

자 산 운 용 보 고 서

공지사항

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

고객님이 가입하신 펀드는 2013-08-04(공시사유 발생일) 기준 자본시장법령상 소규모펀드에 해당하여 회사가 2013-08-05 관련 수시공시를 한 바 있음을 알려드립니다. 소규모펀드는 자본시장법에 따라 투자자에 대한 별도의 통보나 동의 없이 자산운용사가 임의해지 할 수 있음을 알려드립니다.

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)의 자산운용사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드자산보관자(신탁업자)인 '하나은행'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 : 4등급

| 펀드명칭 | | 금융투자협회 펀드코드 | |
|------------------------------------|--|-------------|------------|
| 마이다스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합) | | A7041 | |
| 펀드의 종류 | 투자신탁/증권(혼합채권)/추가형/개방형/모자형 | 최초설정일 | 2012-03-05 |
| 운용기간 | 3개월(2013-06-05 ~ 2013-09-04) | 존속기간 | 추가형 |
| 자산운용사 | 마이다스에셋자산운용 | | |
| 펀드자산보관(신탁업자) | 하나은행 | 일반사무관리회사 | SC펀드서비스 |
| 판매회사 | 우리은행 신한금융투자 삼성생명 동양증권 현대증권 하나은행 | | |
| 상품의 특징 | 본 상품은 근로자퇴직급여보장법 관련법령에 의하여 수익자의 노후생활을 대비하기 위한 자금 마련을 목적으로 하는 투자신탁이며, 마이다스 퇴직연금 거북이 증권 모투자신탁(주식)에 신탁재산의 40%이하를, 마이다스 퇴직연금 모투자신탁(채권)에 신탁재산의 60%이상을 투자합니다. 채권형 모투자신탁은 국공채 및 우량회사채에 주로 투자하여 자본이득 및 이자소득을 추구합니다. 주식운용은 주식을 매수하면서 지수선물을 매도하거나 주식을 공매도하는 롱숏전략을 통하여 장기간 동안 꾸준히 비교지수(KOSPI*4% + 매경BP종합채권지수[국고채 1~2년]*96%)이상의 수익을 제공하는 것을 목표로 합니다. 주요 투자위험으로는 이 투자신탁이 투자하는 주식형 모투자신탁의 주가가격변동 위험과 채권형 모투자신탁의 금리변동 위험이 있습니다. | | |

☞ 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

▶ 펀드 구성

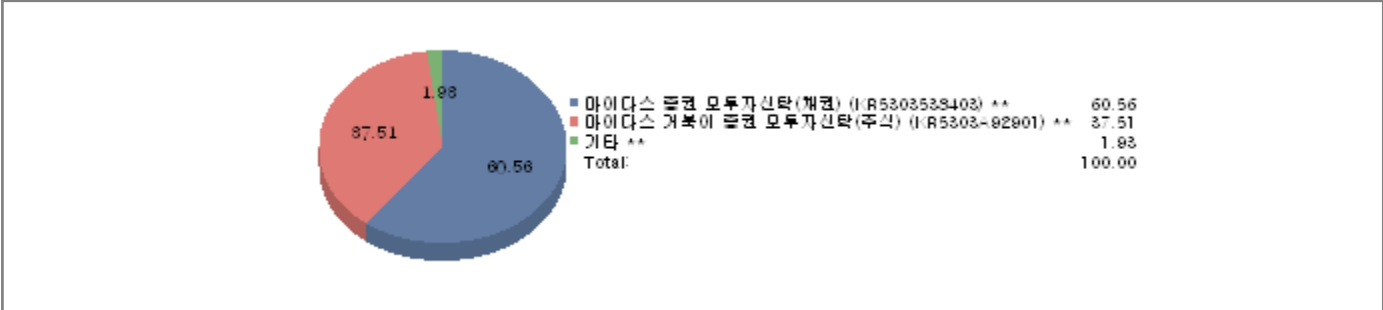
주된 투자대상

실제투자

| 모펀드 | 비중 (%)* |
|---|---------|
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) (KR5303538403) ** | 1.57 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) (KR5303A92901) ** | 8.35 |

수익증권 매입

마이더스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)



주) 위의 도표 및 그림은 현재 투자자가 가입하고 있는 자펀드만을 대상으로 보여주고 있습니다.

