

자산운용보고서

마이다스 월드 In Best 연금 증권 자투자신탁 (주식-재간접형)(운용)

(운용기간 : 2021.12.20 ~ 2022.03.19)

○자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며투자자가 가입한 상품의 특
정기간(3개월)동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다

마이다스에셋자산운용

서울시 종로구 경희궁길 20

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

목 차

1. 펀드의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 자산현황
 - ▶ 펀드의 투자전략
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
7. 동일한[해당] 집합투자업자가 운영하는 집합투자기구에 대한 투자 현황
 - ▶ 투자현황
8. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안
 - ▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황
 - ▶ 나. 주요 위험 관리 방안
 - ▶ 다. 자전거래 현황
 - ▶ 라. 주요 비상대응계획

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보

자본시장과 금융투자업에 관한 법률

| 펀드명칭 | 투자위험등급 | 금융투자협회 펀드코드 | 고난도 펀드 |
|--|---|----------------------------------|-----------------------|
| 마이더스 월드 In Best 연금 증권 자투자신탁 (주식-재간접형)(운용), 마이더스 월드 In Best 증권 모투자신탁(주식-재간접형), 마이더스 월드 In Best 연금 증권 자투자신탁 (주식-재간접형)C1, 마이더스 월드 In Best 연금 증권 자투자신탁 (주식-재간접형)S-P | 2등급 | 77354 75317 AP335 AP337 | 해당사항 없음 |
| 펀드의 종류 | 재간접형, 추가형, 종류형, 모자형 | 최초설정일 | 2007.12.20 |
| 운용기간 | 2021.12.20 ~ 2022.03.19 | 존속기간 | 추가형으로 별도의 존속기간이 없음 |
| 투자소득의 과세 | <p><집합투자기구>집합투자기구 단계에서는 별도의 소득과세 부담이 없는 것이 원칙입니다.</p> <p><연금저축계좌 가입자에 대한 과세>소득세법 시행령 제40조의2에 따른 연금저축계좌를 통해 동 투자신탁에 가입한 가입자의 경우 동 투자신탁의 수익증권을 환매하는 시점에 별도의 과세를 하지 않으며, 연금저축계좌에서 자금 인출시 발생하는 연금소득(연금수령시), 기타소득 또는 퇴직소득(연금외수령시)에 대한 과세는 투자설명서 제2부 14. 이익 배분 및 과세에 관한 사항을 참고하시기 바랍니다.</p> | | |
| 자산운용회사 | 마이더스에셋자산운용 | 펀드재산보관회사 | NH농협은행 |
| 판매회사 | KB증권, NH농협은행, 한국포스증권 | 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스 |
| 상품의 특징 | 이 투자신탁은 국내와 해외의 주식시장에 쉽게 분산투자할 수 있는 상품입니다. 해외에 투자하는 펀드와 국내 주식/펀드에 분산투자하여 분산투자효과의 최대화를 추구합니다. 유망지역/국가에 대한 투자는 성장성이 높은 국가를 중심으로 투자하고, 글로벌 투자환경과 관련하여 테마형펀드에 투자를 병행하며 자본이득과 배당소득을 얻는 것을 목적으로 합니다. | | |

▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

| 펀드명칭 | 항목 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|---------------------------|-------------------|----------|----------|--------|
| 월드InBest연금자(재간접)(운용) | 자산 총액(A) | 39,287 | 36,278 | -7.66 |
| | 부채총액(B) | 208 | 117 | -43.85 |
| | 순자산총액(C=A-B) | 39,080 | 36,161 | -7.47 |
| | 발행 수익증권 총 수(D) | 27,078 | 26,591 | -1.80 |
| | 기준가격 (E=C/Dx1000) | 1,443.23 | 1,359.89 | -4.96 |
| 종류(Class)별 기준가격 현황 | | | | |
| 월드InBest연금자(재간접)C1 | 기준가격 | 1,350.87 | 1,279.11 | -5.31 |
| 월드InBest연금자(재간접)S-P | 기준가격 | 1,457.19 | 1,379.53 | -5.12 |

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.

