

자산운용보고서

마이다스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용)

(운용기간 : 2018.06.17 ~ 2018.09.16)

○ 자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 자본시장법)에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

마이다스에셋자산운용

서울시영등포구여의도동23-3

(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
 - ▶ 환헤지를 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		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
마이더스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용), 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식), 마이더스 증권 모투자신탁(채권), 마이더스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)C, 마이더스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)Ce		5등급	AP548, A9290, 53840, AQ127, AQ128
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2014.03.17
운용기간	2018.06.17 ~ 2018.09.16	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이더스에셋자산운용	펀드재산보관회사	KEB하나은행
판매회사	DB금융투자, KB증권, KEB하나은행, NH농협은행, NH투자증권, 대구은행, 미래에셋대우, 부산은행, 삼성생명보험, 삼성증권, 신한은행, 우리은행, 키움증권, 펀드온라인코리아, 하나금융투자, 한화투자증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	이 투자신탁은 자산의 대부분을 모투자신탁인 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)에 투자하여 모투자신탁이 투자하는 주식 및 채권으로부터의 자본이득과 이자/배당소득을 얻는 것을 목적으로 합니다.		

▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
거북이70소장자1(주식)(운용)	자산 총액(A)	14,653	14,669	0.11
	부채총액(B)	5	3	-48.07
	순자산총액(C=A-B)	14,647	14,666	0.13
	발행 수익증권 총 수(D)	13,994	14,454	3.28
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,046.67	1,014.68	-3.06
종류(Class)별 기준가격 현황				
거북이70소장자1(주식)C	기준가격	1,021.72	987.56	-3.34
거북이70소장자1(주식)Ce	기준가격	1,029.67	996.13	-3.26

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

펀드수익률은 C클래스 기준 -3.34%로 비교지수 대비 3.82%p 낮은 수준을 기록하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

8월 국내 시장은 KOSPI는 +1.20%, KOSDAQ +5.34%로 반등세가 나타났습니다. 8월 초 미국달러화 강세가 신흥국 투자심리를 전반적으로 위축시켰고, 2분기 실적시즌 이후 하반기 실적 불확실성 높아지며 KOSPI 지수는 2,240선까지 하락하였으나, 중순 이후 미-중 무역협상 재개에 따른 기대감 확대 및 달러 강세 압력 둔화에 위험자산 선호심리가 개선되며 반등세가 진행되었습니다. 업종별로는 종이, 목재(+15.0%), 의약품(+11.3%), 섬유, 의복(+9.6%) 등이 강세를 나타낸 반면, 전기가스(-8.1%), 음식료품(-6.2%), 보험(-4.1%) 등이 약세를 나타냈습니다.

▶ 기간(누적) 수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
거북이70소장자1(주식)(운용)	-3.06	-3.57	-2.52	-1.64
(비교지수 대비 성과)	(-3.54)	(-4.49)	(-3.90)	(-3.30)
종류(Class)별 현황				
거북이70소장자1(주식)C	-3.34	-4.14	-3.37	-2.78
(비교지수 대비 성과)	(-3.82)	(-5.06)	(-4.75)	(-4.44)
거북이70소장자1(주식)Ce	-3.26	-3.97	-3.12	-2.44
(비교지수 대비 성과)	(-3.74)	(-4.89)	(-4.50)	(-4.10)
비교지수(벤치마크)	0.48	0.92	1.38	1.66

주)비교지수(벤치마크): 국고채1~2년 X 93% + KOSPI X 7%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
거북이70소장자1(주식)(운용)	-1.64	2.02	3.01	-
(비교지수 대비 성과)	(-3.30)	(-2.29)	(-3.26)	-
종류(Class)별 현황				
거북이70소장자1(주식)C	-2.78	-0.32	-0.52	-
(비교지수 대비 성과)	(-4.44)	(-4.63)	(-6.79)	-
거북이70소장자1(주식)Ce	-2.44	0.38	0.54	-
(비교지수 대비 성과)	(-4.10)	(-3.93)	(-5.73)	-
비교지수(벤치마크)	1.66	4.31	6.27	0.00

주)비교지수(벤치마크): 국고채1~2년 X 93% + KOSPI X 7%

※ 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	-447	24	0	1	333	0	0	0	0	8	-1	-82
당기	-733	31	0	-30	270	0	0	0	0	10	-5	-457