* 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비중을 나타냅니다.

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

▶ 자산현황

(단위 : 원, 좌/주, %)

| 마이더스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|------------------------------------|-------------|---------------|--------|
| 자산 총액 | 983,964,742 | 2,228,413,976 | 126.47 |
| 부채 총액 | 1,643,539 | 2,956,008 | 79.86 |
| 순자산총액 | 982,321,203 | 2,225,457,968 | 126.55 |
| 기준가격 | 1,016.10 | 1,029.54 | 1.32 |

(단위 : 원, 좌/주, %)

| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-------------------|----------------|----------------|--------|
| 자산 총액 | 84,015,127,246 | 85,854,676,090 | 2.19 |
| 부채 총액 | 3,189,494 | 2,011,428 | -36.94 |
| 순자산총액 | 84,011,937,752 | 85,852,664,662 | 2.19 |
| 기준가격 | 1,010.61 | 1,016.65 | 0.60 |

(단위 : 원, 좌/주, %)

| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-----------------------|---------------|----------------|----------|
| 자산 총액 | 4,262,426,569 | 12,331,350,097 | 189.30 |
| 부채 총액 | 52,765,920 | 2,336,303,299 | 4,327.67 |
| 순자산총액 | 4,209,660,649 | 9,995,046,798 | 137.43 |
| 기준가격 | 1,034.55 | 1,066.89 | 3.13 |

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, 좌)

| 분배금 기준일 | 분배금 지급금액 | 분배후 수탁고 | 기준가격(원) | | 비고 |
|---------|----------|---------|---------|---------|----|
| | | | 분배금 지급전 | 분배금 지급후 | |
| 해당사항없음 | | | | | |

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

펀드는 지난분기 1.32%의 수익률을 기록하였으며, 비교지수대비 0.81%pt 아웃퍼폼 했습니다. 동 기간중 펀드멘털 롱숏(Fundamental Long-Short) 전략에서의 이익과, 이벤트 차익거래(Event-driven)전략 등을 통해 수익을 거두었습니다. 롱(long) 포트폴리오 구성 종목 대형주 중에서 NAVER, KB금융, 현대미포조선, 대림산업, 삼성물산, 현대글로벌비스, OCI 등이 KOSPI대비 양호한 주가 흐름을 보인 반면, 기아차, POSCO, KT, 한국전력 등은 KOSPI대비 저조한 흐름을 보였습니다. 또한, 중.소형주 중에서 파라다이스, 동성화인텍, 대상, SBI모기지, 동양기전 등이 양호하였고, 다우기술, 휴맥스, 흥아해운, SK브로드밴드 등이 부진하였습니다. 숏(short) 포트폴리오 구성종목 중에서는 코웨이, 이마트, 한라비스테온공조 등이 주가하락으로 성과에 긍정적 영향을 미쳤습니다. 공모주는 파이오링크 등 3개 기업에 참여하여 소폭의 수익을 거두었습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