▶ 펀드의 투자전략

투자전략
이 투자신탁은 국내 또는 해외 주식에 투자하는 집합투자기구에 신탁재산의 56% 이상, 주식에 신탁재산의 44% 이하를 투자하는 마이더스 월드 In Best 증권 모투자신탁(주식-재간접형)에 신탁재산의 90% 이상을 투자하여 자본이득과 배당소득을 얻는 것을 목적으로 합니다.

위험관리
이 투자신탁은 투자목적의 달성을 위하여 모투자신탁(마이더스 월드 In Best 증권 모투자신탁(주식-재간접형))에 자산의 90% 이상을 투자합니다.
이 투자신탁은 국내외 주식에 투자하는 집합투자기구의 집합투자증권과 국내 주식에 탄력적으로 분산 투자하는 운용 전략으로 인하여 적절한 참고지수를 정할 수 없습니다. 따라서 투자판단 시 한층 더 유의하시기 바랍니다
집합투자업자집합투자업자는 본 투자전략을 통하여 이 투자신탁의 수익률 향상을 위해 노력할 것이나, 이 투자신탁의 투자전략이 반드시 수행된다는 보장은 없습니다.

수익구조

이 투자신탁은 투자목적의 달성을 위하여 모두자산탁 (마이더스 월드 In Best 증권 모두자산탁(주식-재간접형))에 자산의 90% 이상을 투자합니다. 투자 대상 모두자산탁의 투자전략은 아래와 같습니다.

※ 모두자산탁의 수익구조

[마이더스 월드 In Best 증권 모두자산탁(주식-재간접형)]

국내외 주식에 투자하는 집합투자기구의 집합투자증권과 국내 주식에 주로 투자하는 증권 투자신탁으로, 직·간접적 투자대상인 국내외 주식의 가격 등락이 투자 손익을 결정하는 주요인입니다. 즉, 투자하는 국내외 주식의 가격이 상승할 경우 이익이 발생하며, 하락할 경우 손실이 발생합니다. 한편 투자대상 주식으로부터의 배당 수익, 채권 및 유동성자산 투자분에서 발생하는 이자수익도 투자신탁 수익의 일부를 구성합니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

펀드수익률은 C1 클래스 기준 -5.31%로 비교 지수 대비 4.99%p 높은 수준을 기록하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

