

자 산 운 용 보 고 서

공지사항

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

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 거북이 30 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 거북이 30 증권 자투자신탁 1호(채권혼합) | | AC813 | |
| 마이다스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호A(채권혼합) | | AC815 | |
| 마이다스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호C(채권혼합) | | AC816 | |
| 펀드의 종류 | 투자신탁/증권(혼합채권)/추가형/개방형/종류형/모자형 | 최초설정일 | 2012-10-09 |
| 운용기간 | 3개월(2014-01-09 ~ 2014-04-08) | 존속기간 | 추가형 |
| 자산운용사 | 마이다스에셋자산운용 | | |
| 펀드자산보관(신탁업자) | 하나은행 | 일반사무관리회사 | SC펀드서비스 |
| 판매회사 | 우리은행 하나대투증권 NH농협은행(주) 우리투자증권 미래에셋증권 부산은행 삼성생명 한국외환은행 동부증권 신한금융투자 현대증권 | | |
| 상품의 특징 | 본 상품은 혼합형 펀드로서 주식에 30% 이하, 채권등에 70% 이상을 투자하고 있습니다. KOSPI등락률3%+매경BP 종합채권지수 1~2년물 수익률 97%를 벤치마크로 하여 벤치마크대비 초과성과를 목표로 하고 있습니다. 따라서 수익자는 주식형 펀드와 비교하여 상대적으로 안정된 수익을 기대할 수 있는 상품입니다. 룡숏 전략 등 다양한 절대수익 추구전략을 복합적으로 활용하여 투자위험을 축소하고, 국내 주식 매매차익에 대한 비과세로 주식투자부분에 대해 절세효과를 기대할 수 있습니다. 본 상품은 자산의 30%까지 주식에 투자되는 특성상 유가, 환율, 금리 등 다양한 거시변수와 투자된 기업의 고유위험이 수익률에 영향을 미치는 특성을 가지고 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) ** | 4.71 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) (KR5303A92901) ** | 0.63 |

수익증권 매입

마이더스 거북이 30 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.

수익증권 매입

| 종류형 펀드 | 종류(Class)별 | A | B | C | D | E | F | H | I | P | W | J | 기타 |
|--------|------------|----------|-------|---|-------|---|---|---|---|---|---|---|----|
| | | 비중(%)*** | 36.39 | - | 63.61 | - | - | - | - | - | - | - | - |

*** 자펀드에 편입되어 있는 각 종류(Class)별 구성비중을 나타낸 수치입니다.

▶ 재산현황

(단위 : 원, 좌/주. %)

| 마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호(채권혼합) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-------------------------------|---------------|----------------|--------|
| 자산 총액 | 7,906,803,169 | 16,073,717,869 | 103.29 |
| 부채 총액 | 117,587,569 | 15,816,273 | -86.55 |
| 순자산총액 | 7,789,215,600 | 16,057,901,596 | 106.16 |
| 기준가격 | 1,068.81 | 1,073.43 | 0.43 |

(단위 : 원, 좌/주. %)

| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-------------------|-----------------|-----------------|--------|
| 자산 총액 | 140,323,370,668 | 234,535,896,195 | 67.14 |
| 부채 총액 | 128,239,970 | 2,331,676 | -98.18 |
| 순자산총액 | 140,195,130,698 | 234,533,564,519 | 67.29 |
| 기준가격 | 1,028.59 | 1,007.46 | -2.05 |

(단위 : 원, 좌/주. %)

| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-----------------------|-----------------|-----------------|--------|
| 자산 총액 | 321,749,976,607 | 727,636,983,103 | 126.15 |
| 부채 총액 | 16,528,749,157 | 49,938,909,013 | 202.13 |
| 순자산총액 | 305,221,227,450 | 677,698,074,090 | 122.04 |
| 기준가격 | 1,119.47 | 990.84 | -11.49 |

(단위 : 원. %)

| 종류(Class)별 기준가격 현황 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|--------------------------------|----------|----------|------|
| 마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호A(채권혼합) | 1,013.44 | 1,015.94 | 0.25 |
| 마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호C(채권혼합) | 1,012.57 | 1,014.20 | 0.16 |

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

거북이30증권자1A채훈

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북이30증권자1C채훈

(단위 : 백만원, 좌)

