

G1009 빅데이터국내주식형

※ 공지 사항

1. 자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 '자본시장법')에 의해 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	2020.10.01 ~ 2020.12.31	종속기간	추가형으로 별도의 종속기간이 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)	6,619	8,023	21.22
	부채 총액 (B)	26	5	-81.52
	순자산총액 (C=A-B)	6,593	8,019	21.62
	발행 수익증권 총 수 (D)	6,634	6,626	-0.13
	기준가격 (E=C/D×1000)	993.84	1,210.25	21.78

※ 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

4분기 국내 증시는 상승하였습니다. 10월 미국과 유럽 등의 코로나19 재확산으로 글로벌 증시에 대한 우려가 높아진 가운데, 연말 대주주 의견 강화 등의 세계 이슈로 투자 심리가 약화되면서 국내 주식 시장은 하락하였습니다. 하지만 11월에 중국의 기업실지표 호조와 미국 대선 불확실성 완화 등으로 투자심리가 개선된 가운데, 백신 개발 기대감과 주요 국가의 추가적인 경기 부양 정책에 대한 기대감으로 주식 시장은 상승하였습니다. 이후 완화 강세와 반도체 업황 개선 기대감 및 국내 기업의 실적 개선 기대감이 이어지면서 12월에도 국내 주식 시장은 상승세를 이어갔습니다. 코로나19 백신의 긴급 사용이 승인된 점도 투자 심리에 긍정적인 영향을 주었습니다. 펀드에서는 IT 등 일부 섹터에서의 자산 배분 효과가 부정적으로 작용하면서 시장 대비 소폭 저조한 성과를 거두었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

미국 등 주요 지역의 대외 불확실성 증가가 예상되나, 국내 주요 경제지표는 양호한 모습을 보일 것으로 예상됩니다. 글로벌 경기회복에 대한 기대가 지속되면서 국내 기업의 실적 기대감은 주식 시장에 긍정적인 영향을 주는 요인으로 작용할 것입니다. 대내외적으로 증시의 변동성을 유발할 수 있는 요인이 유념하며 펀드를 운용하도록 하겠습니다. 펀드에서는 매월 초 주식 종목에 대한 빅데이터 분석을 통해 개별 종목의 투자 비중을 결정하고 있습니다. 1월 초 리밸런싱을 통해 펀드에서는 전월 대비 IT와 커뮤니케이션서비스 센터의 비중을 확대하고, 산업재, 헬스케어, 에너지, 필수소비재 등의 섹터 비중을 축소하여 운용할 계획입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
빅데이터국내주식형	21.78	31.00	53.96	29.15

※ 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	29.15	46.57	-	-

※ 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	330	0	0	129	17	0	0	0	0	1	-16	460
당기	1,091	0	0	332	26	0	0	0	0	1	-19	1,431

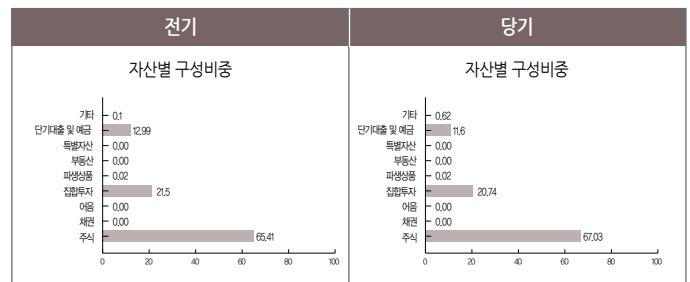
3. 자산현황

▶ 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)	5,378 (67.03)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,664 (20.74)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	931 (11.60)	50 (0.62)	8,023 (100.00)
합계	5,378	0	0	1,664	0	0	0	0	0	931	50	8,023

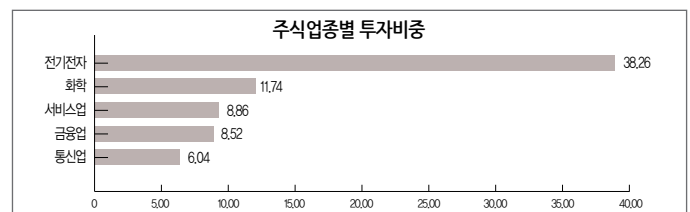
※ () : 구성비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

업종명	비중	업종명	비중
1 전기전자	38.26	6 운수장비	5.24
2 화학	11.74	7 유통업	3.99
3 서비스업	8.86	8 보험	3.66
4 금융업	8.52	9 의약품	3.45
5 통신업	6.04	10 기타	10.24



※ 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다.

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	집합투자증권 TIGER 200	20.74	6	주식 LG생활건강	2.24
2	주식 삼성전자	18.54	7	주식 SK텔레콤	2.20
3	단기상품 KDB저금증기REPO매수(20201231)	6.23	8	주식 KT&G	2.04
4	단기상품 은대(국민은행)	5.37	9	주식 삼성물산	2.03
5	주식 LG전자	2.78	10	주식 한국전력	1.75

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	18,369	1,488	18.5	대한민국	KRW	전기전자	
LG전자	1,651	223	2.8	대한민국	KRW	전기전자	
LG생활건강	111	180	2.2	대한민국	KRW	화학	
SK텔레콤	743	177	2.2	대한민국	KRW	통신업	
KT&G	1,971	164	2.0	대한민국	KRW	KOSPI 미분류	
삼성물산	1,178	163	2.0	대한민국	KRW	유통업	
한국전력	5,118	140	1.8	대한민국	KRW	전기기업	

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

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
TIGER 200	수익증권	1,567	1,664	대한민국	KRW	20.74

※ 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	2020-12-31	500	0.69		대한민국	KRW
예금	국민은행	2018-01-09	431	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 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	8	0.11	
펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수합계	12	0.18	13	0.18	
기타비용	0	0.00	0	0.00	
매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	2	0.02	2	0.03
	조사분석업무 등 서비스수수료	0	0.00	0	0.00
	합계	2	0.02	2	0.03
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	0.7296	0.0744	0.804
당기	0.7295	0.0974	0.8269

※ 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.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매 회전을	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
19,396	1,363	15,208	1,358	28.45	112.87

※ 매매회전을이란 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균금액으로 나눈 비율입니다. 매매회전이 높을수록 매매거래수수료(0.1% 내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

2020-04-01 ~ 2020-06-30	2020-07-01 ~ 2020-09-30	2020-10-01 ~ 2020-12-31
33.97	28.61	28.45