

자산운용보고서

공지사항

고객님이 가입하신 펀드는 『자본시장과 금융투자업에 관한 법률(신규 설정)』의 적용을 받습니다.

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 2Index 증권투자신탁 프리미어 KH-2호(ELS-파생형)의 자산운용사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드자산보관자(신탁업자)인 '한국씨티은행'의 확인을 받아 판매회사를 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드자산보관자(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용 <http://www.midasasset.com>
 금융투자협회 <http://dis.fundservice.net>

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보

위험등급 : 1등급

펀드명칭		금융투자협회 펀드코드	
마이다스 2Index 증권투자신탁 프리미어 KH-2호(ELS-파생형)		A1757	
펀드의 종류	투자신탁/증권(파생형)/단위형/개방형	최초설정일	2011-04-04
운용기간	3개월(2011-07-04 ~ 2011-10-03)	존속기간	2014-05-04
자산운용사	마이다스에셋자산운용		
펀드재산보관(신탁업자)	한국씨티은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
판매회사	신한은행		
상품의 특징	* 2Index 조기상환형 : 3년 간 매4개월마다 조기상환 기회(만기포함 총9번) - 동 펀드는 HSCEI지수와 KOSPI200지수의 가격변동에 연계하여 수익이 결정되는 증권투자신탁(ELS-파생형)입니다. - 매 중간평가일(매 4개월)에 각 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 95%(4개월), 95%(8개월), 95%(12개월), 90%(16개월), 90%(20개월), 90%(24개월), 85%(28개월), 85%(32개월), 60%(36개월) 이상이면 연10.77%수준의 수익과 원금을 지급하고 조기상환되고, 조기상환이 안되고 만기에 이르렀을 경우 만기상환조건에 따라 상환됨.		

- ☞ 위험등급 : 투자대상 자산의 종류 및 위험도 등을 감안하여 1등급(매우 높은 위험) 부터 5등급(매우 낮은 위험) 까지 투자위험 등급을 5단계로 분류함.
- ☞ 1등급 - 매우 높은 위험, 2등급 - 높은 위험, 3등급 - 중간 위험, 4등급 - 낮은 위험, 5등급 - 매우 낮은 위험

▶ 자산현황

(단위 : 원, 좌/주, %)

	전기말	당기말	증감률
자산 총액	31,694,186,323	21,286,022,610	-32.84
부채 총액	22,833,699	8,728,965	-61.77
순자산총액	31,671,352,624	21,277,293,645	-32.82
기준가격	1,017.58	684.43	-32.74

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

동 펀드는 HSCEI지수와 KOSPI200지수의 가격변동에 연계하여 수익이 결정되는 파생결합증권(ELS)을 편입하여 운용하며 수익구조는 다음과 같습니다.

- 1) 조기상환 : 매4개월(중간평가일)마다 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 95%(4개월), 95%(8개월), 95%(12개월), 90%(16개월), 90%(20개월), 90%(24개월), 85%(28개월), 85%(32개월) 이상이면 연10.77%수준의 수익과 함께 조기상환
- 2) 조기상환되지 못하고 만기(36개월)에 이르렀을 경우
 - ㉠ 두 기초자산 모두 최초기준가격의 60%이상인 경우: 연 10.77%수준의 수익지급
 - ㉡ 두 기초자산 중 하나라도 최초기준가격의 60%미만인 경우 : 만기시점에서 최초기준가격대비 하락률이 큰 기초자산의 하락률만큼 원금 손실 발생 (최대가능손실률: -100%)

동 펀드의 최초기준가격은 HSCEI지수와 KOSPI200지수가 각각 13,586.70P, 280.01P이었습니다.

지난 1차 조기상환평가일에 상환조건을 충족하지 못하여 2차 조기상환평가일로 순연되었습니다.

운용보고서 작성 기준일인 2011년 9월 30일 현재 HSCEI지수와 KOSPI200지수는 각각 8,917.36P, 230.41P으로 최초기준가격 대비 수익률은 각각 -34.37%, -17.71%입니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

향후 만기 포함 총 8회의 조기상환 평가기회가 남아있으며, 각 시점별 조기상환조건은 다음과 같습니다.

- 제2차 조기상환평가일: 2011년 11월 29일 증가, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 95%이상
- 제3차 조기상환평가일: 2012년 3월 30일 증가, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 95%이상
- 제4차 조기상환평가일: 2012년 7월 31일 증가, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 90%이상
- 제5차 조기상환평가일: 2012년 11월 29일 증가, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 90%이상
- 제6차 조기상환평가일: 2013년 4월 2일 증가, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 90%이상
- 제7차 조기상환평가일: 2013년 7월 30일 증가, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 85%이상
- 제8차 조기상환평가일: 2013년 11월 29일 증가, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 85%이상
- 제9차(만기) 평가일: 2014년 4월 1일 증가, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 60%이상

