

G2004 글로벌착한기업ESG

※ 공지 사항

1. 자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특장기간(3개월)동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.)
2. 이 보고서는 자본시장법에 의해 글로벌착한기업ESG의 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 한국투자신탁운용에 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	글로벌착한기업ESG		
금융투자협회 펀드코드	DE848	고난도펀드 여부	해당하지 않음
펀드의 종류	변액보통, 변액보통, 일반형	최초설정일	2021.01.04
운용기간	2026.04.01 ~ 2026.06.30	존속기간	
자산운용회사	ABL생명보험	펀드재산보관회사	국민은행
판매회사	ABL생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	전통적인 재무적 요소뿐만 아니라 환경(Environment), 사회(Social), 지배구조(Governance) 등 비재무적 요소까지 고려하여 기업의 지속성장성과 사회적 책임 측면에서 기업의 가치를 평가하여 국내외 집합투자증권, 상장지수집합투자증권 또는 관련 파생상품 등에 순자산의 100% 이내에서 투자하고, 나머지는 유동성 확보를 위하여 유동성 자산에 투자합니다.		

▶ 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
글로벌착한기업ESG	자산총액 (A)	2,132	2,218	4.07
	부채총액 (B)	25	10	-61.90
	순자산총액 (C=A-B)	2,107	2,209	4.86
	발행 수익증권 총수 (D)	1,876	1,711	-8.80
	기준가격 (E=C/D × 1000)	1,123.04	1,291.26	14.98

※ 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 인출(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 글로벌주식은 중등 지정 리스크 재확대로 월 초 중반 조정을 받았으나, 월말 미안한 평화협상 진전과 유가 안정에 힘입어 낙폭을 일부 만회하며 소폭 하락 마감했습니다. 이러한 환경 속에서 동 펀드는 부진한 수익률을 기록했습니다. 유가 급등 국면에서 친환경 및 전력 인프라 관련주가 약세를 보이며 성과에 부담으로 작용했으나, 이후 협상 진전과 유가 안정으로 낙폭을 일부 회복했습니다. AI 인프라 투자 확대가 데이터센터 전력 수요를 빠르게 끌어올리고 있어 친환경 에너지 산업의 중장기 성장 가능성은 여전히 유효하다고 판단합니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

3분기 글로벌주식은 AI 설비투자 사이클 확장 및 미안한 평화협상 이행, 연준의 통화정책 방향이 핵심 변수로 작용할 전망입니다. 이러한 환경 속에서 친환경 에너지 산업은 대형 IT 기업들의 재생에너지 직접 투자가 확대되는 가운데, AI 데이터센터발 전력 수요 급증을 동력으로 구조적 성장 모멘텀을 이어갈 것으로 판단합니다.

펀드는 자율주행·저탄소·태양광 ESG 종목을 균형 있게 편입하여 운용할 예정이며, 성과 지속 가능성이 높은 테마 중심의 선별적 투자와 분산 전략을 통해 안정적인 수익 창출을 도모할 계획입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위: %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
글로벌착한기업ESG	14.98	8.23	11.18	18.61

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

(단위: %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
글로벌착한기업ESG	18.61	27.44	38.35	21.45

* 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	2	-	-	-5	-129	-	-	-	-	1	1	-129
당기	7	-	-	322	-26	-	-	-	-	1	7	311

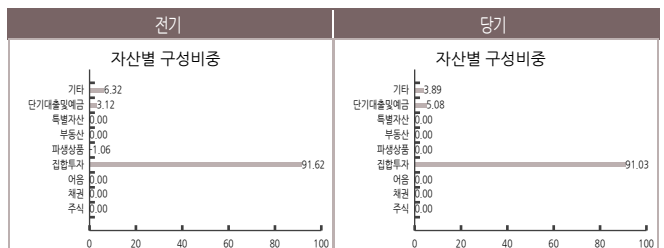
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
USD	0	0	0	1,987	0	0	0	0	0	2	0	1,989
(1,549.40)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(89.55)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.11)	(0.00)	(89.66)
KRW	0	0	0	33	0	0	0	0	0	110	86	229
(1.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(1.47)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(4.97)	(3.89)	(10.34)
합 계	0	0	0	2,020	0	0	0	0	0	112	86	2,218

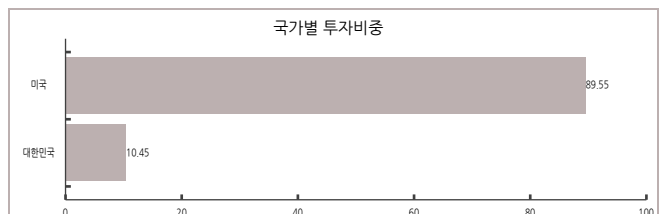
※ (): 구성비중



▶ 국가별 투자비중

(단위: %)