지수상승으로 KOSPI가 2,000pt에 근접한 상황에서, 향후 외국인 투자자의 행보가 중요하기에, 이에 영향을 줄 변수인 달러 인덱스와 미국 국제 수익률의 움직임을 주시하며 오픈 포지션의 비중을 탄력적으로 조절할 계획입니다. KOSPI 2,000pt기준으로도 여전히 한국 주식시장의 저평가는 유지되고 있으며, 수출 등 한국기업들의 펀드멘털도 양호한 편이나, 글로벌 투자자들의 위험선호 변화에 따라 언제든지 상황이 바뀔 수 있다는 판단하에 보수적인 포지션으로 변경에 대해서도 대비할 계획입니다. 3분기 기업실적 발표가 10월초부터 예정되어 있으며, 대체로 시장의 추정치를 크게 벗어나지는 않을 전망입니다. 따라서, 실적발표 결과에 따라 포트폴리오 업종비중 조정이 필요할 것으로 예상됩니다. 금년 2사분기부터 그 이전 5개 분기 연속 이어져오던 추정치 대비 실적 미달 흐름에 변화가 나타났고, 3분기에도 시장기대를 어느 정도 충족할 경우, 금년 연간 기업 실적에 대한 신뢰가 높아지면서, 한국시장의 저평가에 대해 다시 한번 초점을 맞추는 투자자들이 늘어날 전망입니다. 따라서, 금년 말까지 추가적인 상승 여력이 있다고 판단되며, 10월초의 조정국면을 추가적인 매수기회로 판단하고 대응할 계획입니다. 10월 중에는 앞서의 시장전망에 근거하여 변동성을 이용한 탄력적인 오픈포지션조정 전략이 필요하며, 외국인 투자자의 매수 강도가 제일 중요한 변수라고 판단됩니다. 3Q 기업실적 발표와 미 연방정부 폐쇄와 관련된 불확실성이 10월 중순 이후 해소국면에 들어가면 그 이후 흐름은, 내년 시장에 대한 기대감과 연말배당을 노린 외국인의 프로그램 매수가 들어왔던 과거 사례를 감안했을 때, 긍정적으로 판단합니다. 따라서 모펀드 기준으로 0~20% 범위내에서 탄력적으로 오픈 포지션을 조절하겠습니다. 펀드멘털 롱숏 전략과 관련하여, 주식 Long 포트폴리오는 3Q 실적이 양호한 기업 중심으로 편입하되 최근 2~3개월간 주가 움직임이 부진했던 내수기업에 관심을 가져야 할 것으로 판단되며, 경기민감업종 중 실적이 뒷받침되지 못하는 기업들은 비중을 축소할 계획입니다. 주식 Short 포트폴리오는 현재 유통, 화장품 등 내수기업중심으로 구성되어 있으나, 주가 하락을 기회로 삼아 일부 정리하고, 편입 대상 업종을 좀더 다변화할 계획입니다. 테크니컬 롱숏 전략은 당사의 매매 신호 발생에 따라 페어(pair)트레이딩 형태로 지속 실행해 나가고, 기타 이벤트 차익거래의 경우, 시장에서 불규칙적으로 발생하는 기회들을 잘 포착하여 추가 수익으로 연결시키도록 하겠습니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 1개월 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 | 설정일 |
|------------------------------------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 마이더스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합) | 0.37 | 1.32 | 2.95 | 3.94 | 5.69 | - | - | - | 9.56 |
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 0.28 | 0.60 | 1.13 | 2.03 | 2.67 | 7.06 | 11.15 | 25.93 | 42.04 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 0.70 | 3.13 | 7.22 | 8.94 | 13.10 | - | - | - | 20.80 |
| 비교지수 | 0.28 | 0.51 | 0.99 | 2.13 | 2.89 | - | - | - | 5.35 |

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 4% + 매경BP중합채권지수(국고채1~2년) 96%