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
마이다스 2Index 증권투자신탁 프리미어 KH-2호(ELS-파생형)	-19.64	-32.74	-31.56	-	-
비교지수	-	-	-	-	-

비교지수(Bench Mark) = 없음

*** 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성결과를 보장하는 것은 아닙니다.**

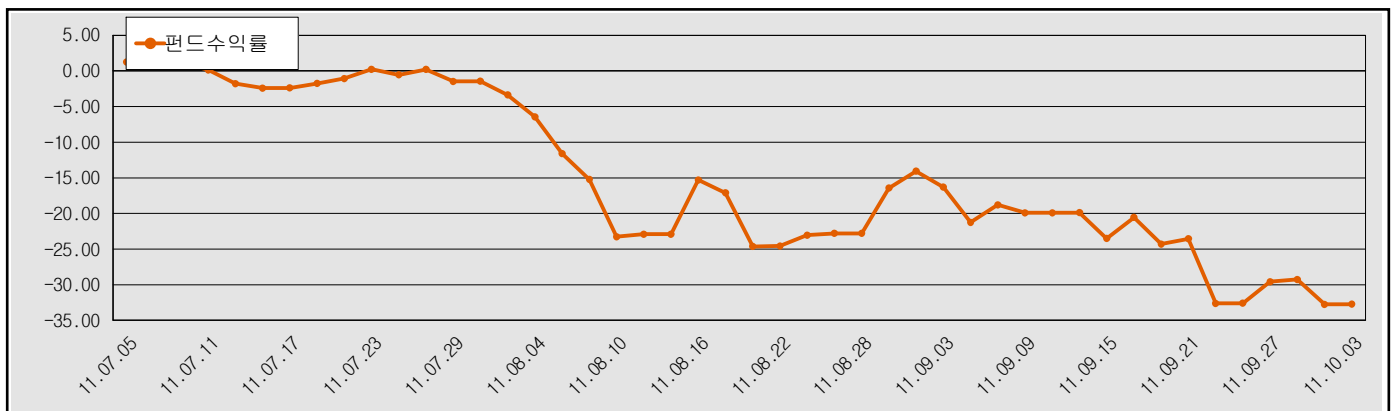
▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이다스 2Index 증권투자신탁 프리미어 KH-2호(ELS-파생형)	-	-	-	-
비교지수	-	-	-	-

주) 상위 펀드는 설정일 1년 미만의 펀드로 연평균수익률을 표시하지 않습니다.

*** 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성결과를 보장하는 것은 아닙니다.**



비교지수(Bench Mark) = 없음

* 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	파생결합증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	-	-	-	-	-	-10,353	-	-	-	-	-7	-10,360
전기손익	-	-	-	-	-	569	-	-	-	3	-24	548

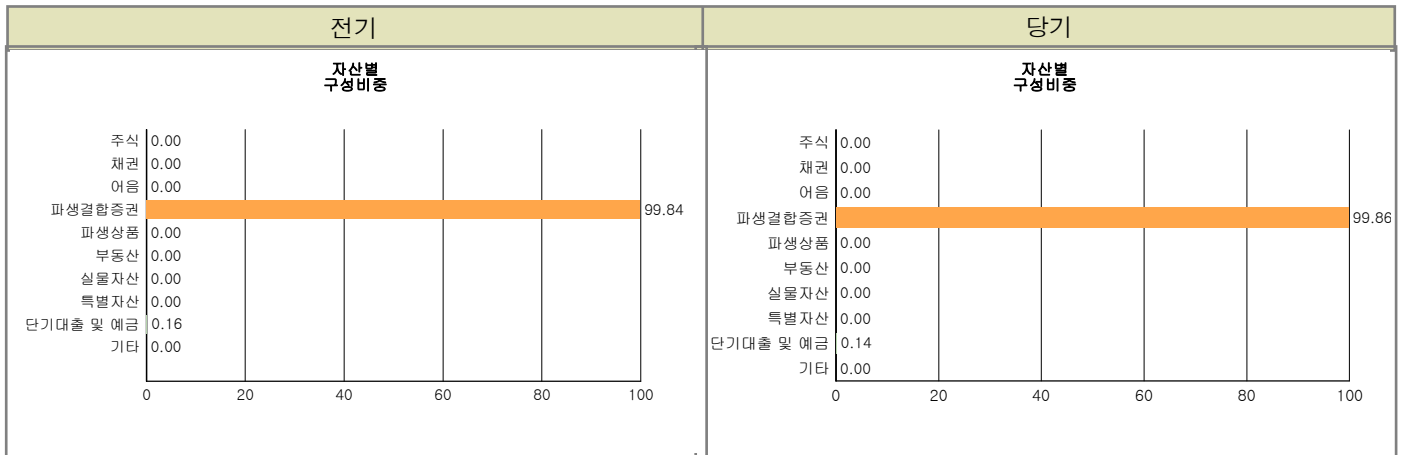
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음 및 기타증권	파생결합증권	장내	장외		실물자산	기타			
원화	-	-	-	21,256 (99.86)	-	-	-	-	-	30 (0.14)	-	21,286 (100.00)
합계	-	-	-	21,256 (99.86)	-	-	-	-	-	30 (0.14)	-	21,286 (100.00)

