

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 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 우리은행의 확인을 받아 판매회사인 ABL생명보험을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 위탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 위탁된 날 이후 기간에 한합니다.
3. 자산은 이스포츠프링자산운용에 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	고난도펀드 여부	해당하지 않음
펀드의 종류	변액보험 변액보험, 개방형, 추가형, 종류형	최초설정일	2012.04.20
운용기간	2024.04.01 ~ 2024.06.30	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, 백만과, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
글로벌인덱스RC	자산 총액 (A)	338,556	337,595	-0.28
	부채 총액 (B)	5,709	443	-92.25
	순자산총액 (C=A-B)	332,847	337,153	1.29
	발행 수익증권 총수 (D)	222,328	221,265	-0.48
	기준가격 (E=C/D×1000)	1,497.10	1,523.75	1.78

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

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

2분기 미국 증시는 주요 물가 지표의 완화세와 주요 글로벌 테크 기업의 실적 발표가 상승세를 이끌었습니다. 한국의 경우도 미국 시장의 흐름에 맞춰서 기술주 중심으로 상승하는 모습을 보였습니다. 하지만, 여전히 보수적인 미국 연준의 통화정책에 대한 스탠스로 인해 상승폭은 다소 제한되는 모습을 보였습니다. 중국의 경우 5월 부동산 및 소비 지표 둔화, 미국/유럽의 대중국 규제 강화 등에 증시가 하락하는 모습을 보였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

3분기 글로벌 증시는 상승 흐름을 보일 것으로 전망합니다. 글로벌 빅테크 기업에 대한 성장 기대감은 글로벌 증시에 긍정적 요인으로 작용할 것으로 전망합니다. 또한, 주요국 물가 안정으로 인한 기준금리 인하 기대감이 글로벌 증시 상승세로 이어질 것으로 예상합니다. 하지만, 미국 대선 이슈, 해소되지 않은 중동 및 동유럽 지역의 지정학적 리스크는 글로벌 증시의 상승을 제한할 가능성이 있습니다. 펀드는 글로벌 시장을 면밀히 관찰하고 리스크가 높은 시기에는 방어적인 모습을, 상승장에는 고수익을 달성하도록 운용할 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위: %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
글로벌인덱스RC	1.78	6.70	12.80	9.91

※ 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	9.91	6.32	-11.91	10.24

※ 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		실물자산	기타			
전기	-	1,564	-	184	12,101	-	-	-	-	888	-167	14,571
당기	-	3,298	-	107	1,236	-	-	-	-	333	298	5,272

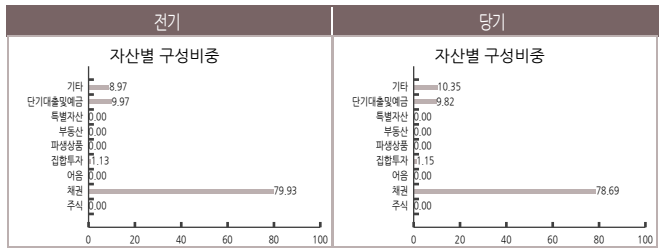
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
HKD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
(176.33)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)
USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
(1,376.70)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)
KRW	0	265,641	0	3,882	0	0	0	0	0	33,148	34,924	337,595
(1.00)	(0.00)	(78.69)	(0.00)	(1.15)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(9.82)	(10.35)	(100.00)
합계	0	265,641	0	3,882	0	0	0	0	0	33,148	34,924	337,595

※ (): 구성비중



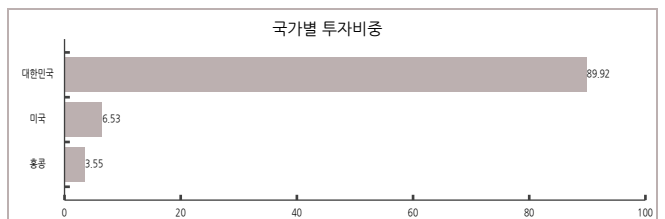
※ 동 펀드의 파생상품 투자는 주로 주가지수 선물을 이용하고 있으며, 파생상품 투자비중은 선물계약금액의 일정 비율인 증거금 금액 기준으로 상기 기타 KRW 구분에 나타났습니다. 선물을 이용한 투자는 계약금액의 일정 비율인 증거금만으로 거래가 가능하므로 증거금을 제외한 계약금액은 주로 채권, 단기대출 및 예금에 투자하여 운용되고 있습니다.

※ 동 펀드는 당분기 말 기준으로 S&P500지수선물 43%, HSCER지수선물 29%, K200지수선물 14%의 포지션을 유지하고 있습니다.

