

자산운용보고서

공지사항

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

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 2Star 증권투자신탁 프리미어 HL-1호 (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 2Star 증권투자신탁 프리미어 HL-1호 (ELS-파생형) | | A2603 | |
| 펀드의 종류 | 투자신탁/증권(파생형)/단위형/개방형 | 최초설정일 | 2011-05-02 |
| 운용기간 | 3개월(2011-11-02 ~ 2012-02-01) | 존속기간 | 2014-06-02 |
| 자산운용사 | 마이다스에셋자산운용 | | |
| 펀드자산보관(신탁업자) | 한국씨티은행 | 일반사무관리회사 | SC펀드서비스 |
| 판매회사 | 신한은행 | | |
| 상품의 특징 | * 2Star 조기상환형 : 3년 간 매4개월마다 조기상환 기회(만기포함 총9번) - 동 펀드는 HSCEI지수와 LG화학 보통주의 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), 55%(36개월) 이상이면 연11.82%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 | 4,515,587,181 | 5,505,480,276 | 21.92 |
| 부채 총액 | 1,555,018 | 628,309 | -59.59 |
| 순자산총액 | 4,514,032,163 | 5,504,851,967 | 21.95 |
| 기준가격 | 683.26 | 833.24 | 21.95 |

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 LG화학 보통주의 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 연11.82%수준의 수익과 함께 조기상환
- 2) 조기상환되지 못하고 만기(36개월)에 이르렀을 경우
 - ㉔ 두 기초자산 모두 최초기준가격의 55%이상인 경우: 연 11.82%수준의 수익지급
 - ㉕ 두 기초자산 중 하나라도 최초기준가격의 55%미만인 경우 : 만기시점에서 최초기준가격대비 하락률이 큰 기초자산의 하락률만큼 원금 손실 발생 (최대가능손실률: -100%)

동 펀드의 최초기준가격은 HSCEI지수와 LG화학 보통주가 각각 12,940.65P, 507,666원이었습니다.
동 펀드는 지난 2차 조기상환평가일에 상환조건을 충족하지 못하여 다음 평가일로 상황이 순연되었습니다.

운용보고서 작성 기준일인 2012년 2월 1일 현재 HSCEI지수와 LG화학 보통주는 각각 11,253.80P, 388,000원으로 최초기준가격 대비 수익률은 각각 -13.04%, -23.57%입니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

향후 만기 포함 총 7회의 조기상환 평가기회가 남아있으며, 각 시점별 조기상환조건은 다음과 같습니다.
-제3차 조기상환평가일: 2012. 04. 25(수), 26(목), 27(금) 증가의 평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 95%이상
-제4차 조기상환평가일: 2012. 08. 27(월), 28(화), 29(수) 증가의 평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 90%이상
-제5차 조기상환평가일: 2012. 12. 24(월), 27(목), 28(금) 증가의 평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 90%이상
-제6차 조기상환평가일: 2013. 04. 25(목), 26(금), 29(월) 증가의 평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 90%이상
-제7차 조기상환평가일: 2013. 08. 26(월), 27(화), 28(수) 증가의 평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 85%이상
-제8차 조기상환평가일: 2013. 12. 24(화), 27(금), 30(월) 증가의 평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 85%이상
-제9차(만기) 평가일: 2014. 04. 24(목), 25(금), 28(월) 증가의 평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 55%이상

▶ 기간수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 1개월 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 1년 |
|--|--------|--------|--------|--------|-------|
| 마이더스 2Star 증권투자신탁 프리미어 HL-1호 (ELS-파생형) | 22.53 | 21.95 | -15.20 | -16.68 | - |
| 비교지수 | - | - | - | - | - |

비교지수(Bench Mark) = 없음

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

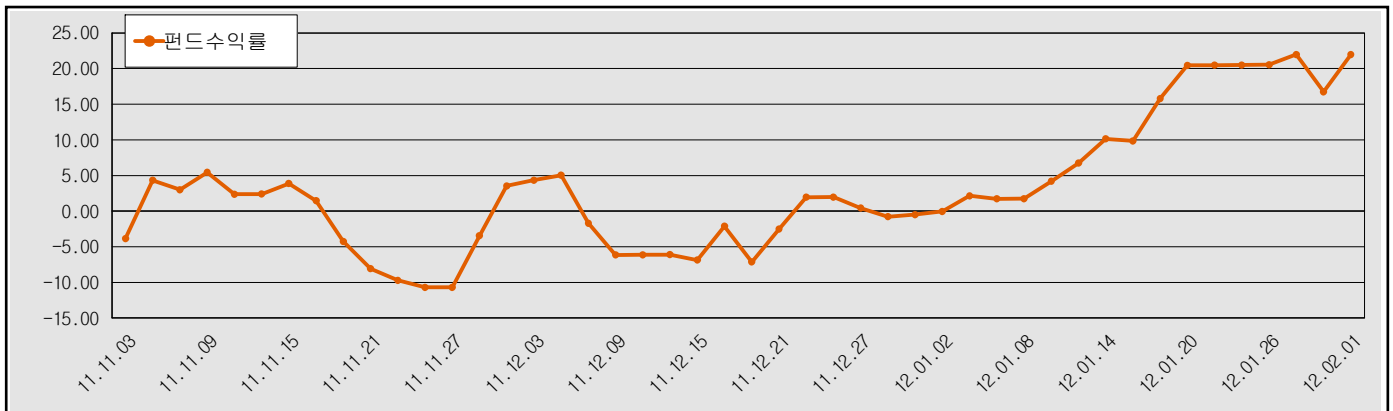
▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|--|-------|-------|-------|-------|
| 마이더스 2Star 증권투자신탁 프리미어 HL-1호 (ELS-파생형) | - | - | - | - |
| 비교지수 | - | - | - | - |