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

▶ 연평균 수익률

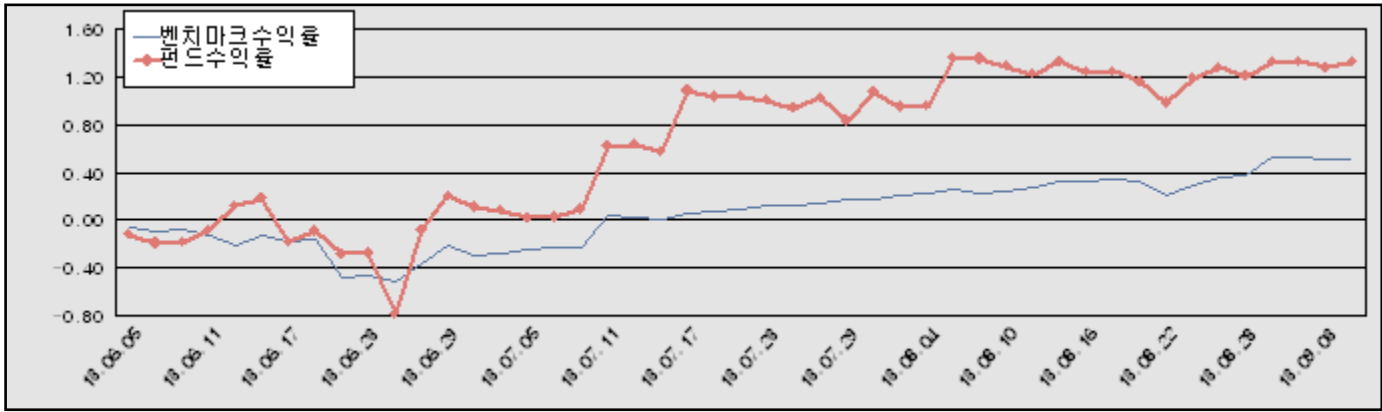
(단위 : %)

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|------------------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 마이더스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합) | 5.69 | - | - | - |
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 2.67 | 3.47 | 3.59 | 4.72 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 13.10 | - | - | - |
| 비교지수 | 2.89 | - | - | - |

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 4% + 매경BP중합채권지수(국고채1~2년) 96%

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

마이더스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)



비교지수(Bench Mark) = KOSPI 4% + 매경BP종합채권지수(국고채1~2년) 96%

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

▶ 손익현황

마이더스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(단위 : 백만원)

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|------|----|----|----|---------|------|----|-----|------|----|-----------|----|------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | - | - | - | 19 | - | - | - | - | - | 0 | -3 | 16 |
| 전기손익 | - | - | - | 10 | - | - | - | - | - | 0 | -2 | 8 |

마이더스 증권 모두투자신탁(채권)

(단위 : 백만원)

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|------|----|-----|----|---------|------|----|-----|------|----|-----------|----|------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | - | 395 | 10 | - | - | - | - | - | - | 78 | 4 | 487 |
| 전기손익 | - | 393 | 13 | - | - | - | - | - | - | 47 | -2 | 451 |

마이더스 거북이 증권 모두투자신탁(주식)

(단위 : 백만원)

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|------|----|----|----|---------|------|----|-----|------|----|-----------|-----|------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | 56 | - | - | - | 89 | - | - | - | - | 7 | -28 | 124 |
| 전기손익 | 71 | - | - | - | 59 | - | - | - | - | 5 | -13 | 122 |

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

마이더스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(단위 : 백만원, %)

| 통화별 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|--------|----|----|-----------|---------------|------|----|-----|------|----|-----------|----|----------------|
| | 주식 | 채권 | 어음 및 기타증권 | 집합투자 증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 원화 | - | - | - | 2,183 (97.94) | - | - | - | - | - | 46 (2.06) | - | 2,228 (100.00) |
| 합계 | - | - | - | 2,183 (97.94) | - | - | - | - | - | 46 (2.06) | - | 2,228 (100.00) |

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

마이더스 증권 모두투자신탁(채권)

(단위 : 백만원, %)

| 통화별 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|--------|----|----------------|-----------|---------|------|----|-----|------|----|--------------|--------------|-----------------|
| | 주식 | 채권 | 어음 및 기타증권 | 집합투자 증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 원화 | - | 75,028 (87.39) | - | - | - | - | - | - | - | 6,772 (7.89) | 4,055 (4.72) | 85,855 (100.00) |
| 합계 | - | 75,028 (87.39) | - | - | - | - | - | - | - | 6,772 (7.89) | 4,055 (4.72) | 85,855 (100.00) |