2022년 2월 글로벌 주식시장은 인플레이션 우려가 지속되는 가운데 러시아-우크라이나 이슈가 전면전으로 확대되면서 대체적으로 하락 마감했습니다. 전세계 증시가 -2.70% 하락한 가운데 선진국과 신흥국 증시가 각각 -2.65%, -3.06% 하락하며 조정받았으며, 러시아 우크라이나 이슈로 경제적 타격이 예상되는 독일과 프랑스의 낙폭이 두드러진 반면, 원자재 가격 상승의 수혜를 받는 인도네시아, 말레이시아 등은 상대적으로 견조한 모습이었습니다. 중국도 3월 예정된 정책 이벤트를 앞두고 정책 기대감에 본토 증시 중심으로 견조한 상승세를 나타냈습니다. 2월 한달간 유가는 8.59% 상승했으며 인플레이션 헷지 자산인 금은 6.22% 상승 마감했습니다. 불확실한 장세에 최근엔 러시아-우크라이나 사태까지 더해지며 시장 변동성이 높아졌지만, 이로 인해 당초 우려하던 3월 50bp 금리 인상 가능성이 현저하게 낮아진 점은 안도감을 주는 부분입니다. 다만 인플레이션에 대한 우려는 지속될 가능성이 높아 확대된 변동성이 진정되기까지는 시간이 필요할 것으로 보입니다. 최근 기업들은 4분기 실적 시즌을 맞이해 가이드언스를 제시하며 시장의 눈높이를 맞춰나가고 있는데, 변동성 구간 내에서도 실적/가이드언스가 탄탄한 성장 테마는 차별화 흐름을 이어가고 있음에 주목하고 있습니다. 또한, 그간 고평가로 분류되던 주식들이 급격한 조정으로 인해 접근 가능한 밸류에이션 영역으로 진입하고 있어 추가 하방압력은 제한적일 것으로 보여집니다. 올해는 원자재 강세와 인플레이션 우려를 시장을 좌우할 주요 팩터로 보고 있으며, 이러한 요인들의 수혜를 받는 업종과 테마를 긍정적인 시각에서 접근하되 펀드 전체의 변동성을 고려한 포트폴리오 구축에 힘을 계획합니다. 구간별로 변동성이 있을 수 있겠지만 장기적으로는 결국 기술의 진보, 인구구조의 변화(고령화, GENZ의 부상), 친환경 경제에 대한 추구 등 빠르게 진행되는 변화 속에서 기회를 찾을 계획이며 국가/업종별 균형을 유지하되 배당수익률이 높은 자산군도 적절한 수준으로 편입/유지할 계획입니다. 월드인베스트 펀드는 선진국/신흥국 시장의 구조적인 트렌드 포착에 주목하고 있으며 타 펀드 대비 아시아(신경제/구조적 성장)와 기타(탄소배출권/원자재) 비중을 높게 가져가는 전략을 추구하고 있습니다.

▶ 기간(누적) 수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 12개월 |
|----------------------|--------|--------|---------|---------|
| 월드InBest연금자(재간접)(운용) | -4.96 | -5.93 | 0.04 | -0.66 |
| (비교지수 대비 성과) | (5.34) | (7.87) | (17.20) | (10.28) |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 월드InBest연금자(재간접)C1 | -5.31 | -6.62 | -1.04 | -2.09 |
| (비교지수 대비 성과) | (4.99) | (7.18) | (16.12) | (8.85) |
| 월드InBest연금자(재간접)S-P | -5.12 | -6.24 | -0.44 | -1.32 |
| (비교지수 대비 성과) | (5.18) | (7.56) | (16.72) | (9.62) |
| 비교지수(벤치마크) | -10.30 | -13.80 | -17.16 | -10.94 |

주)비교지수(벤치마크): KOSPI X 100%

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

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|----------------------|---------|----------|---------|---------|
| 월드InBest연금자(재간접)(운용) | -0.66 | 76.49 | 55.05 | 47.59 |
| (비교지수 대비 성과) | (10.28) | (-9.22) | (30.74) | (22.53) |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 월드InBest연금자(재간접)C1 | -2.09 | 71.58 | 48.48 | 37.31 |
| (비교지수 대비 성과) | (8.85) | (-14.13) | (24.17) | (12.25) |
| 월드InBest연금자(재간접)S-P | -1.32 | 74.55 | 52.34 | 43.08 |
| (비교지수 대비 성과) | (9.62) | (-11.16) | (28.03) | (18.02) |
| 비교지수(벤치마크) | -10.94 | 85.71 | 24.31 | 25.06 |

주)비교지수(벤치마크): KOSPI X 100%

※ 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 | 81 | 0 | 0 | -749 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 2 | 267 | -399 |
| 당기 | 229 | 0 | 0 | -2,925 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -73 | 870 | -1,900 |