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

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

지난분기 펀드의 수익률은 -0.15%(클래스A 기준)를 기록하였습니다. 동 기간중 펀드멘털 롱숏(Fundamental Long-Short) 전략, 테크니컬 롱숏(Technical Long-Short),이벤트 차익거래(Event-driven) 전략 등 전략별로 다양하게 운용했으며, 펀드멘털 롱숏전략에서 -0.45%의 손실이 발생했지만, 테크니컬 롱숏 +0.05%, 이벤트 차익거래 0.03%, 채권 수익률 0.17%였습니다. 롱(long) 포트폴리오 구성 종목 중에서는 삼성물산, 한국전력, LG전자, 현대글로비스 등이 KOSPI200 대비 양호한 추가 흐름을 보인 반면, 롯데쇼핑, 오리온, 현대로템, SK이노베이션 등은 KOSPI200 대비 저조한 흐름을 보였습니다. 또한 중소형주 중에서는 호텔신라, KG모빌리언스, SK네트웍스, 팜스코 등이 양호하였고, 빙그레, 아시아나항공 등이 부진하였습니다. 숏(short) 포트폴리오 구성종목 중에서는, 두산인프라코어, 현대중공업, 대한항공 등이 추가하락으로 성과에 기여하였으나, 아모레G, SK네트웍스 등은 추가상승으로 성과에 부정적인 영향을 미쳤습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

2분기는 3월말부터 이머징 마켓으로 투자금이 유입 개선 둔화되고 기업별로 실적이 차별화 되면서 주가레벨은 박스권을 유지하는 가운데 실적에 따라 종목 선별이 중요할 것으로 판단됩니다. 3월말과 같이 외국인인 순매수세가 다시 강하게 이어진다면 모펀드 기준으로 10~20% 범위내에서 좀더 능동적으로 오픈 포지션을 조절하겠으나, 박스권 장세가 이어진다면 5~10% 정도로 보수적으로 운용할 계획입니다. 따라서 아직 구체적인 외국인의 변화된 흐름이 보이지 않기 때문에 연초와 같이 중소형주, 내수주 비중을 어느 정도 가져가며 방어적인 포트폴리오를 구성할 계획입니다. 만약 잠시 주춤했던 자금이 이머징 주식으로 본격적으로 이동한다면 주식시장의 성격이 대형주, 수출주 위주로 바뀔 수 있으므로 시장의 변화 움직임을 적극적으로 모니터링 하면서 반도체, 자동차, 은행, 화학 업종 중심으로 운용방향을 선회할 계획이며 동시에 가격대와 밸류에이션 수준에 따른 차별적인 대응을 해나갈 계획입니다. 펀드멘털 롱숏 전략과 관련하여, 주식 Long 포트폴리오는 올해 연간으로 이익성장이 예상되는 업종과 수급상 과매도권에 있는 일부종목 중심으로 비중을 확대하고, 경기민감업종 중 실적이 뒷받침되지 못하는 기업들은 비중을 축소하거나 주식 Short 포트폴리오에 편입할 계획입니다. 테크니컬 롱숏 전략은 당사의 매매 신호 발생에 따라 페어(pair)트레이딩 형태와 계절성을 이용한 전략으로 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 거북이 30 증권 자투자신탁 1호(채권혼합) | -0.09 | 0.43 | 1.97 | 3.92 | 4.68 | - | - | - | 7.34 |
| 마이더스 증권 모두자신탁(채권) | 0.28 | 0.75 | 1.56 | 2.48 | 2.67 | 6.84 | 11.14 | 20.60 | 44.78 |
| 마이더스 거북이 증권 모두자신탁(주식) | -1.08 | -0.48 | 2.88 | 7.42 | 9.49 | 24.32 | - | - | 26.15 |
| 마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호A(채권혼합) | -0.15 | 0.25 | 1.59 | 3.34 | 3.90 | - | - | - | 5.41 |
| 마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호C(채권혼합) | -0.18 | 0.16 | 1.42 | 3.08 | 3.54 | - | - | - | 5.60 |
| 비교지수 | 0.30 | 0.76 | 1.50 | 2.65 | 2.73 | - | - | - | 4.48 |

비교지수(Benchmark) = KOSPI 3% +매경BP종합(국고채1-2년물)97%

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

▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|--------------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호(채권혼합) | 4.68 | - | - | - |
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 2.67 | 3.36 | 3.58 | 3.82 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 9.49 | 11.50 | - | - |
| 마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호A(채권혼합) | 3.90 | - | - | - |
| 마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호C(채권혼합) | 3.54 | - | - | - |
| 비교지수 | 2.73 | - | - | - |

