

C9003 글로벌주식 FOF(달러형)

※ 공지 사항

1. 자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입 상품에 특정한 기간(3개월)동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.
2. 이 보고서는 자본시장법에 의해 글로벌주식 FOF(달러형)의 자산운용회사인 ABL생명보험이 작성하여 펀드 재산보관회사(신탁업자)인 우리은행의 확인을 받아 판매회사인 ABL생명보험을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.
3. 자산은 우리글로벌자산운용에 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	글로벌주식 FOF(달러형)		
금융투자협회 펀드코드	AN082		
펀드의 종류	변액보험, 추가형, 종류형	최초설정일	2013.07.19
운용기간	2020.01.01 ~ 2020.03.31	존속기간	추정으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	ABL생명보험	펀드재산보관회사	우리은행
판매회사	ABL생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	* 전세계 대표적인 성장주식에 투자하는 재간접형 펀드로, 펀드의 기준 가격 표시통화는 미국달러(USD)입니다.		

▶ 재산 현황

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

(단위: 천USD, 천좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
글로벌주식 FOF(달러형)	자산 총액 (A)	457	498	9.02
	부채 총액 (B)	0	0	13.94
	순자산총액 (C=A-B)	457	498	9.01
	발행 수익증권 총 수 (D)	29,013	39,408	35.83
	기준가격 (E=C/D×1000)	15.75	12.64	-19.75

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

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

2020년 연초 글로벌 증시는 미중 무역협상 타결에 위험자산 선호 현상이 이어지다 신종 코로나바이러스의 영향으로 상승세를 제약받았습니다. 선진국 제조업 경기 저점 통과 기대감이 높아지고 있으나 여전히 수요 회복은 더딘 상황이며, 미국 역시 4/4분기 지표에서 내수 성장 둔화와 수입 감소가 확인됐습니다. 글로벌 경기와 위험자산에 대한 부담감이 작용하면서 경기지표 부진 지속 등의 영향으로 하락세를 면치 못했습니다. 코로나19가 전세계적으로 빠르게 확산되면서 주식시장에 부정적으로 작용했습니다. 미국 내 코로나 확산 우려와 연준의 금리 동결 기조가 맞물리며 유가 하락 동반으로 에너지 섹터 중심의 부진한 모습이었습니다. 동 펀드의 경우, 1% 미만으로 종목별로 분산투자 되어 있어 벤치마크 지수의 개별 종목 편입 비중과는 다소 차이가 발생하고 있습니다. 특히 FANG(Facebook, Amazon, Netflix, Google)을 비롯한 기술주 종목은 기업 수익성/안정성 평가를 통과하지 못하여 편입하고 있지 않기 때문에 전분기 말 대비 상대적으로 하락폭이 적었던 IT업종에서 부정적인 영향을 주었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

미국 주식 시장은 코로나19 충격이 2분기 이상 소요될 경우 경기 침체로 이어질 가능성은 높으나 적극적인 경기부양책과 금리 인하, 무제한 양적완화 정책 등의 재정 및 통화 정책으로 하방 압력을 제한할 것으로 예상합니다. 미국 증시는 이벤트에 따른 변동성 확대, 주요 경제주체들의 정책에 따른 업종별 등락 심화가 나타날 것으로 판단하고 있습니다. 유럽 주식시장은 급락하면서 밸류에이션 메리트는 발생했다고 판단하고 있습니다. 다만 아직까지 코로나19 통제력이 여타 선진국 또는 국내와 중국 대비 부족하고, 글로벌 공급 사슬에 충격에 따라 수출 중심의 경기 지표 개선은 어려울 것으로 예상됩니다.

다. 이탈리아와 스페인을 중심으로 한 금융시장 리스크 확대 가능성도 상존하기 때문에 전반적으로 부진한 글로벌 경제 여건과 대내외 이벤트에 대응하며 보수적인 시각에서 하락시마다 저가매수 기회를 엿보며 국면별로 유연하게 대응하고자 합니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위: %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
글로벌주식 FOF(달러형)	-19.75	-13.60	-13.07	-10.10
(비교지수 대비 성과)	(-0.64)	(-1.05)	(-1.25)	(-1.69)
비교지수(벤치마크)	-19.11	-12.55	-11.82	-8.41

