

자산운용보고서

(마이다스 퇴직연금 액티브 증권 자투자신탁 1호 (주식

(운용기간 : 2016년09월22일 ~ 2016년12월21일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다

마이다스에셋자산운용

서울시 영등포구 여의대로 66 KTB증권빌딩 8층
(전화 02-3787-3500, <http://www.midasasset.com>)

목 차

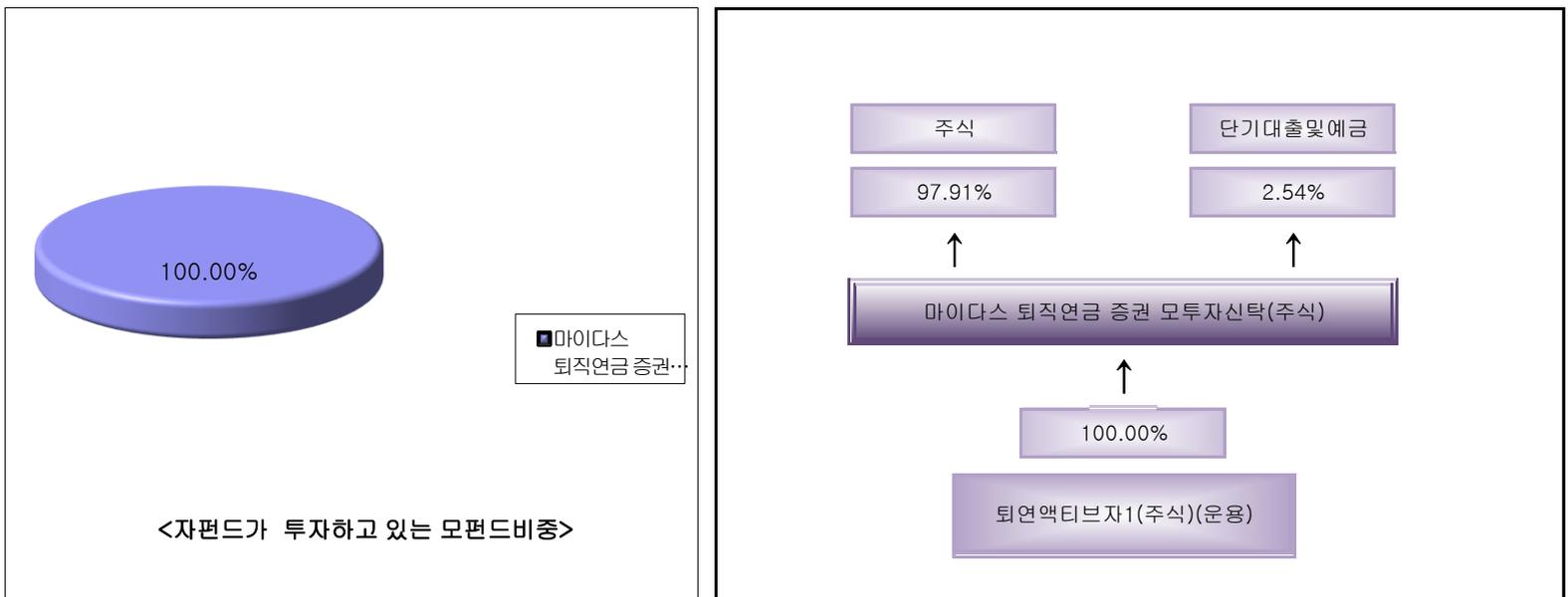
- 1 펀드의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 재산현황
- 2 운용경과 및 수익률현황
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 투자환경 및 운용계획
 - ▶ 기간(누적)수익률
 - ▶ 손익현황
- 3 자산현황
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 환헤지에 관한 사항
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 4 투자운용전문인력 현황
 - ▶ 투자운용인력
 - ▶ 운용전문인력 최근 변경 내역
- 5 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 6 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전율
 - ▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
마이다스 퇴직연금 액티브 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용), 마이다스 퇴직연금 액티브 증권 자투자신탁1호(주식) C-I, 마이다스 퇴직연금 증권 모투자신탁(주식)		2등급	A6886, 83599, 85530
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2012.03.22
운용기간	2016.09.22 ~ 2016.12.21	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이다스에셋자산운용	펀드재산보관회사	KEB하나은행
판매회사	신한금융투자	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	본 상품은 근로자퇴직급여보장법 관련법령에 의하여 수익자의 노후생활을 대비하기 위한 자금 마련을 목적으로 하는 투자신탁이며, 마이다스 퇴직연금 증권 모투자신탁(주식)에 신탁재산의 70%이상, 마이다스 퇴직연금 증권 모투자신탁(채권)에 신탁재산의 30%이하 투자하는 상품입니다. 마이다스 퇴직연금 증권 모투자신탁(주식)은 주식에 신탁재산의 90%이상을 투자하며, 적극적인 종목 선정을 통하여 벤치마크대비 초과성과를 얻는 것을 목표로 하고 있습니다. 자산의 70%이상 주식에 투자되는 특성상 유가, 환율, 금리 등 다양한 거시변수와 투자된 기업의 고유위험이 수익률에 영향을 미치는 특성을 가지고 있습니다.		

