

자산운용보고서

마이다스 거북이 50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합)(운용)

(운용기간 : 2017.07.07 ~ 2017.10.06)

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

마이다스에셋자산운용

서울시영등포구여의도동23-3

(전화 02-3787-3500, <http://www.midasasset.com/>)

목 차

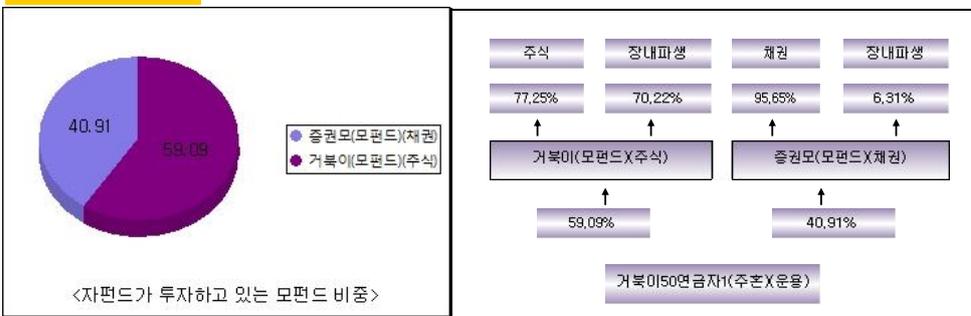
1. 펀드의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 자산현황
2. 운용경과 및 수익률현황
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 투자환경 및 운용계획
 - ▶ 기간(누적) 수익률
 - ▶ 손익현황
3. 자산현황
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 환해지에 관한 사항
 - ▶ 환해지를 위한 파생상품의 보유현황
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
4. 투자운용전문인력 현황
 - ▶ 투자운용인력(펀드매니저)
 - ▶ 해외 운용 수탁회사
5. 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
6. 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전율
 - ▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보 **자본시장과 금융투자업에 관한 법률**

펀드 명칭		금융투자협회 펀드코드	
거북이50연금자1(주혼)(운용), 거북이(모펀드)(주식), 채권모(모펀드)(채권), 거북이50연금자1(주혼)C, 거북이50연금자1(주혼)Ce, 거북이50연금자1(주혼)S		AL611, A9290, 53840, AL612, AL613, B7296	
펀드의 종류	혼합주식형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2013-10-07
운용기간	2017-07-07 ~ 2017-10-06	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이다스에셋자산운용(주)	펀드재산보관회사	KEB하나은행
판매회사	미래에셋대우, 하나금융투자, 삼성증권, KEB하나은행, NH투자증권, 한국투자증권, 신한금융투자, 유진투자증권, 삼성생명보험, 우리은행(판매), 한화투자증권.	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	본 상품은 혼합형 펀드로서 주식형 모투자신탁(마이다스 거북이 증권모투자신탁(주식))에 50%~60%, 채권형 모투자신탁(마이다스 증권모투자신탁(채권))에 50% 이하를 투자하고 있습니다. KOSPI등락률5%+매경BP 종합채권지수 1~2년물 수익률 95%를 벤치마크로 하여 벤치마크대비 초과성적을 목표로 하고 있습니다. 따라서 수익자는 주식형 펀드와 비교하여 상대적으로 안정된 수익을 기대할 수 있는 상품입니다. 통신폭락 등 다양한 절대수익 추구전략을 복합적으로 활용하여 투자위험을 축소하고, 국내 주식 매매차익에 대한 비과세로 주식투자부분에 대해 절세효과를 기대할 수 있습니다. 본 상품은 자산의 50%~60%까지 주식에 투자되는 특성상 유가, 환율, 금리 등 다양한 거시변수와 투자된 기업의 고유위험이 수익률에 영향을 미치는 특성을 가지고 있습니다.		

▶ 펀드 구성



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

▶ 자산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
거북이50연금자1(주혼)(운용)	자산 총액(A)	2,211	2,164	-2.13
	부채총액(B)		1	0.00
	순자산총액(C=A-B)	2,211	2,163	-2.16
	발행 수익증권 총 수(D)	2,063	2,013	-2.44
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,071.70	1,074.77	0.29
종류(Class)별 기준가격 현황				
거북이50연금자1(주혼)C	기준가격	1,012.86	1,012.73	-0.01
거북이50연금자1(주혼)Ce	기준가격	1,017.82	1,018.71	0.09
거북이50연금자1(주혼)S	기준가격	1,031.88	1,034.88	0.29

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.

※ 분배금내역

(단위: 백만원, 백만좌)

구분	분배금지급일	분배금지급금액	분배후수탁고	기준가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
거북이50연금자1(주혼)(운용)	2017.10.10.	14	2,026	1074.77	1067.92	
거북이50연금자1(주혼)C	2017.10.10.	13	2,012	1012.73	1006.41	
거북이50연금자1(주혼)Ce	2017.10.10.	1	131	1018.71	1010.27	
거북이50연금자1(주혼)S	2017.10.10.	0		1034.88	1018.29	

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

해당 분기 펀드는 -0.01%의 수익률을 기록하여 비교지수를 0.29% 하회하는 성과를 거두었습니다.

순포지션 (0.00)	961 (44.56)	831 (38.52)	0 (0)	367 (17.01)	-2 (0.09)	2,156 (100)							
----------------	----------------	----------------	----------	----------	----------	----------	----------	----------	----------	----------	----------------	--------------	----------------

▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기,전자	41.16	6	운수장비	3.94
2	금융업	15.64	7	철강및금속	3.93
3	화학	4.91	8	의약품	3.29
4	금융	4.50	9	유통업	2.74
5	서비스업	3.97	10	기타	15.92



주) 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다.

