

# G1004 스마트롱숏재간접형

## ※ 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 스마트롱숏재간접형의 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 미래에셋자산운용에 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	스마트롱숏재간접형		
금융투자협회 펀드코드	C3985		
펀드의 종류	변액보험, 추가형, 일반형	최초설정일	2018.01.25
운용기간	2020.10.01 ~ 2020.12.31	존속기간	취항으로 별도의 존속기간 없음
자산운용회사	ABL생명보험	펀드재산보관회사	국민은행
판매회사	ABL생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	• 국내 주식 또는 국내 주식을 대상으로한 롱숏 전략을 주된 운용전략으로 하는 펀드에 투자함으로써 추가적인 자본이득을 창출하는 한편 장기적으로 안정적인 수익을 추구함에 있습니다.		

### ▶ 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
스마트롱숏재간접형	자산 총액 (A)	148	87	-41.57
	부채 총액 (B)	0	0	-31.03
	순자산총액 (C=A-B)	148	87	-41.58
	발행 수익증권 총 수 (D)	148	84	-43.37
	기준가격 (E=C/D×1000)	1,001.87	1,033.51	3.16

※ 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

지난 3개월간 동 펀드의 수익률은 +3.16%를 기록했습니다. 동 기간 KOSPI의 수익률은 +23.4%, KOSDAQ의 수익률은 +14.2%를 기록했습니다. 글로벌 증시는 11월 미국 대선에서 민주당 조 바이든 후보가 당선된 이후 경제심리의 완화 및 경제 성장상 기대감 상승으로 강세를 보였습니다. 특히 한국 주식 시장의 경우, 반도체 등 주력 수출 산업의 업황 개선과 지속적인 리테일 자금의 유입으로 글로벌 증시 중에서도 가장 높은 주가 상승률을 기록하였습니다. 당 펀드의 경우, 11월 이후 나타난 상승장 속에서, 친환경 정책 기대감에 힘입은 신재생 에너지 관련종목들과 2021년 산업 개선세 기대감이 두드러진 반도체 등의 IT 하드웨어 섹터에 대한 Long 포지션을 통해 시장 상승에 대응하였습니다.

### ▶ 투자환경 및 운용 계획

팬데믹 발발과 이로 인한 주가 급락 이후, 글로벌 금융 시장은 미국을 포함한 대부분의 국가에서 경제의 추가하락을 막기 위한 강력한 정책을 발표와 전염병 확산추이의 둔화로 인한 실물경기의 회복 기대감으로 재차 빠르게 반등하였습니다. 미국과 한국 등의 주가지수는 이미 팬데믹 이전 수준을 넘어서 신고가를 경신하고 있는 현재, 시장의 관심은 2021년 경제 회복속도 및 기업 이익 전망치의 변화와 미국 정부의 정책 방향성에 집중될 것입니다. 특히 코로나19 백신의 상용화가 임박했다는 보도가 이어짐에 따라 해당 이슈에 대한 면밀한 관찰과 대응이 필요할 것으로 전망합니다.

### ▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
스마트롱숏재간접형 (비교지수 대비 성과)	3.16 (-1.50)	4.55 (-2.46)	8.76 (-3.34)	7.82 (0.15)
비교지수(벤치마크)	4.66	7.01	12.10	7.67

※ 비교지수(벤치마크): 국고채권 1-2년(T-1) X 80% + KOSPI(T-1) X 20%

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

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
스마트롱숏재간접형 (비교지수 대비 성과)	7.82 (0.15)	7.78 (-3.55)	-	-
비교지수(벤치마크)	7.67	11.33	-	-

※ 비교지수(벤치마크): 국고채권 1-2년(T-1) X 80% + KOSPI(T-1) X 20%

\* 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	0	0	0	3	0	0	0	0	0	0	0	2
당기	0	0	0	3	0	0	0	0	0	0	0	3

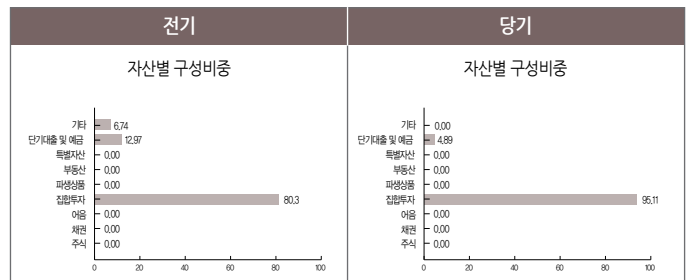
## 3. 자산현황

### ▶ 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)	0	0	0	82	0	0	0	0	0	4	0	87
합계	0	0	0	82	0	0	0	0	0	4	0	87

※ ( ) : 구성비중



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	집합투자증권 미래에셋스마트롱숏50증권자 투자신탁1호(주식혼합)종류F	95.11	6		
2	단기상품 은대(국민은행)	4.89	7		
3			8		
4			9		
5			10		

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 집합투자증권

(단위 : 최수, 백만원, %)

종목명	종류	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
미래에셋스마트롱숏50증권자 투자신탁1호(주식혼합)종류F	주식형	74	82	대한민국	KRW	95.11

※ 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	2018-01-25	4	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	2,646,562			2119000125
이대석	차장	38	78	2,646,562			2120001220
김태현	과장	37	78	2,646,562			2119000109
최명혁	사원	28	78	2,646,562			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
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	0	0.00	0	0.00
판매회사	0	0.15	0	0.15
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00
보수합계	0	0.16	0	0.16
기타비용	0	0.00	0	0.00
매매· 중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0	0.00
	조사분석업무 등 서비스수수료	0	0	0.00
합계	0	0.00	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	0.6317	0	0.6317
당기	0.6317	0	0.6317

※ 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.

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