▶ 펀드 구성



※ 자펀드 자산현황을 100으로 가정하였을때 각 모펀드의 집합투자증권을 얼마만큼 투자하고 있는지를 보여줍니다.

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
퇴연액티브자1(주식)(운용)	자산 총액 (A)	1,009	972	-3.73
	부채 총액 (B)	0	0	0.00
	순자산총액 (C=A-B)	1,009	972	-3.73
	발행 수익증권 총 수 (D)	976	975	-0.10
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,033.89	996.36	-3.63
종류(Class)별 기준가격 현황				
퇴연액티브자1(주식)C-I	기준가격	960.61	924.82	-3.73

주) 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

--

▶ 투자환경 및 운용 계획

--

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
퇴연액티브자1(주식)(운용)	-3.63	-4.38	-3.72	-5.72
(비교지수 대비 성과)	(-3.73)	(-7.17)	(-6.14)	(-8.59)
종류(Class)별 현황				
퇴연액티브자1(주식)C-I	-3.73	-4.57	-4.01	-6.10
(비교지수 대비 성과)	(-3.82)	(-7.36)	(-6.43)	(-8.96)
비교지수(벤치마크)	0.10	2.79	2.42	2.87

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 100.0%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
퇴연액티브자1(주식)(운용)	-5.72	-0.16	-1.41	-
(비교지수 대비 성과)	(-8.59)	(-5.76)	(-4.16)	-
종류(Class)별 현황				
퇴연액티브자1(주식)C-I	-6.10	-0.96	-2.59	-
(비교지수 대비 성과)	(-8.96)	(-6.56)	(-5.35)	-
비교지수(벤치마크)	2.87	5.59	2.75	-

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 100.0%

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

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	-8	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-8
당기	-37	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-37

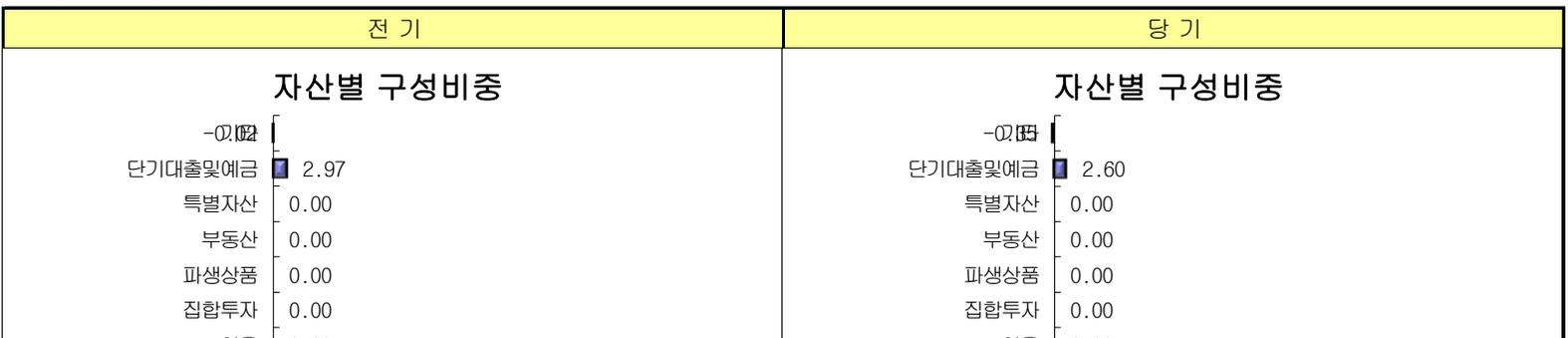
3. 자산현황

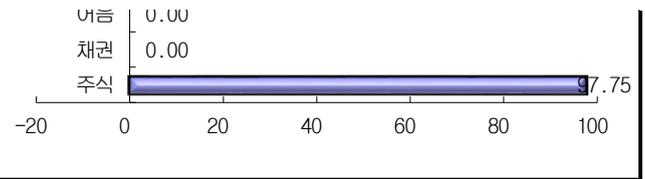
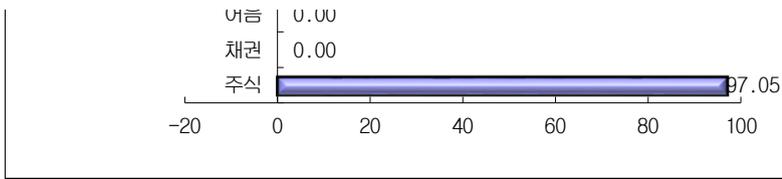
▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	950	0	0	0	0	0	0	0	0	25	-3	972
(0.00)	(97.75)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(2.60)	-(0.35)	(100.00)
합계	950	0	0	0	0	0	0	0	0	25	-3	972