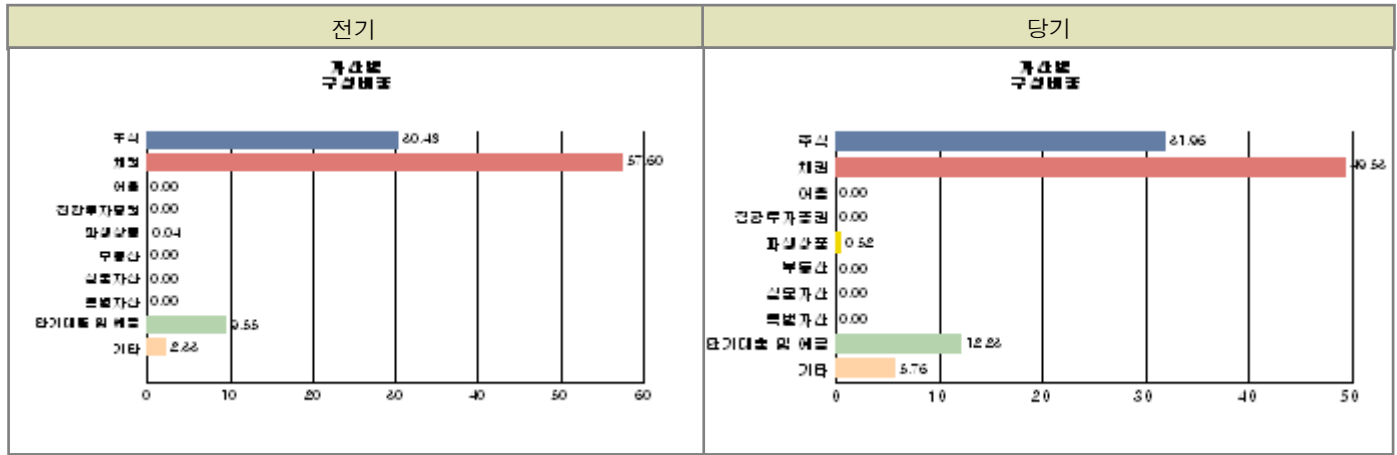
※ ()내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 백만원, %)

| 통화별 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|--------|------------------|----|-----------|--------|---------------|----|-----|------|----|------------------|---------------|--------------------|
| | 주식 | 채권 | 어음 및 기타증권 | 집합투자증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 원화 | 9,099 (73.79) | - | - | - | 149 (1.20) | - | - | - | - | 2,207 (17.90) | 877 (7.11) | 12,331 (100.00) |
| 합계 | 9,099 (73.79) | - | - | - | 149 (1.20) | - | - | - | - | 2,207 (17.90) | 877 (7.11) | 12,331 (100.00) |

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



주) 위의 자산구성현황은 투자자가 가입한 자펀드의 실제 자산구성내역이 아니고, 투자자의 이해를 돕기위해, 모펀드의 자산구성 내역과 해당 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율 등을 감안하여 산출한 것입니다.

▶ 업종별, 국가별 투자비중

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) 주식투자 상위 10종목

| 종 목 | 비 중(%) | 종 목 | 비 중(%) |
|---------|--------|--------|--------|
| 삼성전자 | 18.51 | 삼성생명 | 4.40 |
| 현대차 | 4.14 | NAVER | 2.97 |
| SK이노베이션 | 2.80 | LG화학 | 2.75 |
| LG전자 | 2.61 | 하나금융지주 | 2.37 |
| BS금융지주 | 2.02 | 현대모비스 | 2.01 |

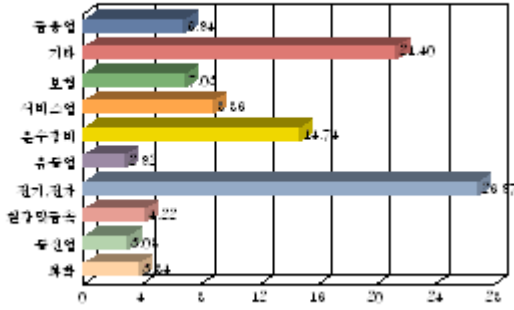
※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) 업종별 투자비중

| 종 목 | 비 중(%) | 종 목 | 비 중(%) |
|--------|--------|-------|--------|
| 전기, 전자 | 26.97 | 운수장비 | 14.74 |
| 서비스업 | 8.86 | 보험 | 7.03 |
| 금융업 | 6.94 | 철강및금속 | 4.22 |
| 화학 | 3.84 | 통신업 | 3.08 |
| 유통업 | 2.92 | 기타 | 21.40 |

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

[업종별 투자비중]



주1) 기준일 현재 펀드에 편입되어 있는 주식의 업종별 비율을 나타냅니다. 주2) 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분에 따릅니다.