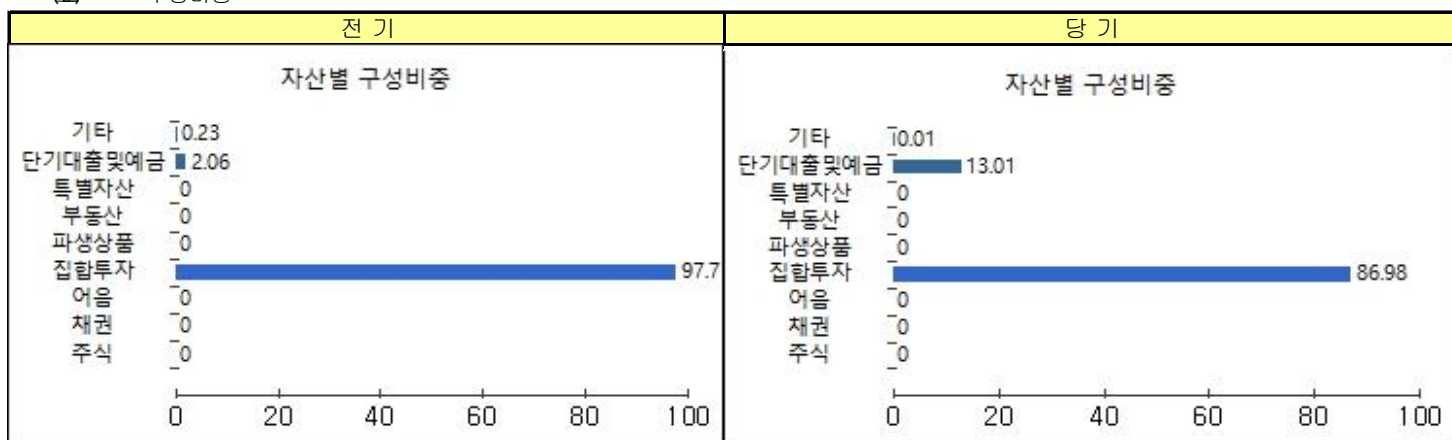
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

| 통화별 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|------------------|-------------|-------------|-------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|------------------|-------------|-------------------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| USD (1207.60) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 31,555 (86.98) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 3,944 (10.87) | 0 (0.00) | 35,499 (97.85) |
| KRW (1.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 777 (2.14) | 2 (0.01) | 779 (2.15) |
| 합계 | 0 | 0 | 0 | 31,555 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 4,721 | 2 | 36,278 |

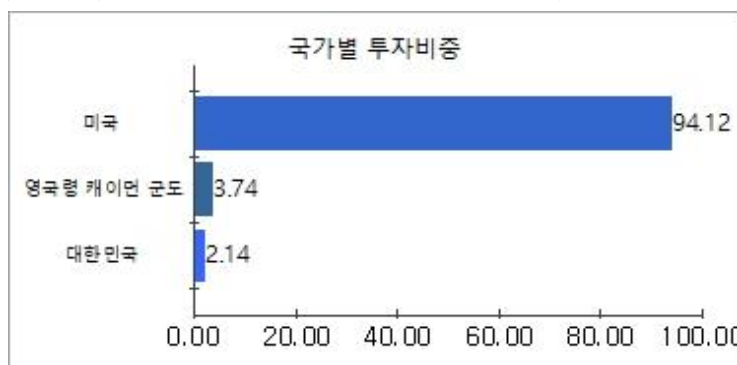
* (단위): 구성비중



▶ 국가별 투자비중

(단위: %)

| 순위 | 국가명 | 비중 | 순위 | 국가명 | 비중 |
|----|------------|-------|----|-----|----|
| 1 | 미국 | 94.12 | | | |
| 2 | 영국령 케이먼 군도 | 3.74 | | | |
| 3 | 대한민국 | 2.14 | | | |