※ ()내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	파생결합증권 우리투자(ELS)4323	25.01	2	파생결합증권 대우증권(ELS)5359	25.01
3	파생결합증권 하나대투ELS1553	24.99	4	파생결합증권 신한금융(ELS)2483	24.86
5	단기대출및예금 예금	0.14			

* 보다 상세한 투자대상자산 내역은 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

해당사항 없음

▶ 채권

해당사항 없음

▶ 어음

해당사항 없음

▶ 집합투자증권

■ 상위 5개 종목

(단위 : 원)

종 목	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	취득일	비 중
우리투자(ELS)4323			7,771,335,100	5,323,674,768	2011-04-05	
하나대투ELS1553			7,771,335,100	5,318,475,553	2011-04-05	
대우증권(ELS)5359			7,771,335,100	5,322,936,511	2011-04-05	
신한금융(ELS)2483			7,724,244,795	5,290,947,657	2011-04-05	
합계			31,038,250,095	21,256,034,489		

▶ 장내파생상품

해당사항 없음

▶ 장외파생상품

해당사항 없음

▶ 부동산(임대)

해당사항 없음

▶ 부동산(자금대여 및 차입)

해당사항 없음

▶ 특별자산

해당사항 없음

▶ 단기대출 및 예금

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
예금	한국씨티은행		29,988,121	2.76		

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ 기타

해당사항 없음

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 운용전문인력

(단위 : 개, 백만원)

성명	운용개시일	직위	운용중인 다른 펀드 현황		주요 경력 및 운용내역(최근5년)	협회등록번호
			펀드 수	운용 규모		
박정환		운용역 1964년	99	1,075,616	서울대학교 대학원 경영학과 (경영학 석사) 제일경제연구소 연구소, 국민투자신탁, 현대투신운용, Sk투신운용, 아이투신운용, 한국투신운용 채권운용팀 現 마이다스에셋 자산운용(주) 채권운용본부장	03-02002-0026

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말합니다.

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

(단위 : 백만원, %)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	19	0.06	6	0.02	
판매회사	-	-	-	-	
펀드재산보관(신탁업자)	2	0.01	1	0.00	
일반사무관리회사	2	0.01	1	0.00	
보수 합계	22	0.07	8	0.03	
기타비용**	3	0.01	1	0.00	
매매/중개수수료	0	0.00	-	-	

* 펀드의 순자산평잔 대비 비율

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

▶ 총보수비용 비율

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수, 비용비율	매매, 중개수수료 비율	합성 총보수, 비용비율	매매, 중개수수료 비율
전기	0.32	0.00	0.32	0.00
당기	0.13	0.00	0.13	0.00

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평잔(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 회전율

해당사항 없음

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

해당사항 없음

위험공지

1. 시장 위험과 원금손실 가능성
 - 본 상품은 파생결합증권(ELS)의 기초자산의 가격이 폭락시 원금의 100%까지도 손실이 가능합니다.
2. 신용 위험과 원금손실 가능성
 - 파생결합증권(ELS)을 발행한 회사가 원리금을 제때에 지급하지 못하는 등의 신용위험이 발생하는 경우 동 투자신탁에서 추구하는 투자목적달성하지 못할 수 있습니다.
 - 파생결합증권(ELS)에 직접 투자하신 것과 비슷한 위험을 가집니다. 예를 들어 증권회사의 채무불이행 또는 주식시장의 거래가 중지되는 경우 원리금의 지급이 지연되거나 원금의 100%까지도 손실이 발생할 수 있습니다.
3. 유동성 위험 및 높은 환매수수료
 - 파생결합증권(ELS)은 다른 유가증권과 달리 파생결합증권(ELS)을 발행한 회사와 직접 거래를 하여야 하므로 유동성이 작습니다. 따라서 파생결합증권(ELS)을 만기 이전에 중도매각하고자 하는 경우 중도 매각이 원활하지 못할 수도 있으며, 중도 매각에 따른 가격 손실 및 높은 환매수수료로 인하여 원금손실이 발생할 수 있습니다.
4. 계약조건 변경 위험과 강제조기 청산
 - 기초자산의 거래/산출 중단 또는 상장폐지, 관련 법규의 변경, 천재지변, 전시, 사변, 금융·외환시장의 중대한 교란, 발행회사의 휴/폐업 등 기타 불가피한 사유 등 예상치 못한 경우가 발생하는 경우에는 계약조건(기준일, 행사가격, 지급일, 상환조건 및 상환금액) 등이 변경될 수 있으며, 원금에 미달되는 금액으로 강제 조기청산 될 수도 있습니다.