

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 이스트프링자산운용에 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	2020.04.01 ~ 2020.06.30	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, 백만원, %))

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
빅데이터 국내주식형	자산 총액 (A)	5,194	6,063	16.72
	부채 총액 (B)	3	4	16.54
	순자산총액 (C=A-B)	5,191	6,059	16.72
	발행 수익증권 총 수 (D)	6,604	6,559	-0.68
	기준가격 (E=C/Dx1000)	786.09	923.84	17.52

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

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

지난 2분기 동안 펀드 기준가는 17.52% 상승하였습니다. 2분기 국내 증시는 4월 실물경기의 부진에도 불구하고 적극적인 유동성 공급과 재정정책의 영향으로 투자심리가 개선되었습니다. 중국의 소비가 반등하고 미국이 경제활동 재개를 논의하면서 증시는 상승하였습니다. 5월에는 풍부한 유동성을 기반으로 경기지표 저점을 확인하며 상승하였습니다. 월말 미중 갈등이 심화되며 국내 증시도 소폭 조정을 받았습니다. 6월 국내증시는 미중 갈등의 완화와 미국 경기지표 호조로 상승하며 출발하였습니다. 이후 코로나19 재확산 우려가 커지고 북한발 지정학적 리스크가 부각되며 변동성이 높아졌습니다. 하지만 월말 미중시의 반등과 국내외 각종 대책에 힘입어 증시 하단을 지지하며 마감하였습니다. 펀드에서는 자산배분 효과가 부정적으로 작용하면서 시장 대비 저조한 성과를 거두었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

대외 불확실성이 높아지는 가운데 국내증시의 변동성은 향후에도 높은 수준을 유지할 것으로 보입니다. 2분기 기업 실적은 전반적으로 부진할 것으로 예상되고 있어 이에 따른 투자심리 위축의 가능성이 있습니다. 하지만 정부의 그린 뉴딜을 비롯한 각국의 경기 부양책이 이어지고, 현재의 유동성 유입이 지속되며 증시 하단의 지지가 계속될 것으로 예상됩니다. 실적 발표 이후 유동성 장세에서 펀더멘털 장세로의 전환 가능성이 있어 이에 따른 주목이 필요할 것으로 전망합니다.

펀드에서는 매월 초 주식 종목에 대한 빅데이터 분석을 통해 개별 종목의 투자 비중을 결정하고 있습니다.

니다. 7월 초 리밸런싱을 통해 펀드에서는 전월 대비 헬스케어와 산업재 등의 섹터 비중을 확대하고, 필수소비재와 커뮤니케이션서비스 섹터 등의 비중을 축소하여 운용할 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
빅데이터국내주식형	17.52	-1.41	5.32	4.43

※ 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	4.43	-0.12	-	-

※ 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	-802	0	0	-126	-24	0	0	0	0	2	-14	-964
당기	617	0	0	316	15	0	0	0	0	1	-15	934

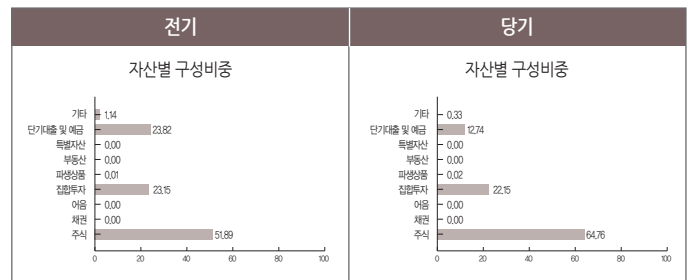
3. 자산현황

▶ 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)	3,926 (64.76)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,343 (22.15)	2 (0.02)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	772 (12.74)	20 (0.33)	6,063 (100.00)
합계	3,926	0	0	1,343	2	0	0	0	0	772	20	6,063

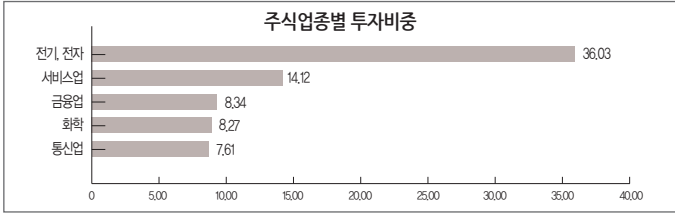
※ () : 구성비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

업종명	비중	업종명	비중
1 전기전자	36.03	6 보험	3.87
2 서비스업	14.12	7 KOSPI 미분류	3.83
3 금융업	8.34	8 철강및금속	3.79
4 화학	8.27	9 운수장비	3.64
5 통신업	7.61	10 기타	10.50



* 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다.

▶ 투자대상 상위 10종목 (단위: %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	주식 삼성전자	17.63	6	주식 NAVER	3.06
2	집합투자증권 KODEX 코스닥 150	11.08	7	주식 SK텔레콤	2.56
3	집합투자증권 TIGER 코스닥150	11.07	8	주식 KT&G	2.48
4	단기상품 은대(국민은행)	7.79	9	주식 LG전자	1.75
5	단기상품 KDB자산운용REPO매수(20200630)	4.95	10	주식 SK	1.67

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식 (단위: 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	20,249	1,069	17.6	대한민국	KRW	전기전자	
NAVER	694	185	3.1	대한민국	KRW	서비스업	
SK텔레콤	736	155	2.6	대한민국	KRW	통신업	
KT&G	1,925	151	2.5	대한민국	KRW	KOSPI 미분류	
LG전자	1,674	106	1.8	대한민국	KRW	전기전자	
SK	347	101	1.7	대한민국	KRW	금융업	

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

▶ 집합투자증권 (단위: 최소, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
KODEX 코스닥 150	수익증권	삼성자산운용	602	672	대한민국	KRW	11.08
TIGER 코스닥150	수익증권	미래에셋자산운용	600	671	대한민국	KRW	11.07

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

▶ 단기대출 및 예금 (단위: 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	국민은행	2018-01-09	472	0.23		대한민국	KRW
REPO매수	삼성증권	2020-06-30	300	0.58		대한민국	KRW

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

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	78	2,459,419	-	-	2119000125
김태현	과장	37	78	2,459,419	-	-	2119000109
최명혁	사원	28	78	2,459,419	-	-	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, 협회 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	7	0.11	
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수합계	10	0.18	11	0.18	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	1	0.02	1	0.02
	조사분석업무 등 서비스수수료	0	0.00	0	0.00
	합계	1	0.02	1	0.02
증권거래세	3	0.05	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	0.7297	0.0646	0.7943
당기	0.7297	0.0662	0.7959

* 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.