

G1009 빅데이터국내주식형

※ 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 빅데이터국내주식형의 자산운용회사인 ABL생명보험이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 국민은행의 확인을 받아 판매회사인 ABL생명보험을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.
3. 자산은 이스트스프링자산운용에 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	빅데이터국내주식형		
금융투자협회 펀드코드	C2640		
펀드의 종류	변액보험, 추가형, 일반형	최초설정일	2018.01.09
운용기간	2020.01.01 ~ 2020.03.31	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 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 선별된 종목에 투자하여 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
빅데이터 국내주식형	자산 총액 (A)	5,927	5,194	-12.36
	부채 총액 (B)	6	3	-46.92
	순자산총액 (C=A-B)	5,921	5,191	-12.32
	발행 수익증권 총 수 (D)	6,318	6,604	4.52
	기준가격 (E=C/D×1000)	937.07	786.09	-16.11

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

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

지난 1분기 동안 펀드 기준가는 16.11% 하락하였습니다. 1월 미중 무역 1단계 합의와 반도체 업황 개선에 대한 기대감으로 상승세를 보였던 증시는 중국의 코로나19 확산이라는 리스크를 만나며 급격하게 하락세로 전환하였습니다. 2월 들어 코로나19의 확산세가 거세지면서 글로벌 경기 침체에 대한 우려가 높아졌고, 국내에서도 확진자 수가 급증하며 경기둔화 우려로 하락세를 이어나갔습니다. 3월 초 코로나19가 전세계로 확산되면서 미연준의 긴급금리인하에도 불구하고 글로벌 증시는 급락하였습니다. 국내 증시 역시 급락세를 보였지만 미연준 무제한 양적 완화 등이 발표되며 하락폭이 완화되었고, 한은의 긴급금리인하와 한미 통화스와프, 정부의 시장안정대책 등으로 증시의 하방을 지지하며 마감하였습니다.

펀드에서는 자산배분 효과가 부정적으로 작용하면서 시장 대비 저조한 성과를 거두었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

각 국의 정부와 중앙은행들이 대규모 경기부양책을 연이어 제시하며 증시의 하방은 지지될 것으로 예상하지만 코로나19로 인한 실물경제의 타격이 지속되고 있다는 점에서 변동성 높은 장세는 지속될 것으로 보입니다. 다가오는 3월 경제 지표와 1분기 기업 실적 발표 이후 증시의 방향성이 결정될 것으로 보입니다. 현재 증시는 이미 글로벌 경기침체에 대한 우려를 상당 부분 반영한 것으로 보여 코로나 공포의 정점을 통과하고, 유가 안정이 가시화된다면 반등의 기회를 엿볼 수 있을 것으로 전망합니다.

펀드에서는 매월 초 주식 종목에 대한 빅데이터 분석을 통해 개별 종목의 투자 비중을 결정하고 있습니다. 4월 초 리밸런싱을 통해 펀드에서는 전월 대비 에너지와 산업재 등의 섹터 비중을 확대하고, 경기소비재와 커뮤니케이션서비스 섹터 등의 비중을 축소하여 운용할 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
빅데이터국내주식형	-16.11	-10.38	-11.15	-10.97

※ 비교지수(벤치마크) : 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	-10.97	-19.95	-	-

※ 비교지수(벤치마크) : 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	집합 투자	장내	장외		실물 자산	기타			
전기	264	0	0	105	20	0	0	0	0	2	-13	378
당기	-802	0	0	-126	-24	0	0	0	0	2	-14	-964

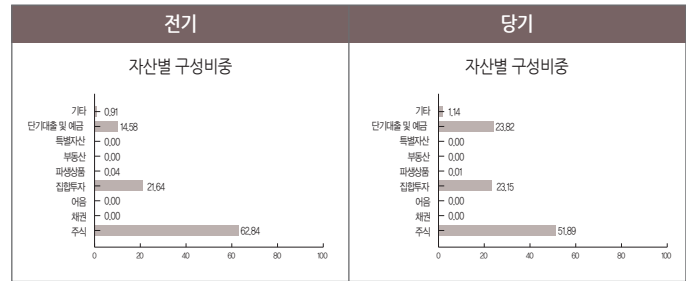
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합 투자	장내	장외		실물 자산	기타			
KRW (1.00)	2,695 (51.89)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,202 (23.15)	0 (0.01)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,237 (23.82)	59 (1.14)	5,194 (100.00)
합계	2,695	0	0	1,202	0	0	0	0	0	1,237	59	5,194

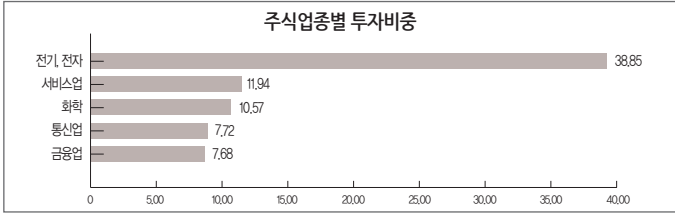
※ () : 구성비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

업종명	비중	업종명	비중
1 전기전자	38.85	6 운수장비	4.10
2 서비스업	11.94	7 보험	4.05
3 화학	10.57	8 유통업	3.47
4 통신업	7.72	9 철강및금속	2.89
5 금융업	7.68	10 기타	8.73



* 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다.

▶ 투자대상 상위 10종목 (단위: %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	단기상품	은대(국민은행)	6	주식	SK텔레콤
2	주식	삼성전자	7	주식	롯데
3	집합투자증권	KODEX 코스닥 150	8	주식	한국전력
4	집합투자증권	TIGER 코스닥 150	9	주식	카카오
5	단기상품	KD(자금중개REPO매수(20200331))	10	주식	하나금융지주

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식 (단위: 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	17,470	834	16.1	대한민국	KRW	전기전자	
SK텔레콤	589	104	2.0	대한민국	KRW	통신업	
롯데	853	79	1.5	대한민국	KRW	서비스업	
한국전력	3,917	75	1.5	대한민국	KRW	전기사업	
카카오	484	75	1.5	대한민국	KRW	서비스업	
하나금융지주	3,103	72	1.4	대한민국	KRW	금융업	

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

▶ 집합투자증권 (단위: 최소, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
KODEX 코스닥 150	수익증권	삼성자산운용	675	602	대한민국	KRW	11.58
TIGER 코스닥 150	수익증권	미래에셋자산운용	676	601	대한민국	KRW	11.57

* 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	1,037	0.46		대한민국	KRW
REPO매수	삼성증권	2020-03-31	200	0.80		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	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: 백만원, %)

구분	전기		당기		
	금액	비율	금액	비율	
자산운용사	4	0.06	4	0.06	
판매회사	6	0.11	6	0.11	
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수합계	10	0.18	10	0.18	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	1	0.01	1	0.02
	조사분석업무 등 서비스수수료	0	0.00	0	0.00
	합계	1	0.01	1	0.02
증권거래세	2	0.04	3	0.05	

* 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	0.7278	0.0747	0.8025
당기	0.7297	0.0646	0.7943

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

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