

자산운용보고서

(마이다스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식

(운용기간 : 2017년03월17일 ~ 2017년06월16일)

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
 - ▶ 자산현황
- 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 회전을
 - ▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보

자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
마이더스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용), 마이더스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)C, 마이더스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)Ce, 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식), 마이더스 증권 모투자신탁(채권)		5등급	AP548, AQ127, AQ128, A9290, 53840
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2014.03.17
운용기간	2017.03.17 ~ 2017.06.16	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이더스에셋자산운용	펀드재산보관회사	KEB하나은행
판매회사	KB증권, KEB하나은행, NH농협은행, NH투자증권, 대구은행, 동부 증권, 미래에셋대우, 부산은행, 삼성생명보험, 삼성증권, 신한은행, 우리은행, 키움증권, 펀드온라인코리아, 하나금융투자, 한화투자증 권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	본 상품은 혼합형 펀드로서 주식에 70%~80%, 채권등에 30% 이하를 투자하고 있습니다. KOSPI등락률7%+매경BP 종합채권지수 1~2년물 수익률 93%를 벤치마크로 하여 벤치마크대비 초과성과를 목표로 하고 있습니다. 따라서 수익자는 주식형 펀드와 비교하여 상대적으로 안정된 수익을 기대할 수 있는 상품입니다. 통신폭 전략 등 다양한 절대수익 추구전략을 복합적으로 활용하여 투자위험을 축소하고, 국내 주식 매매차익에 대한 비과세로 주식투자부분에 대해 절세효과를 기대할 수 있습니다. 본 상품은 자산의 70%~80%까지 주식에 투자되는 특성상 유가, 환율, 금리 등 다양한 거시변수와 투자된 기업의 고유위험이 수익률에 영향을 미치는 특성을 가지고 있습니다.		

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
거북이70소장자1(주식)(운용)	자산 총액 (A)	11,469	12,316	7.38
	부채 총액 (B)	2	16	848.33
	순자산총액 (C=A-B)	11,467	12,300	7.26
	발행 수익증권 총 수 (D)	10,862	11,830	8.91
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,055.68	1,039.68	2.16
종류(Class)별 기준가격 현황				
거북이70소장자1(주식)C	기준가격	997.68	1,016.32	1.87
거북이70소장자1(주식)Ce	기준가격	1,001.18	1,019.57	1.96

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

해당 분기, 펀드는 A Class 기준 2.43%의 수익률을 기록해 비교지수를 1.32% 초과하는 성과를 거두었습니다. 6월 한달간 지수가 상승하면서
숏포지션에서의 손실이 확대된 점과 KOSPI200 내 가장 높은 비중인 삼성전자에 대한 비중이 낮은 점이 펀드 수익률에 부정적으로 작용했습니다.
하지만, 삼성전자 중심의 IT 업종 상승에서 SK하이닉스, LG디스플레이, 중소형 IT 종목 등으로 상승세가 확산되면서, IT업종 비중을 높게 유지한

점이 전체적으로 수익률에 긍정적으로 작용했습니다. 한편 바이오,증권 등 상승폭이 컸던 업종에 대해 높은 비중을 유지하다 적극적으로 차익실현은 병행한 점도 긍정적이었습니다. 월 중 삼화콘덴서,큐리언트,덴티움 등 가격 상승폭이 컸던 개별 종목에 대해서도 적극적인 매매를 병행한 점도 전체 수익률에는 긍정적으로 작용했습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

6월 KOSPI는 1.9% 상승하며 사상 최고가를 경신하는 등 전월에 이어 강세 흐름을 이어갔습니다. 월초 미국 IT업종의 가격 조정으로 SK하이닉스, 삼성전자 등 국내 IT 업종도 큰 폭의 조정을 보이기도 했으나, 반도체 가격 상승 및 OLED 시장 확대에 대한 기대감이 반영되면서, 사상 최고가를 경신하는 등 여전히 시장 주도주의 흐름을 보였습니다. 업종별로는 지수 상승에 따라 증권업종이 강세를 보인 가운데, 은행, 운송, 제약, IT,조선, 운송 업종을 상승을 보인 데 반해, 내수 소비재 및 건설, 유틸리티 등의 경우 전월 대비 하락하는 등 시장의 양극화가 심화되는 모습을 나타냈습니다.