▶ 투자대상 상위 10종목

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : %)

| 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 종목명 | 비중 | | |
|----|---------|------------|-------|-----|---------|------------|------|
| 1 | 주식 | 삼성전자 | 13.66 | 2 | 단기대출및예금 | 콜 1일물 2.62 | 7.30 |
| 3 | 단기대출및예금 | 콜 1일물 2.57 | 7.30 | 4 | 단기대출및예금 | 콜 1일물 2.32 | 3.24 |
| 5 | 주식 | 삼성생명 | 3.24 | 6 | 주식 | 현대차 | 3.05 |
| 7 | 주식 | NAVER | 2.19 | 8 | 주식 | SK이노베이션 | 2.07 |
| 9 | 주식 | LG화학 | 2.03 | 10 | 주식 | LG전자 | 1.93 |

※ 비중 : 펀드내 순자산 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : %)

| 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 종목명 | 비중 | | |
|----|-----|--------------------|-------|-----|---------|--------------------|-------|
| 1 | 채권 | 국고04500-1503(10-1) | 12.20 | 2 | 채권 | 예보상환기금채10-1 | 12.04 |
| 3 | 채권 | 국고03250-1412(11-6) | 11.81 | 4 | 채권 | 통안DC13-0910-0910 | 11.64 |
| 5 | 채권 | 우리금융지주36-1 | 8.21 | 6 | 채권 | 에스에이치공사128 | 8.19 |
| 7 | 채권 | 국고02750-1606(13-3) | 8.17 | 8 | 단기대출및예금 | 콜 1일물 2.62 | 7.80 |
| 9 | 채권 | 국고03500-1609(11-5) | 4.80 | 10 | 채권 | 국고03500-1703(12-1) | 4.80 |

※ 비중 : 펀드내 순자산 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

* 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

■ 상위 5개 종목

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 주, 원, %)

| 종목 | 보유수량 | 평가금액 | 비중 |
|---------|-------|---------------|-------|
| 삼성전자 | 1,257 | 1,684,380,000 | 18.51 |
| 삼성생명 | 4,000 | 400,000,000 | 4.40 |
| 현대차 | 1,552 | 376,360,000 | 4.14 |
| NAVER | 619 | 270,503,000 | 2.97 |
| SK이노베이션 | 1,846 | 254,748,000 | 2.80 |

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

▶ 채권

■ 상위 5개 종목

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 원,%)

| 종목 | 액면가액 | 평가금액 | 발행일 | 상환일 | 보증기관 | 신용등급 | 비중 |
|--------------------|----------------|----------------|------------|------------|---------|------|-------|
| 국고04500-1503(10-1) | 10,000,000,000 | 10,473,530,000 | 2010-03-10 | 2015-03-10 | 대한민국 정부 | | 13.96 |
| 예보상환기금채10-1 | 10,000,000,000 | 10,337,080,000 | 2010-02-18 | 2015-02-18 | | | 13.78 |
| 국고03250-1412(11-6) | 10,000,000,000 | 10,139,590,000 | 2011-12-10 | 2014-12-10 | 대한민국 정부 | | 13.51 |
| 통안DC13-0910-0910 | 10,000,000,000 | 9,996,480,000 | 2013-06-11 | 2013-09-10 | 대한민국 정부 | | 13.32 |
| 우리금융지주36-1 | 7,000,000,000 | 7,044,611,000 | 2011-10-28 | 2013-10-28 | | AAA | 9.39 |

※ 상위 5개 종목만 기재함. ※ 비중 : 채권 총액중 해당 종목이 차지하는 비중.

