

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 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 | 2020.07.01 ~ 2020.09.30 | 존속기간 | 추가행으로 별도의 존속기간이 없음 |
| 자산운용회사 | ABL생명보험 | 펀드재산보관회사 | 국민은행 |
| 판매회사 | ABL생명보험 | 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스 |
| 상품의 특징 | <ul style="list-style-type: none"> • 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 비교할 수 있습니다.
 (단위 : 백만원, 백만원, %)

| 펀드명칭 | 항목 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|---------------|-------------------|--------|--------|--------|
| 빅데이터 국내주식형 | 자산 총액 (A) | 6,063 | 6,619 | 9.17 |
| | 부채 총액 (B) | 4 | 26 | 591.07 |
| | 순자산총액 (C=A-B) | 6,059 | 6,593 | 8.81 |
| | 발행 수익증권 총 수 (D) | 6,559 | 6,634 | 1.15 |
| | 기준가격 (E=C/Dx1000) | 923.84 | 993.84 | 7.58 |

※ 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

3분기 국내 증시는 상승하였습니다. 7월 경제회복에 대한 기대감이 증시에 선반영되고, 한국형 뉴딜에 따른 모멘텀이 증시를 이끌었습니다. 또한 달러 약세와 힘입어 증시는 전고점에 다가가며 마무리하였습니다. 8월에는 미국의 경기부양책과 국내 경기 회복에 대한 기대감 등에 정부의 전폭적인 정책동력까지 더해지며 국내 코로나19의 재확산에도 불구하고 강세를 이어나갔습니다. 9월 국내증시는 미중갈등과 미국 테크 관련주의 급락세 속에서 정부의 적극적인 산업정책과 개인 투자자들의 풍부한 유동성 공급 등으로 소폭 상승하였습니다. 펀드에서는 자산배분 효과가 부정적으로 작용하면서 시장 대비 저조한 성과를 거두었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

글로벌 증시에서 전반적인 조정이 나타나고 있습니다. 국내 증시는 글로벌 증시에 앞서 이미 조정국면을 지났고, 기업실적에 대한 기대감도 높아지고 있습니다. 수출모멘텀의 강화와 정부의 적극적인 산업지원정책이 증시의 강세를 지탱할 것으로 전망합니다. 하지만 IT, 반도체 등으로 기대가 쏠려있고, 미대선과 코로나19 재확산이라는 불확실성이 계속 되고 있는 만큼 주의가 필요할 것으로 예상합니다.

펀드에서는 매월 초 주식 종목에 대한 빅데이터 분석을 통해 개별 종목의 투자 비중을 결정하고 있습니다. 10월 초 리밸런싱을 통해 펀드에서는 전월 대비 IT와 금융 등의 섹터 비중을 확대하고, 커뮤니케이션서비스 및 헬스케어 섹터 등의 비중을 축소하여 운용할 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 12개월 |
|-----------|--------|--------|--------|---------|
| 빅데이터국내주식형 | 7.58 | 26.43 | 6.06 | 13.30 |

※ 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 | 13.30 | 6.86 | - | - |

※ 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 | 617 | 0 | 0 | 316 | 15 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | -15 | 934 |
| 당기 | 330 | 0 | 0 | 129 | 17 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | -16 | 460 |

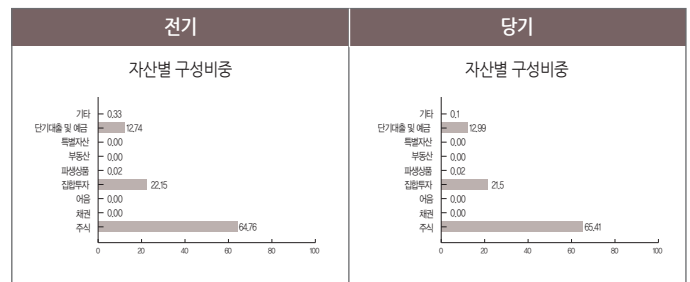
3. 자산현황

▶ 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) | 4,330 (65.41) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 1,423 (21.50) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 860 (12.99) | 7 (0.10) | 7 (0.10) | 6,619 (100.00) |
| 합계 | 4,330 | 0 | 0 | 1,423 | 0 | 0 | 0 | 0 | 860 | 7 | 7 | 6,619 |