비교지수(Benchmark) = KOSPI 3% +매경BP종합(국고채1-2년물)97%

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

마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)



비교지수(Benchmark) = KOSPI 3% +매경BP종합(국고채1-2년물)97%

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

▶ 손익현황

마이더스 거북이 30 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 | - | - | 0 | -122 | - | - | - | - | - | 3 | 148 | 29 |
| 전기손익 | - | - | - | 117 | - | - | - | - | - | 2 | 1 | 120 |

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 백만원)

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|------|----|-------|----|---------|------|----|-----|------|----|-----------|----|-------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | - | 1,260 | 25 | - | - | - | - | - | - | 67 | -3 | 1,349 |
| 전기손익 | - | 939 | 42 | - | - | - | - | - | - | 36 | -2 | 1,015 |

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 백만원)

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|------|--------|----|-----|---------|---------|----|-----|------|----|-----------|-------|--------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | 6.784 | 19 | 151 | 253 | -10,445 | - | - | - | - | 703 | -805 | -3,340 |
| 전기손익 | -3.483 | - | - | -350 | 7,037 | - | - | - | - | 267 | 2,268 | 5,739 |

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

마이더스 거북이 30 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 | - | - | - | 15,346 (95.47) | - | - | - | - | - | 728 (4.53) | - | 16,074 (100.00) |
| 합계 | - | - | - | 15,346 (95.47) | - | - | - | - | - | 728 (4.53) | - | 16,074 (100.00) |

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

마이더스 증권 모두자신탁(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 | - | 213,003 (90.82) | - | - | - | - | - | - | - | 21,533 (9.18) | - | 234,536 (100.00) |
| 합계 | - | 213,003 (90.82) | - | - | - | - | - | - | - | 21,533 (9.18) | - | 234,536 (100.00) |

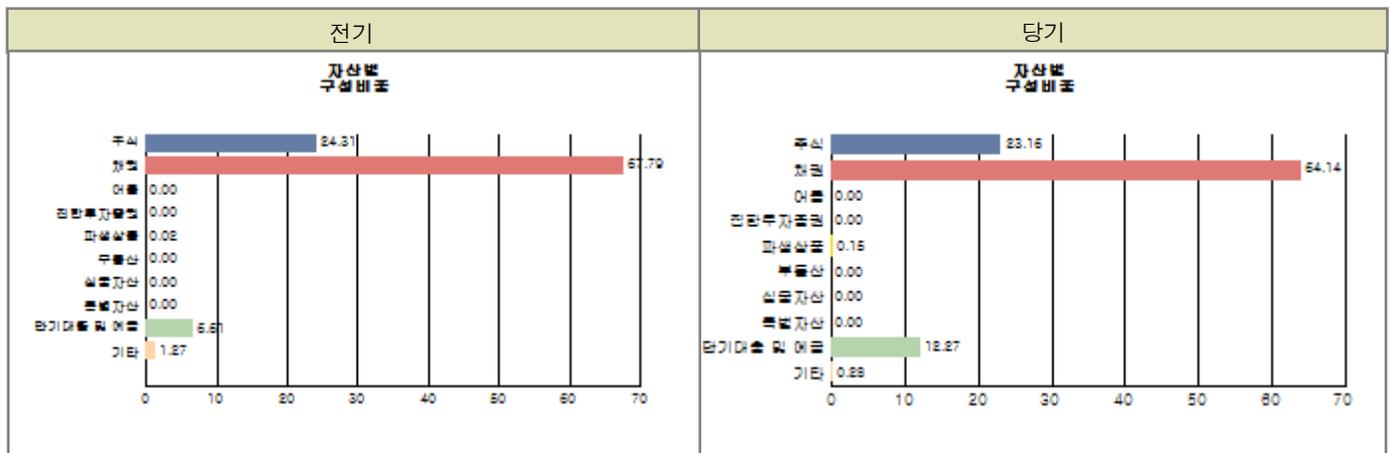
※ ()내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.