▶ 어음

해당사항 없음

▶ 집합투자증권

■ 상위 5개 종목

마이더스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(단위 : 원)

| 종목 | 종류 | 자산운용사 | 설정원본 | 순자산금액 | 취득일 | 비중 |
|-------------|------|------------|---------------|---------------|------------|------|
| 마이더스증권모(채권) | 수익증권 | 마이더스에셋자산운용 | 1,340,396,153 | 1,347,648,677 | 2012-03-06 | 1.57 |
| 마이더스거북이주식모 | 수익증권 | 마이더스에셋자산운용 | 832,959,589 | 834,855,838 | 2012-03-06 | 8.35 |

※ 비중 : 자펀드가 해당 모펀드에서 차지하는 비중

▶ 장내파생상품

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 계약, 원)

| 종목명 | 매수/매도 | 계약수 | 미결제약정금액 | 위탁증거금 |
|-----------------------|-------|-----|---------------|-------------|
| 코스피200 F 201309 | 매도 | 60 | 7,569,000,000 | |
| 코스피200 C 201309 252.5 | 매도 | 10 | 11,700,000 | |
| 합계 | | 70 | 7,580,700,000 | 132,782,240 |

주) 개별계약 등의 위험평가액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 장외파생상품

해당사항 없음

▶ 부동산(임대)

해당사항 없음

▶ 부동산(자금대여 및 차입)

해당사항 없음

▶ 특별자산

해당사항 없음

▶ 유동성

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|------------|------|------------|-------------|------|------------|----|
| 콜 1일물 2.62 | 동부증권 | 2013-09-04 | 900,064,603 | 2.62 | 2013-09-05 | |
| 콜 1일물 2.57 | 교보증권 | 2013-09-04 | 900,063,370 | 2.57 | 2013-09-05 | |
| 콜 1일물 2.32 | 신한은행 | 2013-09-04 | 400,025,424 | 2.32 | 2013-09-05 | |
| 예금 | 하나은행 | | 7,067,957 | 2.07 | | |

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 증권 모두자신탁(채권)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|------------|------|------------|---------------|------|------------|----|
| 콜 1일물 2.62 | 동부증권 | 2013-09-04 | 6,700,480,931 | 2.62 | 2013-09-05 | |
| 예금 | 하나은행 | | 71,238,559 | 2.07 | | |

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|----|------|----------|------------|------|-----|----|
| 예금 | 하나은행 | | 45,909,461 | 2.07 | | |

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ 기타

마이더스 거북이 증권 모두자신탁(주식)

(단위 : 원,%)

| 종류 | 평가금액 | 비고 |
|-----------|-------------|----|
| 유가증권매도미수금 | 886,520,267 | |

주) 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 운용전문인력

(단위 : 개, 백만원)

| 성명 | 운용개시일 | 직위 | 운용중인 다른 펀드 현황 | | 주요 경력 및 운용내역(최근5년) | 협회등록번호 |
|-----|------------|---------|---------------|---------|---|------------|
| | | | 펀드 수 | 운용 규모 | | |
| 허필석 | 2012-05-02 | 대표이사 | 9 | 91,360 | 서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이더스에셋자산운용 대표이사 주요운용펀드 : 마이더스블루칩배당증권투자신탁1호(주식) | 2109000325 |
| 오종록 | 2012-05-02 | 채권운용파트장 | 10 | 175,955 | 서울대학교 경제학과, 교보투신, 한누리투자증권, 이트레이드증권, 알리안츠생명보험 자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 채권운용본부 부장 주요운용펀드 : 마이더스 증권 모두자신탁(채권) | 2109000845 |
| 채경섭 | 2013-04-09 | 주식운용팀장 | 6 | 21,631 | BASF Company.Ltd., 신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 주식운용본부 팀장 주요운용펀드 : 마이더스신성장기업포커스증권투자신탁(주) | 2109000941 |