▶ 주식업종별 투자비중 : 매도(Short)포지션

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	화학	100.00			
2	기타	0.00			



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	파생상품	코스피200 F 201712	40.70	6	단기상품	REPO매수(20170929)	5.72
2	주식	삼성전자	13.33	7	채권	국고02750-1909(14-4)	4.30
3	채권	국고01500-1906(16-2)	8.44	8	채권	통안0164-1902-02	4.23
4	채권	통안0160-1904-02	8.42	9	채권	국민은행370901표일(03)2-11	4.21
5	단기상품	REPO매수(20170929)	5.72	10	채권	국고01250-1912(16-7)	4.18

주) 환율, 금리 등의 위험관리를 목적으로 보유중인 파생상품 종목은 제외하였습니다.

*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	113	289	13.33	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
국고01500-1906(16-2)	183	183	대한민국	KRW	2016-06-10	2019-06-10		N/A	8.44
통안0160-1904-02	183	182	대한민국	KRW	2017-04-02	2019-04-02		N/A	8.42
국고02750-1909(14-4)	91	93	대한민국	KRW	2014-09-10	2019-09-10		N/A	4.30
통안0164-1902-02	91	91	대한민국	KRW	2017-02-02	2019-02-02		N/A	4.23
국민은행370901표일(03)2-11	91	91	대한민국	KRW	2017-09-11	2019-09-11		AAA	4.21
국고01250-1912(16-7)	91	90	대한민국	KRW	2016-12-10	2019-12-10		N/A	4.18

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

(단위: 계약, 백만원)

▶ 장내파생상품

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
코스피200 F 201712	매도	11	881	

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
REPO매수	NH투자증권	2017-09-29	124	1.40		대한민국	KRW
REPO매수	미래에셋대우(채권상품)	2017-09-29	124	1.35		대한민국	KRW

주) 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 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
채경섭 ^{주)}	팀장	43	16	109,052	1	1,383	2109000941
오종록	파트장	1	1	10,290	6	221,546	2109000845
김지상	대리	32	0		0		2115000373
정승훈	부장	1	1	690,647	0		211000746

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임투자운용인력이며, '책임투자운용인력'이란 투자운용인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말합니다.

※ 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 상이 할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2016.06.10 ~ 현재	채경섭
2012.05.01 ~ 현재	오종록
2013.10.07 ~ 2016.06.09	허필석
2014.10.01 ~ 현재	정승호
2016.06.10 ~ 현재	김지상
2015.06.01 ~ 2016.06.09	채경섭

▶ 해외운용수탁회사

회사명	소재	국가명	비고

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급 현황

(단위: 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율 ^{주1)}	금액	비율 ^{주1)}	
거북이50연금자1(주준)(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 ^{주2)}	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 종개수수료	2	0.10	1	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	1	0.04
		합계	2	0.10	2	0.09
		증권거래세	3	0.13	2	0.10
거북이50연금자1(주준)C	자산운용사	2	0.09	2	0.09	
	판매회사	4	0.20	4	0.20	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
	보수합계	6	0.30	6	0.30	
	기타비용 ^{주2)}	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 종개수수료	2	0.10	1	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	1	0.04
		합계	2	0.11	2	0.09
		증권거래세	3	0.13	2	0.10
	자산운용사	0	0.09	0	0.09	
	판매회사	0	0.10	0	0.10	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	

거북이50연금자1(주혼)Ce	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
	보수합계	0	0.20	0	0.20	
	기타비용(주2)		0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료		0.10	0	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료		0.00	0	0.04
		합계		0.10	0	0.09
증권거래세			0.13	0	0.10	
거북이50연금자1(주혼)S	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(주2)		0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료		0.10	0	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료		0.00	0	0.04
		합계		0.11	0	0.09
		증권거래세		0.13	0	0.10

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율을 나타냅니다.

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

* 성과보수내역 : 없음

* 발행분담금내역 : 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위: 연환산,%)

	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	매매·중개수수료비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
거북이50연금자1(주혼)(운용)	전기	0.0038	0.303	0.3068	0
	당기	0.0037	0.3366	0.3403	0
종류(Class)별 현황					
거북이50연금자1(주혼)C	전기	1.1962	0.304	1.5002	0
	당기	1.1961	0.3371	1.5332	0
거북이50연금자1(주혼)Ce	전기	0.795	0.2955	1.0905	0
	당기	0.7944	0.337	1.1314	0
거북이50연금자1(주혼)S	전기	0.0039	0.3172	0.3211	0
	당기	0.0037	0.3395	0.3432	0

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.

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

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위: 백만원, %)

매수		매도		매매회전율 ^{*)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
218,099	9,400	572,271	15,778	66.82	265.10

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율을 나타냅니다.

▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이

(단위: %)

2017-01-07 ~ 2017-04-06	2017-04-07 ~ 2017-07-06	2017-07-07 ~ 2017-10-06
76.75	79.27	66.82

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이더스 거북이 50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합)(운용)의 자산운용회사인 마이더스에셋자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 KEB하나은행의 확인을 받아 한국예탁결제원을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이더스에셋자산운용(주) <http://www.midasasset.com/> 02-3787-3500
 금융투자협회 <http://dis.kofia.or.kr>