

A5004 글로벌인덱스RC

※ 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 글로벌인덱스RC의 자산운용회사인 ABL생명보험이 작성하며 펀드재산보관회사(신탁업자)인 우리은행의 확인을 받아 판매회사인 ABL생명보험을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.
3. 자사는 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 금융투자법에 관한 법률

펀드명칭	글로벌인덱스RC		
금융투자협회 펀드코드	AA502		
펀드의 종류	변액보험, 추가형, 중류형	최초설정일	2012.04.20
운용기간	2021.07.01 ~ 2021.09.30	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간 없음
자산운용회사	ABL생명보험	펀드재산보관회사	우리은행
판매회사	ABL생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	국내의 주식 및 주식관련 파생상품, 주식형집합투자증권, 상장지수집합투자증권 등에 순자산(NAV)의 90%이내로 투자하고, 나머지는 채권 및 유동성자산에 투자하는 펀드입니다. 글로벌 주식 인덱스 수익률의 변동성에 따라 펀드 내 글로벌 주식 인덱스를 추종하는 기초자산의 투자비율을 주기적으로 조절합니다. 일반적으로 변동성이 높을 때에는 펀드 내 글로벌 주식 인덱스를 추종하는 기초자산의 투자비율을 줄이고, 반대로 변동성이 낮을 때에는 글로벌 주식 인덱스를 추종하는 기초자산의 투자비율을 높이는 전략을 사용합니다.		

▶ 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
글로벌인덱스RC	자산 총액 (A)	443,279	410,482	-7.40
	부채 총액 (B)	307	391	27.50
	순자산총액 (C=A-B)	442,972	410,090	-7.42
	발행 수익증권 총수 (D)	256,098	248,985	-2.78
	기준가격 (E=C/D × 1000)	1,729.70	1,647.05	-4.78

※ 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

3분기 글로벌 증시는 상승하였습니다. 미국 FDA 화이자 백신 승인 소식과 견고한 고용 지표 발표, 그리고 미국 기업 실적 호조 등의 호재가 경기 낙관론으로 증시 상승 요인으로 작용하였습니다. 하지만 아프리카 니스탄 관련한 지정학적 리스크와 중국 헝타그룹의 파산 위기, 그리고 미국 디폴트 가능성 등이 리스크 요인 프 심리를 촉발했던 점은 증시에 부정적으로 작용하기도 했습니다. 분기 말에는 인플레이션 압력이 심화되면서 Fed가 긴축적 스탠스를 취함에 따라, 채권금리가 크게 상승하며 기술주 중심으로 큰 하락세를 나타냈습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

4분기 글로벌 증시는 점진적 통화정책 정상화가 개시되며 글로벌 금리 상승에 동조할 것으로 보인다는 점에서 약보합 흐름을 보일 것으로 전망합니다. 미 연준은 내년도 미국 GDP 성장률을 3.3%에서 3.8%로 전망치를 상향한 사실과 함께, 주요 선진국 중앙은행들이 매파적 스탠스로 전환했다는 점에서 금리 상방 압력을 받을 예정입니다. 하지만 매파 성장의 연준 인사들이 사퇴하면서 Fed의 완화적 목소리가 강화될 것이라는 점과 바이든 정부의 인프라 확장정책이 순탄하게 하임을 통과할 것이라는 점, 그리고 미국과 유럽에서의 델타변이 확산세가 감소하고 있는 점은 글로벌 증시의 하방을 제한하는 요인으로 작용할 것으로 전망됩니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위: %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
글로벌인덱스RC	-4.78	-0.91	2.99	14.23

※ 비교지수(벤치마크): (주)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
글로벌인덱스RC	14.23	22.07	17.50	35.86

※ 비교지수(벤치마크): (주)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	집합투자	장내	장외		실물 자산	기타			
전기	0	-419	0	239	18,476	0	0	0	0	-688	-299	17,310
당기	0	395	0	-361	-24,104	0	0	0	0	660	2,370	-21,040

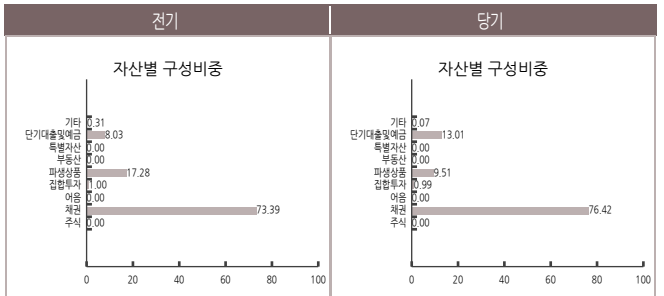
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물 자산	기타			
HKD	0	0	0	0	15,355	0	0	0	0	0	0	15,355
(152.03)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(3.74)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(3.74)
USD	0	0	0	0	23,283	0	0	0	0	0	0	23,283
(1184.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(5.67)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(5.67)
KRW	0	313,704	0	4,046	408	0	0	0	0	53,406	280	371,843
(1.00)	(0.00)	(76.42)	(0.00)	(0.99)	(0.10)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(13.01)	(0.07)	(90.59)
합 계	0	313,704	0	4,046	39,046	0	0	0	0	53,406	280	410,481