7월은 KOSPI 상승세가 점차 둔화될 가능성이 있는 것으로 전망됩니다. 2분기 실적 시즌이 시작됨에 따라 월 중순까지 뚜렷한 모멘텀이 없는 가운데, 가파른 상승에 따른 차익 실현 및 경계 매물이 늘어날 것으로 예상되기 때문입니다. 또한 그 동안 시장 상승을 이끌었던 IT 업종도 업황 호조 지속과 실적 개선이라는 모멘텀에도 불구하고, 시장의 기대치가 이미 높아져 있다는 점 등을 고려할 때 실적 발표 이후 상승 탄력은 둔화될 가능성이 있는 상황입니다. 또한 우려 주안음해 및 조공구 투하 정책이 은둔성 추수 흐름으로 지해될 가능성이 있는 점도 부담 요인이 될 것으로 판단됩니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
거북이70소장자1(주식)(운용)	2.16	2.16	2.73	3.39
(비교지수 대비 성과)	(1.09)	(0.20)	(0.65)	(0.82)
종류(Class)별 현황				
거북이70소장자1(주식)C	1.87	1.57	1.85	2.20
(비교지수 대비 성과)	(0.79)	(-0.39)	(-0.24)	(-0.37)
거북이70소장자1(주식)Ce	1.96	1.75	2.12	2.55
(비교지수 대비 성과)	(0.88)	(-0.21)	(0.03)	(-0.01)
비교지수(벤치마크)	1.08	1.96	2.08	2.56

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 7.0%, 국고채1~2년 93.0%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
거북이70소장자1(주식)(운용)	3.39	2.76	7.70	-
(비교지수 대비 성과)	(0.82)	(-1.61)	(-0.42)	-
종류(Class)별 현황				
거북이70소장자1(주식)C	2.20	0.39	4.01	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.37)	(-3.97)	(-4.11)	-
거북이70소장자1(주식)Ce	2.55	1.10	5.11	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.01)	(-3.26)	(-3.01)	-
비교지수(벤치마크)	2.56	4.37	8.12	-

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 7.0%, 국고채1~2년 93.0%

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

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	448	14	0	13	-479	0	0	0	0	3	0	-1
당기	701	11	0	44	-508	0	0	0	0	4	5	257

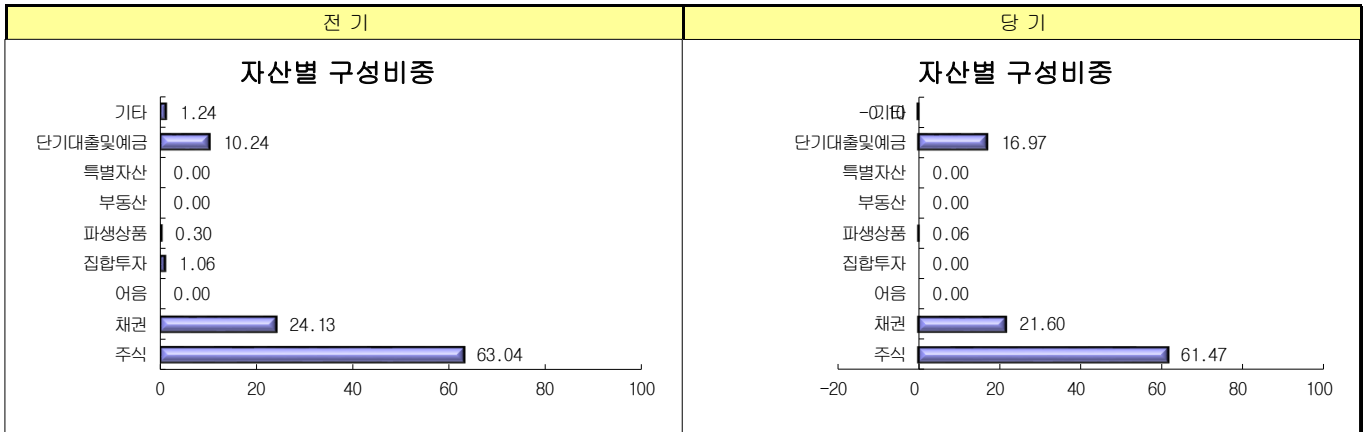
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	7,570	2,660	0	0	8	0	0	0	0	2,090	-12	12,316
(0.00)	(61.47)	(21.60)	(0.00)	(0.00)	(0.06)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(16.97)	-(0.10)	(100.00)
합계	7,570	2,660	0	0	8	0	0	0	0	2,090	-12	12,316

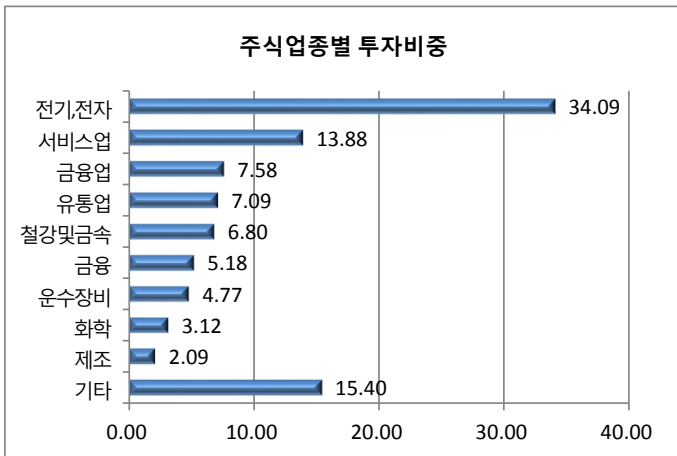
* () : 구성 비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기,전자	34.09	6	금융	5.18
2	서비스업	13.88	7	운수장비	4.77
3	금융업	7.58	8	화학	3.12
4	유통업	7.09	9	제조	2.09
5	철강및금속	6.80	10	기타	15.40