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

※ 성과보수가 있는 펀드 및 투자일임계약 운용규모

허필석 : 없음

오종록 : 펀드수(2) 운용규모(150,991) (단위:개, 백만원)

채경섭 : 없음

▶ 운용전문인력 변경내역

| 기간 | 운용전문인력 |
|-------------------------|--------|
| 2012-05-02 ~ 2013-04-08 | 이승문 |

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

마이더스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|--------------|----|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | 1 | 0.07 | 1 | 0.07 | |
| 판매회사 | 1 | 0.13 | 2 | 0.13 | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 보수 합계 | 2 | 0.21 | 3 | 0.21 | |
| 기타비용** | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 매매/중개수수료 | - | - | - | - | |
| 증권거래세 | - | - | - | - | |

마이더스 증권 모두자신탁(채권)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|--------------|----|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | - | - | - | - | |
| 판매회사 | - | - | - | - | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | - | - | - | - | |
| 일반사무관리회사 | - | - | - | - | |
| 보수 합계 | - | - | - | - | |
| 기타비용** | 2 | 0.00 | 1 | 0.00 | |
| 매매/중개수수료 | 1 | 0.00 | 1 | 0.00 | |
| 증권거래세 | - | - | - | - | |

마이더스 거북이 증권 모두자신탁(주식)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|--------------|----|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | - | - | - | - | |
| 판매회사 | - | - | - | - | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | - | - | - | - | |
| 일반사무관리회사 | - | - | - | - | |
| 보수 합계 | - | - | - | - | |
| 기타비용** | - | - | - | - | |
| 매매/중개수수료 | 14 | 0.36 | 29 | 0.61 | |
| 증권거래세 | 16 | 0.41 | 34 | 0.72 | |

* 펀드의 순자산평잔 대비 비율

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

▶ 총보수비용 비율

마이더스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|-----------|--------------|--------------|--------------|
| | 총보수, 비용비율 | 매매, 중개수수료 비율 | 합성 총보수, 비용비율 | 매매, 중개수수료 비율 |
| 전기 | 0.85 | 0.00 | 0.85 | 0.54 |
| 당기 | 0.85 | 0.00 | 0.86 | 0.90 |

마이더스 증권 모두자신탁(채권)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|-----------|--------------|--------------|--------------|
| | 총보수, 비용비율 | 매매, 중개수수료 비율 | 합성 총보수, 비용비율 | 매매, 중개수수료 비율 |
| 전기 | 0.01 | 0.00 | 0.01 | 0.00 |
| 당기 | 0.01 | 0.00 | 0.01 | 0.00 |

마이더스 거북이 증권 모두자신탁(주식)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|-----------|--------------|--------------|--------------|
| | 총보수, 비용비율 | 매매, 중개수수료 비율 | 합성 총보수, 비용비율 | 매매, 중개수수료 비율 |
| 전기 | 0.00 | 1.43 | 0.00 | 1.43 |
| 당기 | 0.00 | 2.44 | 0.00 | 2.44 |

- 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

마이다스 퇴직연금 거북이 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(단위 : 주,원,%)

| 매수 | | 매도 | | 매매회전율 | |
|----|----|----|----|-------|------|
| 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 3개월 | 연환산 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | 0.00 |

마이다스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 주,원,%)

| 매수 | | 매도 | | 매매회전율 | |
|----|----|----|----|-------|------|
| 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 3개월 | 연환산 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | 0.00 |

마이다스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 주,원,%)

| 매수 | | 매도 | | 매매회전율 | |
|---------|----------------|---------|---------------|--------|--------|
| 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 3개월 | 연환산 |
| 564,104 | 14,985,599,930 | 395,462 | 9,333,478,330 | 244.07 | 978.94 |

※ 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율.

※ 매매회전율이 높을 경우 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

마이다스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : %)

| 2013-06-05 ~ 2013-09-04 | 2013-03-05 ~ 2013-06-04 | 2012-12-05 ~ 2013-03-04 |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 244.07 | 171.75 | 163.51 |