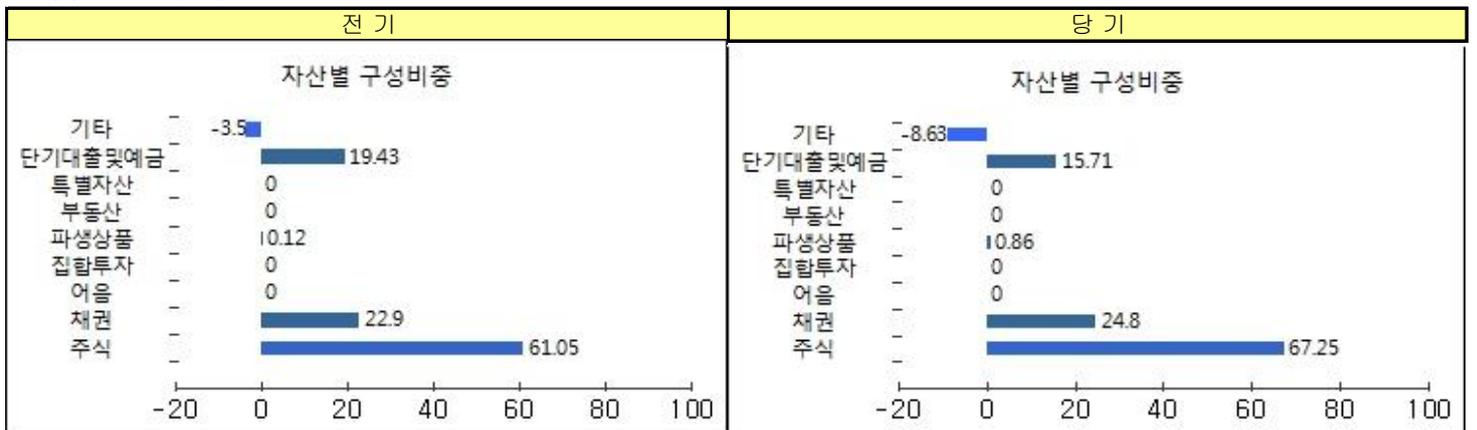
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	9,865	3,639	0	0	126	0	0	0	0	2,305	-1,266	14,669
(1.00)	(67.25)	(24.80)	(0.00)	(0.00)	(0.86)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(15.71)	(-8.63)	(100.00)
합계	9,865	3,639	0	0	126	0	0	0	0	2,305	-1,266	14,669

* (단위): 구성비중



▶ 순포지션비율

(단위: 백만원, %)

동화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
매수포지션 (0.00)	9,865 (67.25)	3,639 (24.8)	0 (0)	0 (0)	126 (0.86)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	136 (0.93)	903 (6.16)	14,669 (100)
매도포지션 (0.00)	747 (100)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	747 (100)
순포지션 (0.00)	9,118 (65.5)	3,639 (26.14)	0 (0)	0 (0)	126 (0.9)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	136 (0.98)	903 (6.49)	13,921 (100)

▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

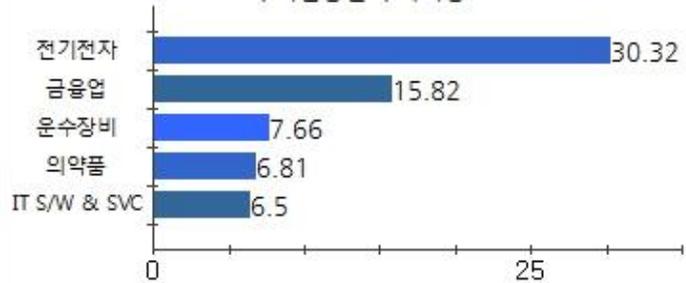
순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기전자	30.32	6	화학	6.47
2	금융업	15.82	7	유통업	5.59
3	운수장비	7.66	8	철강및금속	4.13
4	의약품	6.81	9	서비스업	3.54
5	IT S/W & SVC	6.50	10	기타	13.16

▶ 국가별 투자비중

(단위 : %)

순위	국가명	비중	순위	국가명	비중
1	대한민국	100.00			

주식업종별 투자비중

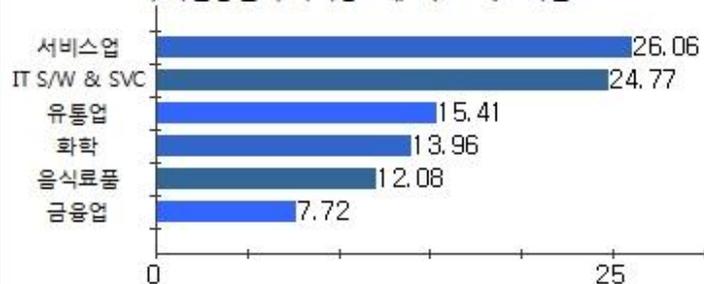


▶ 주식업종별 투자비중 : 매도(Short)포지션

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	서비스업	26.06	6	금융업	7.72
2	IT S/W & SVC	24.77			
3	유통업	15.41			
4	화학	13.96			
5	음식료품	12.08			