※ (): 구성비중



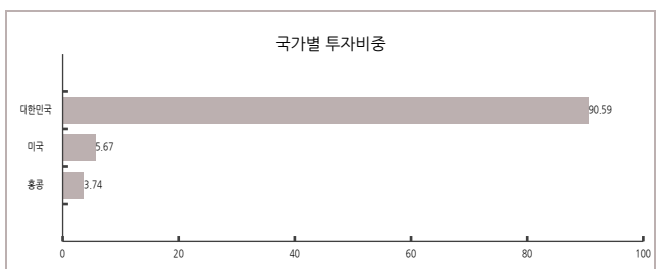
※ 동 펀드의 파생상품 투자는 주로 주가지수 선물을 이용하고 있으며, 상기 표시된 파생상품 투자비중은 선물계약금액의 일정 비율인 증거금 기준으로 나타내었습니다. 선물을 이용한 투자는 계약금액의 일정 비율인 증거금만으로 거래가 가능하므로 증거금을 제외한 계약금액은 주로 채권, 단기대출 및 예금에 투자하여 운용되고 있습니다.

※ 동 펀드는 당분기 말 기준으로 S&P500지수선물 36%, HSCER지수선물 11%, K200지수선물 17%의 포지션을 유지하고 있습니다.

▶ 국가별 투자비중

(단위: %)

	국가명	비중	국가명	비중
1	대한민국	90.59		
2	미국	5.67		
3	홍콩	3.74		
4				
5		10		



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위: %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중	
1	단기상품	은대(우리은행)	6	채권	통안00710-2208-02	4.50
2	채권	국고01875-2203(16-10)	7	채권	통안00890-2212-02	3.88
3	채권	국고02000-2209(17-4)	8	단기상품	증거금(한국투자증권)	3.72
4	단기상품	증거금(신한금융투자)	9	채권	국고03000-2409(14-5)	2.53
5	채권	국고01000-2306(20-3)	10	채권	산금19신인0300-1120-2	2.45

※ 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

※ 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적, 반복적으로 지출된 비용으로서 매매, 증거금수수료는 제외된 것입니다.

※ 성과보수내역: 해당 없음

※ 발행분담금내역: 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위: 연환산, %)

	총보수·비용비율(A)	매매·증개수수료 비율(B)	합계(A+B)
전기	0.6595	0.1381	0.7976
당기	0.6594	0.1218	0.7812

※ 총보수 비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균액(보수비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수비용수준을 나타냅니다.

※ 매매증개수수료 비율이란 매매증개수수료를 순자산 연평균액(보수비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매증개수수료의 수준을 나타냅니다.

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 채권

(단위: 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
국고01875-2203(16-10)	29,200	29,369	대한민국	KRW	2017-03-10	2022-03-10		N/A	7.15
국고02000-2209(17-4)	23,000	23,222	대한민국	KRW	2017-09-10	2022-09-10		N/A	5.66
국고01000-2306(20-3)	19,400	19,329	대한민국	KRW	2020-06-10	2023-06-10		N/A	4.71
통안00710-2208-02	18,500	18,467	대한민국	KRW	2020-08-02	2022-08-02		N/A	4.50
통안00890-2212-02	16,000	15,939	대한민국	KRW	2020-12-02	2022-12-02		N/A	3.88
국고03000-2409(14-5)	10,000	10,405	대한민국	KRW	2014-09-10	2024-09-10		N/A	2.53
산금19신인0300-1120-2	10,000	10,043	대한민국	KRW	2019-11-20	2022-11-20		AAA	2.45

※ 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	우리은행	2012-04-20	32,568	0.46	-	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 일임계약운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
최미영	부사장	42	81	2,556,282	-	-	2119000125
이대석	차장	39	81	2,556,282	-	-	2120001220
김태현	과장	38	81	2,556,282	-	-	2119000109
윤유라	대리	29	81	2,556,282	-	-	2121001284

※ 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. (인터넷주소: <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 현회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2019.01.25 ~ 현재	최미영
2020.09.17 ~ 현재	이대석
2019.01.24 ~ 현재	김태현
2021.07.16 ~ 현재	윤유라

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 백만원, %)

구분	전기		당기		
	금액	비율	금액	비율	
자산운용사	217	0.05	214	0.05	
판매회사	467	0.11	461	0.11	
펀드재산보관회사(신탁업자)	11	0.00	11	0.00	
일반사무관리회사	18	0.00	18	0.00	
보수합계	714	0.16	704	0.17	
기타비용	2	0.00	2	0.00	
매매 증개수수료	단순매매 증개수수료	111	0.03	126	0.03
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
	합계	111	0.03	126	0.03
증권거래세	0	0.00	0	0.00	