* () : 구성 비중



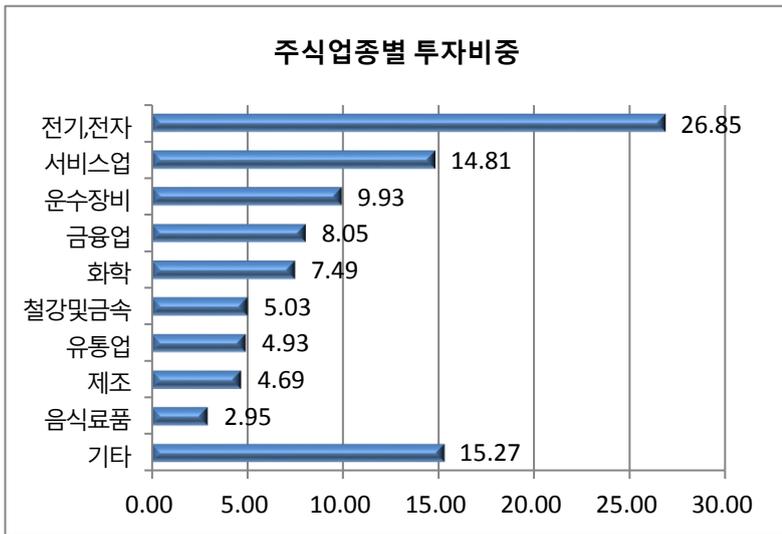


주) 위의 결과는 해당 자펀드의 실제 자산보유 내역을 투자자에게 보여주기 위해, 모펀드의 자산구성 내역을 해당 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율을 가중치로 적용하여 안분한 결과입니다. 실제 수익증권 기준으로 작성한 결과와 비교하여 상이한 결과가 발생할 수 있습니다.

▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기,전자	26.85	6	철강및금속	5.03
2	서비스업	14.81	7	유통업	4.93
3	운수장비	9.93	8	제조	4.69
4	금융업	8.05	9	음식료품	2.95
5	화학	7.49	10	기타	15.27



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	주식	삼성전자	18.89	6	단기상품	은대	2.60
2	주식	SK하이닉스	3.91	7	주식	현대모비스	2.58
3	주식	롯데케미칼	3.45	8	주식	KB금융	2.53
4	주식	SK	3.07	9	주식	SK이노베이션	2.45
5	주식	신한지주	2.68	10	주식	LG디스플레이	2.41

※보다 상세한 투자대상자산 내용은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다.(인터넷주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	102	183	18.89	대한민국	KRW	전기,전자	
SK하이닉스	843	38	3.91	대한민국	KRW	전기,전자	
롯데케미칼	96	34	3.45	대한민국	KRW	화학	
SK	132	30	3.07	대한민국	KRW	서비스업	
신한지주	545	26	2.68	대한민국	KRW	금융업	
현대모비스	95	25	2.58	대한민국	KRW	운수장비	
KB금융	559	25	2.53	대한민국	KRW	금융업	
SK이노베이션	162	24	2.45	대한민국	KRW	서비스업	
LG디스플레이	744	23	2.41	대한민국	KRW	전기,전자	

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

▶ 단기대출 및 예금

단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	KEB하나은행	2012-03-22	1	0.92		대한민국	KRW
예금	KEB하나은행	2008-07-08	25	0.92		대한민국	KRW

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

4. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

구분	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
퇴연액티브자1(주식)(운용)	자산운용사	0	0.00	0	0.00	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	0	0.00	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0.00	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
		증권거래세	0	0.00	0	0.00
퇴연액티브자1(주식)C-1	자산운용사	1	0.08	1	0.08	
	판매회사	0	0.01	0	0.01	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	1	0.10	1	0.10	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0.03	1	0.07
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	1	0.07
		증권거래세	0	0.04	1	0.10

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외한 것입니다.

※ 성과보수내역 :

※ 발행분담금내역 :

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

구분	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	중개수수료 비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
퇴연액티브자1(주식)(운용)	전기	0	0	0	0
	당기	0	0	0	0
종류(Class)별 현황					
퇴연액티브자1(주식)C-1	전기	0.4057	0	0.4057	0.175
	당기	0.4047	0	0.4047	0.1932

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

주3) 모자형의 경우 모펀드에서 발생한 비용을 자펀드가 차지하는 비율대로 안분하여 합산한 수치입니다.

5. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위 : 백만원, %)

퇴직연금(모펀드)(주식)

매수		매도		매매회전율주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산

7,049	332	4,595	334	35.92	144.08
-------	-----	-------	-----	-------	--------

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

▶ **최근 3분기 매매회전을 추이**

(단위 : %)

퇴직연금(모펀드)(주식)

16년03월22일 ~16년06월21일	16년06월22일 ~16년09월21일	16년09월22일 ~16년12월21일
12.62	15.15	35.92

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 퇴직연금 액티브 증권 자투자신탁 1호 (주식)(운용)의 자산운용회사인 '마이다스에셋자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 'KEB하나은행'의 확인을 받아 판매회사인 '신한금융투자'를 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용 <http://www.midasasset.co> / 02-3787-3500
 금융투자협회 <http://dis.fundservice.net>

고객님이 가입하신 펀드는 펀드의 운용규모가 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 233조 제3호 및 제4호)