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위: %)

| 순위 | 구분 | 종목명 | 비중 | 순위 | 구분 | 종목명 | 비중 |
|----|--------|--------------------------------|-------|----|--------|-------------------------------------|------|
| 1 | 단기상품 | 외화예금(USD) | 10.87 | 6 | 집합투자증권 | ISHARES MSCI GLOBAL MIN VOL | 5.09 |
| 2 | 집합투자증권 | ISHARES MSCI ACWI ETF | 10.18 | 7 | 집합투자증권 | HORIZON KINETICS INFL BENEF | 5.06 |
| 3 | 집합투자증권 | VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF | 6.80 | 8 | 집합투자증권 | Invesco S&P 500 Low Volatility | 4.91 |
| 4 | 집합투자증권 | HEALTH CARE SELC SPDR ETF | 5.84 | 9 | 집합투자증권 | INVESCO DYNAMIC FOOD & BEVERAGE ETF | 4.87 |
| 5 | 집합투자증권 | ENERGY SELECT SECTOR SPDR | 5.33 | 10 | 집합투자증권 | INVESCO S&P 500 HIGH DIVIDEN | 4.81 |

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 집합투자증권

(단위: 좌수, 백만원, %)

| 종목명 | 종류 | 자산운용사 | 설정원본 | 순자산금액 | 발행국가 | 통화 | 비중 |
|-------------------------------------|------|--|-------|-------|------|-----|-------|
| ISHARES MSCI ACWI ETF | 수익증권 | iShs MSCI ACWI ETF | 3,830 | 3,692 | 미국 | USD | 10.18 |
| VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF | 수익증권 | VanEck Vectors ETF Trust | 2,007 | 2,466 | 미국 | USD | 6.80 |
| HEALTH CARE SELC SPDR ETF | 수익증권 | Health Care Select Sector SPDR Fund | 1,985 | 2,120 | 미국 | USD | 5.84 |
| ENERGY SELECT SECTOR SPDR | 수익증권 | Energy select sector SPDR Fund | 1,719 | 1,935 | 미국 | USD | 5.33 |
| ISHARES MSCI GLOBAL MIN VOL | 수익증권 | ISHARES MSCI AL CRY WRLD MIN ETF | 1,818 | 1,845 | 미국 | USD | 5.09 |
| HORIZON KINETICS INFL BENEF | 수익증권 | Horizon Kinetics Inflation Beneficiaries ETF | 1,710 | 1,837 | 미국 | USD | 5.06 |
| Invesco S&P 500 Low Volatility | 수익증권 | Invesco S&P 500 Low Volatility ETF | 1,785 | 1,782 | 미국 | USD | 4.91 |
| INVESCO DYNAMIC FOOD & BEVERAGE ETF | 수익증권 | Invesco Ltd | 1,791 | 1,767 | 미국 | USD | 4.87 |
| INVESCO S&P 500 HIGH DIVIDEN | 수익증권 | Invesco S&P 500 High Dividend Low Volatility ETF | 1,765 | 1,747 | 미국 | USD | 4.81 |

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위: 주, 백만원, %)

| 종류 | 금융기관 | 취득일자 | 금액 | 금리 | 만기일 | 발행국가 | 통화 |
|-------|-----------|------------|-------|------|------------|------|-----|
| 외화예치금 | 외화예금(USD) | 2016-09-09 | 3,944 | 0.00 | 2900-11-11 | 미국 | USD |

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 | |
| 오남훈 ^{주)} | 본부장 | 45 | 8 | 152,256 | 3 | 1,113,265 | 2109001266 |
| 유주형 | 차장 | 37 | 2 | 7,920 | 0 | | 2115000822 |

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 |
|------------------------------------|------------|
| 2015.07.29 ~ 현재 2015.08.21 ~ 현재 | 오남훈 유주형 |