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

*** 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 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 | 파생결 합증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | - | - | - | - | - | 991 | - | - | - | 0 | 0 | 991 |
| 전기손익 | - | - | - | - | - | -1,977 | - | - | - | 0 | -1 | -1,978 |

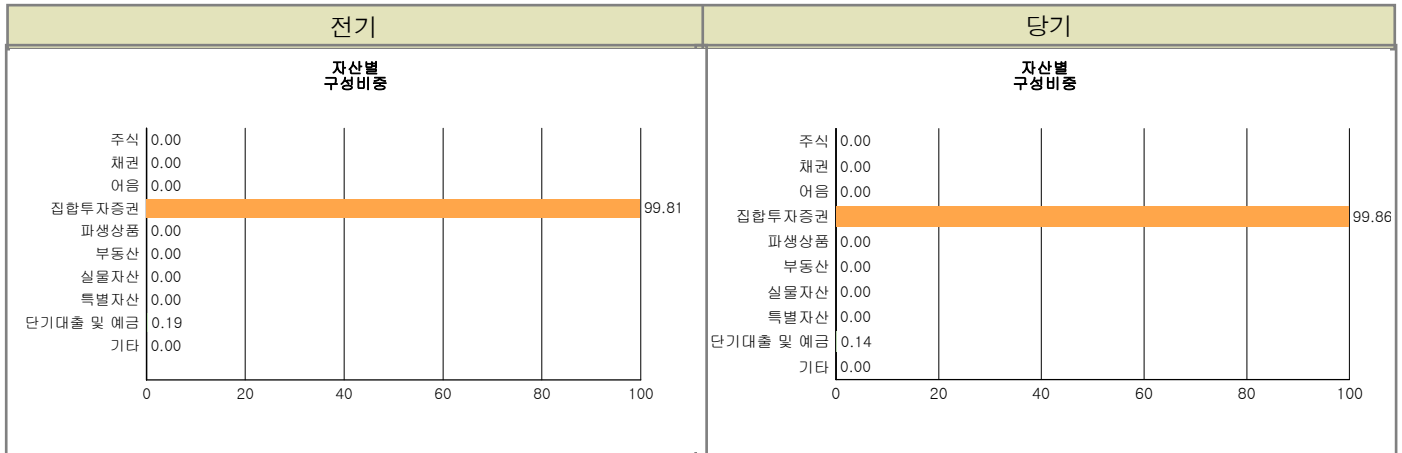
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

| 통화별 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|-----------|----|----|--------------|------------------|------|----|-----|------|----|--------------|----|-------------------|
| | 주식 | 채권 | 어음 및 기타증권 | 파생결 합증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 원화 | - | - | - | 5,498 (99.86) | - | - | - | - | - | 8 (0.14) | - | 5,505 (100.00) |
| 합계 | - | - | - | 5,498 (99.86) | - | - | - | - | - | 8 (0.14) | - | 5,505 (100.00) |

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



▶ 업종별, 국가별 투자비중

| 종 목 | 비 중 (%) | 종 목 | 비 중 (%) |
|-----|---------|-----|---------|
| | | | |

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

| 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 종목명 | 비중 |
|----|----------------------|-------|----|----------------------|-------|
| 1 | 파생결합증권 대우(ELS)5494 | 25.01 | 2 | 파생결합증권 우리투자(ELS)4473 | 25.01 |
| 3 | 파생결합증권 신한금융(ELS)2626 | 24.94 | 4 | 파생결합증권 대신(ELS)1404 | 24.90 |
| 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 |
|---------------|----|-------|---------------|---------------|------------|-----|
| 신한금융(ELS)2626 | | | 1,649,031,435 | 1,373,255,717 | 2011-05-09 | |
| 대신(ELS)1404 | | | 1,649,001,750 | 1,371,032,883 | 2011-05-09 | |
| 우리투자(ELS)4473 | | | 1,649,001,750 | 1,376,680,651 | 2011-05-09 | |
| 대우(ELS)5494 | | | 1,649,001,750 | 1,376,947,291 | 2011-05-09 | |
| 합계 | | | 6,596,036,685 | 5,497,916,542 | | |

▶ 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 | | 7,563,734 | 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 | 103 | 380,200 | 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 | 1 | 0.02 | 0 | 0.00 | |
| 판매회사 | - | - | - | - | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 보수 합계 | 1 | 0.03 | 0 | 0.00 | |
| 기타비용** | 0 | 0.00 | 0 | 0.01 | |
| 매매/증개수수료 | - | - | - | - | |

* 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 | 0.12 | 0.00 | 0.12 | 0.00 |
| 당기 | 0.03 | 0.00 | 0.03 | 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 회전을

해당사항 없음

▶ 최근 3분기 매매회전을 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 투자목적을 달성하지 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.