	국가명	비중		국가명	비중
1	미국	89.55	6		
2	대한민국	10.45	7		
3			8		
4			9		
5			10		



▶ 환헤지에 관한 사항

환헤지란?	- 환헤지란 환율 변동으로 인한 외화표시자산의 가치변동위험을 선물환 계약 등을 이용하여 줄이는 것을 말하며, 환헤지 비율은 기준일 현재 펀드에서 보유하고 있는 총 외화자산의 평가액 대비, 환헤지 규모를 비율로 표시한 것을 말합니다.
펀드수익률에 미치는 효과	- 환율이 하락할 경우 (원화강세) : 펀드내 기초자산은 환율 하락분 만큼 환 평가손실이 발생하나, 상대적으로 환헤지로 인해 환헤지 비율만큼의 환헤지 이익이 발생합니다. - 환율이 상승할 경우 (원화약세) : 펀드내 기초자산은 환율 상승분 만큼 환 평가이익이 발생하나, 상대적으로 환헤지로 인해 환헤지 비율만큼의 환헤지 손실이 발생합니다. - 환헤지를 통하여 환율 변동으로 인한 외화표시자산의 가치변동 위험을 줄이는 효과가 존재하기는 하지만, 해당 펀드 수익률이 환율변동위험에서 완전히 자유로운 것을 의미하는 것은 아닙니다. - 또한, 환헤지를 실시할 경우 거래 수수료 등의 추가적인 비용이 소요되어 펀드수익률에 부정적인 영향을 줄 수도 있습니다.

(단위: %, 백만원)

투자설명서 상의 목표 환헤지 비율	기준일(26.06.30) 현재 환헤지 비율	환헤지 비용 (26.04.01 ~ 26.06.30)	환헤지로 인한 손익 (26.04.01 ~ 26.06.30)
-	99.6	환헤지 비용은 환헤지 관련 파생상품의 계약환율에 포함되어 있어 별도의 산출이 불가능하며 환헤지로 발생한 손익 사항 역시 환율 변동때문에 자산가치의 상승/하락과 상응하는 환헤지손익을 정확히 산출하는 것은 불가능합니다.	

■ 환헤지를 위한 파생상품의 보유현황

▶ 통화선물

(단위: 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
미국달러 F202607	매도	128	1,982	

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위: %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	집합투자증권	ISHARES MSCI ACWI LOW CARBON	17.93	6	단기상품	은대(국민은행)	4.97
2	집합투자증권	VANGUARD ESG US STOCK ETF	11.49	7	집합투자증권	INVESTCO SOLAR ETF	4.43
3	집합투자증권	ISHARES ESG AWARE MSCI USA	11.42	8	집합투자증권	FRST TRUST GLOBAL WIND	4.35
4	집합투자증권	XTRACK MSCI USA CLIM ACT EQ	11.08	9	기타	중거금(넥스트증권(선물))	3.86
5	집합투자증권	VANGUARD ESG INTL STOCK ETF	6.73	10	집합투자증권	NUVEEN ESG INTERNATIONAL DEV	3.82

■ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 집합투자증권

(단위: 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
ISHARES MSCI ACWI LOW CARBON	수익증권	341	398	미국	USD	17.93
VANGUARD ESG US STOCK ETF	수익증권	220	255	미국	USD	11.49
ISHARES ESG AWARE MSCI USA	수익증권	217	253	미국	USD	11.42
XTRACK MSCI USA CLIMATE EQ	수익증권	221	246	미국	USD	11.08
VANGUARD ESG INTL STOCK ETF	수익증권	122	149	미국	USD	6.73
INVESTCO SOLAR ETF	수익증권	87	98	미국	USD	4.43
FRST TRUST GLOBAL WIND	수익증권	80	96	미국	USD	4.35
NUVEEN ESG INTERNATIONAL DEV	수익증권	72	85	미국	USD	3.82

※ 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 단기대출 및 예금

(단위: 개, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	국민은행	2021-01-04	110	2.07	-	대한민국	KRW

※ 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위: 개, 백만원)

성명	직위	운용중인 펀드 현황		협회등록번호
		펀드개수	운용규모	
최미영	부서장	73	2,900,392	2119000125
홍준표	사원	73	2,900,392	2126000492

※ 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, 현회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2019.01.25 ~ 현재	최미영
2026.04.08 ~ 현재	홍준표

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 백만원, %)

구분		전기		당기	
		금액	비율	금액	비율
자산운용사		1	0.04	1	0.04
판매회사		3	0.11	3	0.11
펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
일반사무관리회사		0	-	0	-
보수합계		4	0.16	4	0.16
기타비용		1	0.04	1	0.06
매매 중개수수료	단순매매 중개수수료	1	0.03	1	0.02
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0	-	0	-
	합계	1	0.03	1	0.02
증권거래세		0	-	0	-

※ 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

※ 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적, 반복적으로 지출된 비용으로서 매매 중개수수료는 제외하였습니다.

※ 성과보수내역: 해당 없음

※ 발행분담금내역: 해당 없음

※ ESG관련내역: 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위: 연환산, %)

	총보수: 비용비율(A)	매매: 중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
전기	0.8189	0.1298	0.9487
당기	0.8797	0.091	0.9707

※ 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 총 보수비용수준을 나타냅니다.

※ 매매 중개수수료 비율이란 매매 중개수수료를 순자산 연평균잔액(보수비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 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 거시경제지표의 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 증권은 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

- 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.

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