▶ 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)} | |
| 월드InBest연금자(재간접)(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)} | | 2 | 0.00 | 2 | 0.01 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 2 | 0.00 | 7 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 8 | 0.02 | 36 | 0.09 |
| | | 합계 | 10 | 0.03 | 43 | 0.11 |
| | 증권거래세 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 월드InBest연금자(재간접)C1 | 자산운용사 | 40 | 0.10 | 37 | 0.10 | |
| | 판매회사 | 99 | 0.25 | 92 | 0.24 | |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | 3 | 0.01 | 3 | 0.01 | |
| | 일반사무관리회사 | 2 | 0.01 | 2 | 0.00 | |
| | 보수합계 | 144 | 0.36 | 134 | 0.36 | |
| | 기타비용 ^{주2)} | | 2 | 0.00 | 2 | 0.01 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 2 | 0.00 | 7 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 8 | 0.02 | 36 | 0.09 |
| | | 합계 | 10 | 0.03 | 43 | 0.11 |
| | 증권거래세 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 월드InBest연금자(재간접)S-P | 자산운용사 | 0 | 0.10 | 0 | 0.10 | |
| | 판매회사 | 0 | 0.06 | 0 | 0.06 | |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 | |
| | 일반사무관리회사 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| | 보수합계 | 0 | 0.17 | 0 | 0.16 | |
| | 기타비용 ^{주2)} | | 0 | 0.00 | 0 | 0.01 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 0 | 0.00 | 0 | 0.01 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0 | 0.00 | 0 | 0.08 |
| | | 합계 | 0 | 0.01 | 0 | 0.09 |
| | 증권거래세 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율을 나타냅니다.

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

※ 성과보수내역 : 해당 없음

※ 발행분담금내역 : 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위: 연환산,%)

| | 구분 | 총보수·비용비율(A) ^{주1)} | 매매·중개수수료비율(B) ^{주2)} | 합계(A+B) |
|----------------------|----|----------------------------|------------------------------|---------|
| 월드InBest연금자(재간접)(운용) | 전기 | 0.0175 | 0.1027 | 0.1202 |
| | 당기 | 0.0213 | 0.4576 | 0.4789 |
| 월드InBest연금자(재간접)C1 | 전기 | 1.4593 | 0.1029 | 1.5622 |
| | 당기 | 1.4633 | 0.4584 | 1.9217 |
| 월드InBest연금자(재간접)S-P | 전기 | 0.7027 | 0.0208 | 0.7235 |
| | 당기 | 0.681 | 0.3689 | 1.0499 |

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 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | 0.00 |

주) 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가격의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가격으로 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

(단위: %)

| | | |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 2021-06-20 ~ 2021-09-19 | 2021-09-20 ~ 2021-12-19 | 2021-12-20 ~ 2022-03-19 |
| 0.00 | 0 | 0 |

7. 동일한[해당] 집합투자업자가 운영하는 집합투자기구에 대한 투자현황

▶ 투자현황

(단위: 백만원, %)

| 투자대상 집합투자기구 현황 | | 투자대상 집합투자증권 보유수(B) | 보유비중 (=A/B*100(%)) |
|----------------|---------|--------------------|--------------------|
| 집합투자기구명 | 발행총수(A) | | |
| 0 | 0 | | |

8. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

| | |
|--------------------|---|
| 유동성 위험 | 증권시장규모 등을 감안할 때 거래량이 풍부하지 못한 종목에 투자할 경우 투자대상종목의 유동성 부족에 따른 환금성의 결여가 투자신탁재산 가치의 하락을 초래할 위험이 발생할 수 있습니다. |
| 오퍼레이션 위험 | 해외투자의 경우 국내투자자와 달리 시차에 의한 시장폐장 및 개장시가의 차이로 신탁재산의 평가에 있어 시차가 발생할 수도 있습니다. 또한 복잡한 결제과정 및 현금 운용과정에서 운용적인 위험이 국내투자보다 더 높습니다. |
| 국가위험 | 이 투자신탁은 해외 주식 등에 투자하기 때문에 투자 대상 국가의 시장, 정치 및 경제상황 등에 따른 위험에 노출되어 있습니다. 또한 정부정책 및 제도의 변화로 인해 자산가치의 손실이 발생할 수 있으며, 외국인에 대한 투자제한, 조세제도 변화 등의 정책적 변화 및 사회전반적인 투명성 부족으로 인한 공시자료의 신뢰성 등의 위험도 있습니다. 특히 일부 신흥시장에 투자하는 경우 외국인의 투자한도, 넓은 매매호가 차이, 거래소의 제한된 개장시간과 거래량 부족 등으로 인하여 유동성에 제약이 발생할 수도 있습니다. 따라서 선진국가, 글로벌 시장에 투자하는 것에 비해 상대적으로 투자대상 국가의 위험에 크게 노출될 수 있습니다. |
| 외국세법에 의한 과세에 따른 위험 | 이 투자신탁이 해외주식(주식예탁증권 포함) 및 해외채권에 투자할 수 있으며, 해외 유가증권에 투자할 경우 해당 유가증권이 거래되는 특정국가의 세법에 영향을 받습니다. 특정 외국의 세법에 의한 배당소득세, 양도소득세 등이 부과될 수 있고, 향후 특정 외국의 세법 변경으로 높은 세율이 적용될 경우 세후 배당소득, 세후 양도소득 등이 예상보다 감소하여 투자신탁 재산에 영향을 미칠 수 있습니다. |
| 파생상품 관련 위험 | 파생상품에의 투자는 적은 증거금으로 거액의 결제가 가능한 지렛대 효과(레버리지 효과)로 인하여 기초자산에 직접 투자하는 경우에 비하여 높은 위험에 노출될 수 있습니다. 기초 자산의 가격변동성을 완화하기 위한 헤지전략과 자산배분전략을 구사함에도 불구하고, 파생상품은 시장 내의 수급과 시장 외부변수에 따라 기초자산의 움직임과 상이하게 움직일 경우 파생상품에 투자하는 투자자에게 예상하기 어려운 투자자산 가치의 변화를 초래할 수 있습니다. 장외파생상품으로 운용되는 경우 거래상대방 신용위험에 노출되며 급격한 시장 변동, 거래상대방의 신용 악화 및 기타 예측하지 못한 변수로 인해 장외파생상품 매매에 따른 거래상대방 신용위험이 발생할 가능성이 있습니다. |

2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등

동기간 환매중단, 상환연기, 부실자산 발생 관련 위험은 없었으며, 보고서 작성 시점에서 동 위험의 발생 가능성은 제한적입니다.

▶ 나. 주요 위험 관리 방안

1. 주요 위험 관리 방안

| | |
|-------|---|
| 유동성위험 | 보유종목의 시장유동성 점검은 초저유동성 종목에 대하여 모니터링하고, 종목별 전량매도소요일, 중소형주 비중 점검 등을 통하여 관리하고 있으며, 위험발생이 예상되는 경우 즉시 위험관리위원회를 개최하여 대응방안을 마련하며, 펀드의 유동성관리는 펀드별 현금자산 및 유동성비중에 대하여 Daily 모니터링하고, 환매스케줄 및 자금관리에 만전을 기하고 있습니다. |
| 신용위험 | 주식 및 채권의 경우 Buying List 종목에 한해 투자 가능하며, Buying List 선정시 종목의 신용위험에 대한 점검절차를 가지고 있으며, 신용등급의 변동에 대하여 데일리 모니터링하고, 신용등급이 규정에서 정한 등급 미만으로 하락시에는 위험관리위원회의 점검절차를 통하여 대응방안을 마련하여 대응합니다. RP거래의 경우 거래처 및 담보증권 점검을 통하여 신용위험을 관리하고 있습니다. |