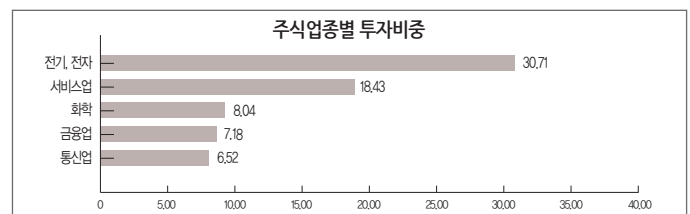
※ () : 구성비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

| 업종명 | 비중 | 업종명 | 비중 |
|--------|-------|---------|-------|
| 1 전기전자 | 30.71 | 6 의약품 | 5.65 |
| 2 서비스업 | 18.43 | 7 운수장비 | 5.20 |
| 3 화학 | 8.04 | 8 철강및금속 | 4.50 |
| 4 금융업 | 7.18 | 9 유통업 | 3.08 |
| 5 통신업 | 6.52 | 10 기타 | 10.69 |



※ 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다.

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

| 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 종목명 | 비중 |
|----|------------------------------|-------|----|-------------|------|
| 1 | 집합투자증권 TIGER 200 | 21.50 | 6 | 주식 넷마블 | 3.03 |
| 2 | 주식 삼성전자 | 14.28 | 7 | 주식 삼성바이오로직스 | 2.47 |
| 3 | 단기상품 KDB저금중기REPO매수(20200929) | 7.55 | 8 | 주식 SK텔레콤 | 2.18 |
| 4 | 단기상품 은대(국민은행) | 5.43 | 9 | 주식 LG전자 | 2.15 |
| 5 | 주식 카카오 | 4.12 | 10 | 주식 KT&G | 1.92 |

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

(단위 : 주, 백만원, %)

| 종목명 | 보유수량 | 평가금액 | 비중 | 발행국가 | 통화 | 업종 | 비고 |
|----------|--------|------|------|------|-----|-----------|----|
| 삼성전자 | 16,245 | 945 | 14.3 | 대한민국 | KRW | 전기전자 | |
| 카카오 | 748 | 273 | 4.1 | 대한민국 | KRW | 서비스업 | |
| 넷마블 | 1,207 | 200 | 3.0 | 대한민국 | KRW | 서비스업 | |
| 삼성바이오로직스 | 237 | 164 | 2.5 | 대한민국 | KRW | 의약품 | |
| SK텔레콤 | 607 | 144 | 2.2 | 대한민국 | KRW | 통신업 | |
| LG전자 | 1,553 | 142 | 2.2 | 대한민국 | KRW | 전기전자 | |
| KT&G | 1,544 | 127 | 1.9 | 대한민국 | KRW | KOSPI 미분류 | |

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

▶ 집합투자증권

(단위 : 최수, 백만원, %)

| 종목명 | 종류 | 설정원본 | 순자산금액 | 발행국가 | 통화 | 비중 |
|-----------|------|-------|-------|------|-----|-------|
| TIGER 200 | 수익증권 | 1,307 | 1,423 | 대한민국 | KRW | 21.50 |

※ 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 |
|--------|------|------------|-----|------|-----|------|-----|
| REPO매수 | 삼성증권 | 2020-09-29 | 500 | 0.59 | | 대한민국 | KRW |
| 예금 | 국민은행 | 2018-01-09 | 360 | 0.23 | | 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 | 78 | 2,505,667 | | | 2119000125 |
| 이대석 | 차장 | 38 | 78 | 2,505,667 | | | 2119000109 |
| 김태현 | 과장 | 37 | 78 | 2,505,667 | | | 2119000109 |
| 최명혁 | 사원 | 28 | 78 | 2,505,667 | | | 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 수사공시 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 |
| 2020.09.17 ~ 현재 | 이대석 |
| 2019.01.24 ~ 현재 | 김태현 |
| 2019.01.24 ~ 현재 | 최명혁 |

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | |
|----------------|-----------------|------|------|------|------|
| | 금액 | 비율 | 금액 | 비율 | |
| 자산운용사 | 4 | 0.06 | 4 | 0.06 | |
| 판매회사 | 7 | 0.11 | 7 | 0.11 | |
| 펀드재산보관회사(신탁업자) | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 보수합계 | 11 | 0.18 | 12 | 0.18 | |
| 기타비용** | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 매매·중개수수료 | 단순매매·중개수수료 | 1 | 0.02 | 2 | 0.02 |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 합계 | 1 | 0.02 | 2 | 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 제외된 것입니다.

※ 성과보수내역 : 해당 없음

※ 발행분담금내역 : 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위 : 연환산, %)

| | 총보수·비용비율(A) | 매매·중개수수료 비율(B) | 합계(A+B) |
|----|-------------|----------------|---------|
| 전기 | 0.7297 | 0.0662 | 0.7959 |
| 당기 | 0.7296 | 0.0744 | 0.804 |

※ 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.