유사한 수준의 성과를 기록하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

미국 출구전략 시행 연기로 시장의 관심은 당분간 중국 등 글로벌 경기와 기업 펀더멘털로 이동할 것으로 예상합니다. 10월 핵심 변수는 대외적으로 중국 당국이 시장 기대에 부합하는 수준의 경기부양 정책을 제시할지 여부와 대내적으로는 국내 기업들의 3분기 실적입니다. 일부 경기민감업종(철강, 조선 등)의 실적 부진 우려가 제기되는 가운데, 원화 약세 효과 기대가 있는 수출주 중심으로 실적 개선의 단초가 나올 지 관련입니다. 당사 펀드는 벤치마크 수준에서의 편입비중 조절과 능동적인 시장대응을 통해 지속적으로 성과개선을 추구할 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 12개월 |
|-------------------------------------|------------------|------------------|------------------|-----------------|
| Az 파워인덱스 코리아인덱스형 (비교지수 대비 성과) | -2.50 (-0.12) | -3.14 (-0.13) | -0.30 (-0.24) | -1.81 (0.01) |
| 비교지수(벤치마크) | -2.38 | -3.01 | -0.06 | -1.83 |

※ 비교지수(벤치마크) : KOSPI200 Index 45.0%, KOSBI30 45.0%, CALL 10.0%

* 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

(단위 : %)

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|-------------------------------------|-----------------|------------------|----------------|------------------|
| Az 파워인덱스 코리아인덱스형 (비교지수 대비 성과) | -1.81 (0.01) | -0.53 (-0.08) | 1.15 (0.16) | 10.54 (-0.07) |
| 비교지수(벤치마크) | -1.83 | -0.45 | 0.99 | 10.61 |

※ 비교지수(벤치마크) : KOSPI200 Index 45.0%, KOSBI30 45.0%, CALL 10.0%

* 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

▶ 추적오차

(단위 : %)

| 구분 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 1년 |
|------|--------|--------|-------|
| 추적오차 | 1.08 | 0.89 | 0.96 |

※ 추적오차란 일정기간 동안 인덱스펀드가 추종하는 특정 비교지수의 변동을 얼마나 충실히 따라갔는지를 보여주는 지표로서, 비교지수 수익률 대비 해당 인덱스펀드의 일간 수익률 차이의 표준편차를 기재합니다. 추적오차의 수치가 적을수록 해당 기간 동안 인덱스펀드가 비교지수와 유사하게 움직였음을 의미합니다.

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

| 구분 | 증권 | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익 합계 |
|----|----|----|----|----------|----|-----|------|----------|--------------|----|----------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합 투자 | 장내 | | 장외 | 실물 자산 | | | |
| 전기 | 0 | 0 | 0 | -6 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -2 | -8 |
| 당기 | 0 | 0 | 0 | -28 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -2 | -29 |

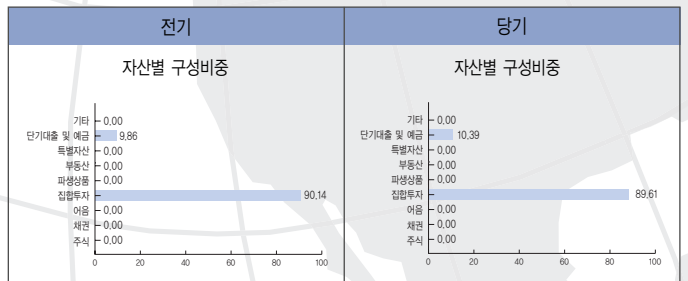
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

| 통화별 구분 | 증권 | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산 총액 |
|---------------|-------------|-------------|-------------|------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|----------------|-------------|-------------------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합 투자 | 장내 | | 장외 | 실물 자산 | | | |
| KRW (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 1,018 (89.61) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 118 (10.39) | 0 (0.00) | 1,136 (100.00) |
| 합계 | 0 | 0 | 0 | 1,018 | 0 | 0 | 0 | 0 | 118 | 0 | 1,136 |

※ () : 구성비중





당신이 어느 곳에 있든지, 인생의 중요한 순간마다, 알리안츠가 당신의 자신감이 됩니다.



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

| 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 종목명 | 비중 |
|----|-------------------------|-------|----|-----|----|
| 1 | 집합투자증권 TIGER 200 | 45.77 | 6 | | |
| 2 | 집합투자증권 이시스(지)채권(C/C(V)) | 43.84 | 7 | | |
| 3 | 단기상품 CMA(신한금융투자) | 8.80 | 8 | | |
| 4 | 단기상품 은대(한국씨티은행) | 1.59 | 9 | | |
| 5 | | | 10 | | |

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 집합투자증권

(단위 : 죄수, 백만원, %)

| 종목명 | 종류 | 자산운용사 | 설정원본 | 순자산금액 | 발행국가 | 통화 | 비중 |
|----------------|------|-----------------|------|-------|------|-----|-------|
| TIGER 200 | 수익증권 | TIGER200 | 540 | 520 | 대한민국 | KRW | 45.77 |
| 이시스(지)채권(C/CV) | 채권형 | 알리안츠글로벌인베스터스자산운 | 482 | 498 | 대한민국 | KRW | 43.84 |

* 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 | 한국씨티은행 | 2010-04-01 | 18 | 1.15 | | 대한민국 | KRW | |
| | CMA | 신한금융투자 | 2015-09-30 | 100 | 1.40 | 2015-10-01 | 대한민국 | KRW |

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

4. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

| 구분 | 전기 | | 당기 | |
|----------------|----|------|----|------|
| | 금액 | 비율 | 금액 | 비율 |
| 자산운용사 | 0 | 0.02 | 0 | 0.03 |
| 판매회사 | 1 | 0.11 | 1 | 0.12 |
| 펀드재산보관회사(신탁업자) | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| 보수합계 | 2 | 0.15 | 2 | 0.15 |
| 기타비용** | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| 매매·중개·중개수수료 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| 중개·중개수수료 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| 중개·중개수수료 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| 중개·중개수수료 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| 증권거래세 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외된 것입니다.

* 성과보수내역 : 없음

* 발행분담금내역 : 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위 : 연환산, %)

| | 총보수·비용비율(A) | 매매·중개수수료 비율(B) | 합계(A+B) |
|----|-------------|----------------|---------|
| 전기 | 0.5972 | 0.0024 | 0.5996 |
| 당기 | 0.5973 | 0.002 | 0.5993 |

* 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총보수·비용수준을 나타냅니다.

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

5. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을율

(단위 : 백만원, %)

| 매 수 | | 매 도 | | 매매 회전율(주) | |
|-----|----|-----|----|-----------|------|
| 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 해당기간 | 연환산 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | 0.00 |

* 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균금액으로 나눈 비율입니다. 매매회전율이 높을수록 매매거래수수료(0.1% 내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ 최근 3분기 매매회전을율 추이

(단위 : %)

| | | |
|------|------|------|
| 0.00 | 0.00 | 0.00 |
|------|------|------|

고객님이 가입하신 펀드는 펀드의 운용규모가 법적 기준 소규모상태(50억원 미만)에 해당하여 운용 시 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란할 수 있습니다. 또한 법적당서에 의거하여 향후 불가피하게 임의해지를 통해 정리될 수 있음을 알려드립니다. (자본시장과 금융투자업에 관한 법률 제192조 제1항, 동법 시행령 제233조 제3호 및 제4호)