* 비교지수(벤치마크): MSCI_Daily_TR_Net_World_USD(T-1) X 95% + BM없음 X 5%

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

(단위: %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
글로벌주식 FOF(달러형)	-10.10	-7.76	-0.34	9.60
(비교지수 대비 성과)	(-1.69)	(-2.38)	(-5.93)	(-6.89)
비교지수(벤치마크)	-8.41	-5.38	5.59	16.49

* 비교지수(벤치마크): MSCI_Daily_TR_Net_World_USD(T-1) X 95% + BM없음 X 5%

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

▶ 손익현황

(단위: 천USD)

구분	증권			파생상품 장내 장외	부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익 합계
	주식	채권	어음 집합 투자			실물 자산	기타			
전기	0	0	0	33	0	0	0	0	0	32
당기	0	0	0	-121	0	0	0	0	0	-1

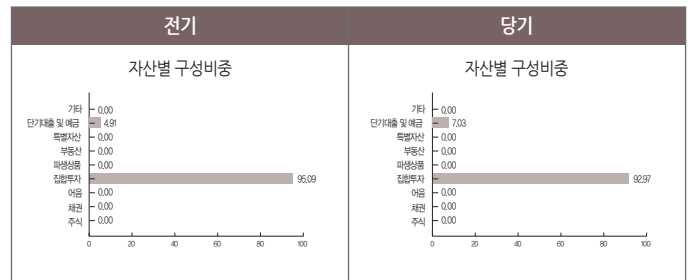
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 천USD, %)

구분	증권			파생상품 장내 장외	부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산 총액	
	주식	채권	어음 집합 투자			실물 자산	기타				
USD (1217.40)	0	0	0	463	0	0	0	0	35	0	498
합계	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(92.97)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(7.03)	(0.00)	(100.00)

() : 구성비중



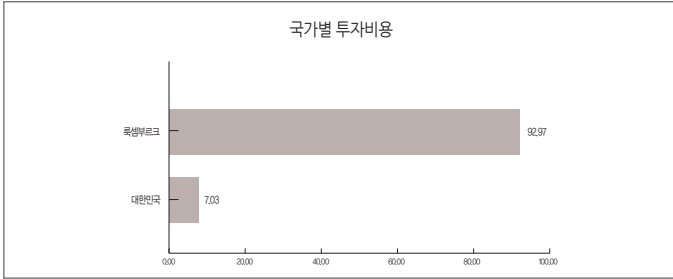
전기 당기

자산별 구성비중 자산별 구성비중

▶ 국가별 투자비중

(단위 : %)

	국가명	비중		국가명	비중
1	룩셈부르크	92.97	6		
2	대한민국	7.03	7		
3			8		
4			9		
5			10		



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	집합투자증권	SISF-QEP GLOBAL QUALITY-CSC	92.97	6			
2	단기상품	USD Deposit	7.03	7			
3				8			
4				9			
5				10			

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 천USD, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
SISF-QEP GLOBAL QUALITY-CSC	수익 증권	Schroder International Selection Fund	585	463	룩셈부르크	USD	92.97

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 천USD, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
외화에 치금	한국씨티은행	2013-07-19	35	0.00		대한민국	USD

※ 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	부사장	41	77	2,276,163	-	-	2119000125
김태현	과장	37	77	2,276,163	-	-	2119000109
최명혁	사원	28	77	2,276,163	-	-	2119000110

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

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2019.01.25 ~ 현재	최미영
2019.01.24 ~ 현재	김태현
2019.01.24 ~ 현재	최명혁
2018.05.29 ~ 2019.12.06	차인식

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 천USD, %)

구분	전기		당기	
	금액	비율	금액	비율
자산운용사	0	0.02	0	0.02
판매회사	0	0.08	0	0.08
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00
보수합계	0	0.10	1	0.10
기타비용	0	0.00	0	0.00
매매· 중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0	0.00
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0	0.00
	합계	0	0	0.00
증권거래세	0	0.00	0	0.00

※ 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

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

※ 성과보수내역 : 해당 없음

※ 발행분담금내역 : 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위 : 연환산, %)

	총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
전기	0.4299	0	0.4299
당기	0.4334	0	0.4334

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

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

'글로벌주식 FOF(달러형)' 의 경우 펀드의 운용규모의 법적 기준 소규모상태(50억원 미만)에 해당하여 운용시 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란할 수 있습니다. 또한 법적당서에 의거하여 향후 불가피하게 임의해지를 통해 정리될 수 있음을 알려드립니다. (자본시장과 금융투자업에 관한 법률 제 192조 제1항, 동법 시행령 제 223조 제3호 및 제4호)