주식업종별 투자비중 : 매도(Short)포지션



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	주식	삼성전자	15.68	6	주식	현대중공업지주	4.35
2	채권	통안02120-2004-02	7.44	7	주식	컴투스	3.88
3	단기	REPO매수(20180914)	7.10	8	주식	현대차	2.96
4	단기	REPO매수(20180914)	5.44	9	주식	POSCO	2.78
5	채권	통안증권0185-1910-02	4.94	10	주식	SK	2.73

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식 (단위: 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	50,162	2,300	15.7	대한민국	KRW	전기전자	
현대중공업지주	1,635	638	4.4	대한민국	KRW	금융업	
컴투스	3,945	569	3.9	대한민국	KRW	IT S/W & SVC	
현대차	3,358	435	3.0	대한민국	KRW	운수장비	
POSCO	1,385	407	2.8	대한민국	KRW	철강및금속	

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
통안02120-2004-02	1,083	1,092	대한민국	KRW	2018-04-02	2020-04-02		N/A	7.44
통안증권0185-1910-02	722	725	대한민국	KRW	2017-10-02	2019-10-02		N/A	4.94

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

▶ 장내파생상품 (단위: 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
코스피200 F 201812	매도	104	7,820	

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	2018-09-14	1,041	1.64		대한민국	KRW
REPO매수	동양투신운용	2018-09-14	798	1.66		대한민국	KRW

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

▶ 기타 (단위: 백만원)

종류	평가금액	비고
미수금	606	

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	
김지상 ^{*)}	과장	34	9	59,407	0		2115000373
박정환	대표	55	12	177,626	5	208,743	2109000201
김민수	차장	37	2	30,015	0		2111000836

주) 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 상이 할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2017.11.24 ~ 현재	박정환
2014.03.17 ~ 현재	김지상
2018.03.16 ~ 현재	김민수
2014.03.17 ~ 2018.05.28	채경섭
2014.03.17 ~ 2017.11.23	오종록
2014.03.17 ~ 2018.03.15	정승호

▶ 해외운용수탁회사

회사명	소재	국가명	비고
해당사항 없음			

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급 현황

(단위: 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율 ^{주1)}	금액	비율 ^{주1)}	
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 ^{주2)}	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	10	0.07	21	0.14
		조사분석업무 등 서비스 수수료	31	0.21	32	0.22
		합계	40	0.28	53	0.36
	증권거래세	53	0.37	55	0.38	
거북이70소장자1(주식)C	자산운용사	15	0.11	15	0.11	
	판매회사	24	0.18	24	0.18	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	1	0.01	1	0.01	
	일반사무관리회사	1	0.01	1	0.01	
	보수합계	40	0.29	41	0.29	
	기타비용 ^{주2)}	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	9	0.07	20	0.14
		조사분석업무 등 서비스 수수료	29	0.21	30	0.22
		합계	38	0.28	50	0.36
	증권거래세	51	0.37	52	0.38	
거북이70소장자1(주식)Ce	자산운용사	1	0.11	1	0.11	
	판매회사	1	0.09	1	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.01	0	0.01	
	보수합계	2	0.20	2	0.20	
	기타비용 ^{주2)}	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.07	1	0.14
		조사분석업무 등 서비스 수수료	2	0.21	2	0.22
		합계	2	0.28	3	0.36
	증권거래세	3	0.37	3	0.38	

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

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

※ 성과보수내역 : 해당 없음

※ 발행분담금내역 : 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위: 연환산, %)

	구분	총보수·비용비율(A) ^{주1)}	매매·중개수수료비율(B) ^{주2)}	합계(A+B)
거북이70소장자1(주식)(운용)	전기	0.0009	0.6093	0.6102
	당기	0.0007	0.8525	0.8532
거북이70소장자1(주식)C	전기	1.1633	0.6101	1.7734
	당기	1.1631	0.8536	2.0167
거북이70소장자1(주식)Ce	전기	0.8129	0.6105	1.4234
	당기	0.8125	0.8546	1.6671

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

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균액(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
642,709	39,208	571,274	36,863	163.70	649.47

주) 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율입니다. 매매회전율이 높을경우 매매거래수수료(0.1% 내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

2017-12-17 ~ 2018-03-16	2018-03-17 ~ 2018-06-16	2018-06-17 ~ 2018-09-16
60.07	189.86	163.70

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용)의 자산운용회사인 마이다스에셋 자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 KEB하나은행의 확인을 받아 한국예탁결제원을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용(주)
금융투자협회

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

02-3787-3500