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	파생상품	코스피200 F 201709	54.77	6	채권	국고01250-1912(16-7)	5.13
2	주식	삼성전자	15.43	7	단기상품	은대	3.41
3	채권	통안0133-1810-02	7.78	8	주식	SK하이닉스	2.83
4	단기상품	REPO매수(20170616)	6.68	9	단기상품	REPO매수(20170616)	2.45
5	채권	통안0164-1902-02	5.20	10	단기상품	REPO매수(20170616)	2.28

※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	834	1,901	15.43	대한민국	KRW	전기,전자	
SK하이닉스	5,761	349	2.83	대한민국	KRW	전기,전자	

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

▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안0133-1810-02	958	958	대한민국	KRW	2016-10-02	2018-10-02		N/A	7.78
통안0164-1902-02	639	640	대한민국	KRW	2017-02-02	2019-02-02		N/A	5.20
국고01250-1912(16-7)	639	632	대한민국	KRW	2016-12-10	2019-12-10		N/A	5.13

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

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
코스피200 F 201709	매도	87	6,745	

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	KEB하나은행	2006-01-09	7	0.92		대한민국	KRW
예금	KEB하나은행	2012-03-06	192	0.92		대한민국	KRW
예금	KEB하나은행	2014-03-17	221	0.92		대한민국	KRW
REPO매수	NH투자증권	2017-06-16	281	1.28		대한민국	KRW
REPO매수	메리츠종합금융증권	2017-06-16	302	1.28		대한민국	KRW
REPO매수	NH투자증권	2017-06-16	823	1.28		대한민국	KRW

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

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력

(단위: 개, 백만원)

성명	직위	출생년도	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
채경섭	주식 책임운용역	1974	10	약 1,665억	-	-	21090000941
김지상	주식 부책임운용역	1975	10	약 1,225억	-	-	21150000373
오종록	채권 책임운용역	1973	10	약 1,719억	-	-	21090000845
정승호	채권 부책임운용역	1975	11	약 1,294억	-	-	21100000746

▶ 운용전문인력 최근 변경 내역

운용역	직위	운용 기간
허필석	주식-책임운용역	2012.03.05-2016.06.09
채경섭	주식-책임운용역	2016.06.10-현재

채경섭	주식-부책임용역	2015.01.12~2015.05.29
최종혁	주식-부책임용역	2015.01.12~2015.05.29
채경섭	주식-부책임용역	2015.06.01~2016.06.09
김지상	주식-부책임용역	2016.06.10-현재
오종록	채권-책임용역	2012.05.01-현재
정승호	채권-부책임용역	2014.10.01-현재

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
거북이70소장자1(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

!분기회전율펀드명

!회전율기간3	!회전율기간2	!회전율기간1
!회전율3	!회전율2	!회전율1

* 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, %)

		총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
거북이70소장자1(주식)(운용)	전기	0	11.06795777	11.06795777
	당기	0	13.75279859	13.75279859
종류(Class)별 현황				
거북이70소장자1(주식)	전기	1.1654	0.602066486	1.767466486

기타비(기타비용)(千円)	당기	1,1656	0.752631938	1.918231938
거북이70소장자1(주식)Ce	전기	0.8149	0.602066486	1.416966486
	당기	0.8152	0.752631938	1.567831938

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

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평잔액(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		매매회전율(주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
450,362	16,839	813,806	24,302	80.61	319.82

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

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

16년09월17일 ~16년12월16일	16년12월17일 ~17년03월16일	17년03월17일 ~17년06월16일
37.00	75.75	80.61

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용)의 자산운용회사인 '마이다스에셋자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 'KEB하나은행'의 확인을 받아 판매회사인

'KB증권, KEB하나은행, NH농협은행, NH투자증권, 대구은행, 동부증권, 미래에셋대우, 부산은행, 삼성생명보험, 삼성증권, 신한은행, 우리은행, 키움증권, 펀드온라인코리아, 하나금융투자, 한화투자증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 익월 예약된 날 이후 기가에 하합니다

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용
금융투자협회

<http://www.midasasset.com>
<http://dis.kofia.or.kr>

/ 02-3787-3500