▶ 국가별 투자비중

(단위: %)

	국가명	비중	국가명	비중
1	대한민국	89.92		
2	미국	6.53		
3	홍콩	3.55		
4				
5				



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위: %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	채권	국04125-3312(23-11)	15.85	6	기타	증거금(한국투자증권)	3.54
2	채권	국03500-2809(23-6)	8.87	7	채권	국03875-2612(23-10)	3.32
3	채권	국03125-2506(22-4)	8.65	8	기타	증거금(대신증권)	3.27
4	단기상품	은대(우리은행)	5.05	9	기타	증거금(유니투자선물(해외))	3.27
5	채권	국01875-2412(21-10)	4.57	10	채권	국05250-2703(07-3)	3.16

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 채권

(단위: 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보유기간	신용등급	비중
국04125-3312(23-11)	50,000	53,524	대한민국	KRW	2023-12-10	2033-12-10		N/A	15.85
국03500-2809(23-6)	29,300	29,932	대한민국	KRW	2023-09-10	2028-09-10		N/A	8.87
국03125-2506(22-4)	29,200	29,206	대한민국	KRW	2022-06-10	2025-06-10		N/A	8.65
국01875-2412(21-10)	15,500	15,434	대한민국	KRW	2021-12-10	2024-12-10		N/A	4.57
국03875-2612(23-10)	11,000	11,194	대한민국	KRW	2023-12-10	2026-12-10		N/A	3.32
국05250-2703(07-3)	10,000	10,680	대한민국	KRW	2007-03-10	2027-03-10		N/A	3.16

※ 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	17,054	2.99	-	대한민국	KRW

* 투자대상 상위 10종목 및 평균금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

-재해 등의 위기상황 발생 시 리스크 관리, 투자 자산 모니터링 등 회사의 주요 기능이 계속 수행 될 수 있도록 사업연 속성계획(BCP)을 마련하고 있습니다.

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위: 개, 백만원)

성명	직위	운용중인 펀드 현황		협회등록번호
		펀드개수	운용규모	
최미영	부사장	76	2,353,237	2119000125
김태현	차장	76	2,353,237	2119000109
윤유라	과장	76	2,353,237	2121001284
이수민	사원	76	2,353,237	2124000320

* 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://ds.kofia.or.kr>) 단, 현회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상 이할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2019.01.25 ~ 현재	최미영
2019.01.24 ~ 현재	김태현
2021.07.16 ~ 현재	윤유라
2024.03.15 ~ 현재	이수민

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 백만원, %)

구분	전기		당기		
	금액	비율	금액	비율	
자산운용사	154	0.05	162	0.05	
판매회사	332	0.11	348	0.11	
펀드재산보관회사(신탁업자)	8	-	8	-	
일반사무관리회사	13	-	14	-	
보수합계	507	0.16	532	0.16	
기타비용	1	-	1	-	
매매 중개수수료	단순매매 중개수수료	103	0.03	117	0.04
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0	-	0	-
	합계	103	0.03	117	0.04
증권거래세	0	-	0	-	

* 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

* ESG관련내역: 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위: 연환산, %)

	총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
전기	0.6592	0.1339	0.7931
당기	0.6591	0.1445	0.8036

* 총보수비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균잔액(보수비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총보수비용수준을 나타냅니다.

* 매매 중개수수료 비율이란 매매 중개수수료를 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자 자가 부담한 매매 중개수수료의 수준을 나타냅니다.

6. 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

가. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

- 시장위험 및 개별증권위험: 이 투자신탁은 집합투자증권, 주식, 채권 등 증권에 투자함으로써 개별증권의 가격 변동 및 기타 가치경제지표의 변화에 따른 위험에 노출됩니다. 또한 예상하지 못한 정치·경제상황 등도 운용에 영향을 미칠 수 있으며, 이에 따른 투자원금 손실이 발생할 수 있습니다.

- 유동성 위험: 이 투자신탁에서 투자하는 증권, 채권 등 자산의 시장규모 등을 감안할 때 거래량이 풍부하지 못한 종목에 투자하는 경우 유동성 부족에 따른 환금성 제약이 발생할 수 있으며, 이로 인한 환매 연기나 거래비용 증가 등으로 기회비용 발생과 함께 투자원금 손실이 발생할 수 있습니다.

▶ 주요 위험 관리 방안

가. 펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 등

- 신탁약관 및 법규에 따라 투자한도 및 모든 법적 규제 등이 철저히 준수되도록 관리 되고 있으며, 내부 투자 가이드라인에 의거하여 투자 전략의 점검, 성과 측정과 위험 관리가 이루어지고 있습니다.

나. 재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한과 수단 등
 해당사항 없음

▶ 주요 비상대응계획