| | |
|------------------|---|
| 시장위험 | 주식편입비, 종목별 편입비 등의 한도를 규약에 정하고, 한도 내에서의 운용을 원칙으로 하고 있으며, 개별주식종목의 경우 Loss-cut 규정을 두고 있습니다. 또한 펀드별 TE, IR, MDD 등의 위험조정성과지표의 관리를 통하여 시장위험을 관리하고 있습니다. |
| 파생상품 관련위험 | 파생상품의 편입 한도를 규약에 정하고, 한도 내에서의 운용을 원칙으로 하고 있으며, 파생상품거래에 따른 위험평가액을 매일 모니터링하고 점검합니다. |
| 통제방안 | 규약, 법규 및 내부 운용지침 등에서 요구하는 위험관리 항목과 일상적으로 발생할 수 있는 위험요소에 대하여 데일리 및 상시 모니터링하고 있으며, 주간 리스크관리리포트를 통한 점검, 월1회 정기 위험관리 실무위원회 등의 점검절차를 가지고 있으며, 실제 위험요인 발생시 즉각적으로 위험관리위원회를 개최하여 위험요인 분석 및 그에 따른 해결 방안 강구하고 추가적인 위험 발생의 방지에 최선을 다합니다. |
| 환위험 | 환헤지 전략을 사용하는 펀드에 한하여 선물환계약 등의 통화관련 파생상품에 투자하여 보유통화의 환율 변동 위험을 줄일 수 있으며, 해당 파생상품에의 투자와 관련하여 헤지비용, 파생상품편입한도, 파생상품 위험액 등의 한도관리를 통하여 관리하고 있습니다. |
| 오퍼레이션 위험 | 해외투자의 경우 국가별 시차, 결제과정의 차이로 인하여 발생할 수 있는 오퍼레이션위험을 최소화하기 위하여 사전적 절차확인 및 크로스체크 등의 과정을 두어 오퍼레이션 위험을 최소화 하고 있습니다. |
| 재간접펀드 등 위험관리조치방안 | 동펀드에서 주로 투자하는 해외ETF는 상장ETF의 특성상 상장거래소에서의 TE제한 등의 관리항목이 있으며, 동펀드에서 투자하는 피투자펀드의 수익률 및 시장상황 등을 모니터링하여 위험발생이 예상되는 경우 운용정보요청을 실시하여 대응방안을 강구합니다. |

2. 환매중단, 상환연기 등과 관련된 환매재개, 투자금상환 등의 방안 및 절차 등
해당사항 없음

▶ 다. 자전거래 현황

| 1. 자전거래규모 | | | |
|-----------|--------|--------|---------|
| 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 12개월 |
| 0 | 0 | 0 | 0 |

2. 최근 1년간 자전거래 발생 시 자전거래 사유, 관련 펀드간 이해상충 등 방지를 위해 실시한 방안, 절차 등
해당사항 없음

▶ 라. 주요 비상대응계획

집합투자재산위험관리규정 제39조(집합투자재산 운용에 따른 비상계획의 수립 및 점검)에 의거하여 '운용관련 비상상황에 대한 단계별 가이드라인'을 제정하고 운영하고 있으며, 대규모환매청구, 보유자산의 중대한 손실, 보유자산의 부실화 등의 정량적인 사항은 시스템으로 구축하여 데일리 모니터링 및 단계별 점검사항 발생시 위험요소에 대하여 점검하고, 조속하게 대처하여 추가적인 위험상황으로의 확대를 방지하고, 재난, 재해, 민원 및 소송, 금융사고 등의 발생에 대하여도 위기상황에 대하여 단계별로 정의하고 발생시 단계별 대응방안에 따르며, 재난, 재해의 경우에는 발생 즉시 비상대책위원회를 소집하여 BCP점검 및 비상대응계획을 수립하여 시행하여 위험을 최소화 하도록 최선을 다합니다.

9. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

▶ 고유재산 투자에 관한 사항 (단위: 원, %)

| 펀드명 | 투자시기 | 투자금액 | 수익률 | 비고 |
|---------|------|------|-----|----|
| 해당사항 없음 | | | | |

주1) 수익률은 분기운용보고서 말일 기준

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 월드 In Best 연금 증권 자투자신탁(주식-재간접형)(운용)의 자산운용회사인 마이다스에셋 자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 NH농협은행의 확인을 받아 한국예탁결제원을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.