마이더스 거북이 증권 모두자신탁(주식)

(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 | 572,671 (78.70) | 1,019 (0.14) | - | - | 3,589 (0.49) | - | - | - | - | 143,397 (19.71) | 6,962 (0.96) | 727,637 (100.00) |
| 합계 | 572,671 (78.70) | 1,019 (0.14) | - | - | 3,589 (0.49) | - | - | - | - | 143,397 (19.71) | 6,962 (0.96) | 727,637 (100.00) |

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



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

▶ 업종별, 국가별 투자비중

마이더스 거북이 증권 모두자신탁(주식)

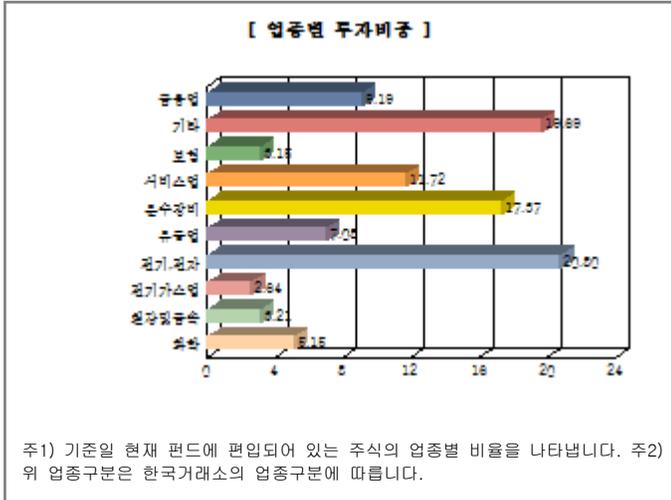
주식투자 상위 10종목

| 종 목 | 비 중 (%) | 종 목 | 비 중 (%) |
|--------|---------|---------|---------|
| 삼성전자 | 15.72 | 현대차 | 4.48 |
| 현대모비스 | 3.05 | NAVER | 2.94 |
| SK하이닉스 | 2.90 | 강원랜드 | 2.53 |
| 하나금융지주 | 2.31 | 한국전력 | 2.13 |
| 신한지주 | 2.12 | 대우인터내셔널 | 2.11 |

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

| 종 목 | 비 중(%) | 종 목 | 비 중(%) |
|--------|--------|------|--------|
| 전기, 전자 | 20.80 | 운수장비 | 17.37 |
| 서비스업 | 11.72 | 금융업 | 9.19 |
| 유통업 | 7.08 | 화학 | 5.15 |
| 철강및금속 | 3.21 | 보험 | 3.15 |
| 전기가공업 | 2.64 | 기타 | 19.69 |

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중



▶ 투자대상 상위 10종목

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : %)

| 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 종목명 | 비중 | | |
|----|---------|------------|-------|-----|---------|-------------------|------|
| 1 | 주식 | 삼성전자 | 12.38 | 2 | 단기대출및예금 | REPO매수 (14040817) | 6.58 |
| 3 | 단기대출및예금 | 콜 2일물 2.54 | 4.59 | 4 | 주식 | 현대차 | 3.52 |
| 5 | 주식 | 현대모비스 | 2.40 | 6 | 주식 | NAVER | 2.31 |
| 7 | 주식 | SK하이닉스 | 2.29 | 8 | 단기대출및예금 | REPO매수 (14040818) | 2.13 |
| 9 | 주식 | 강원랜드 | 1.99 | 10 | 주식 | 하나금융지주 | 1.82 |

※ 비중 : 펀드내 순자산 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : %)

| 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 종목명 | 비중 | | |
|----|-----|--------------------|-------|-----|---------|--------------------|------|
| 1 | 채권 | 국고02750-1606(13-3) | 20.62 | 2 | 단기대출및예금 | REPO매수 (14040837) | 7.63 |
| 3 | 채권 | 국고02750-1709(12-4) | 6.78 | 4 | 채권 | 예보상환기금채10-1 | 4.38 |
| 5 | 채권 | 국고04500-1503(10-1) | 4.35 | 6 | 채권 | 국고03500-1703(12-1) | 4.35 |
| 7 | 채권 | 예보상환기금채12-2 | 4.34 | 8 | 채권 | 국고03250-1506(12-2) | 4.34 |
| 9 | 채권 | 국고03000-1612(13-7) | 4.32 | 10 | 채권 | SK255-1 | 4.31 |

※ 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 | 64,597 | 90,048,218,000 | 15.72 |
| 현대차 | 103,127 | 25,627,059,500 | 4.48 |
| 현대모비스 | 55,295 | 17,445,572,500 | 3.05 |
| NAVER | 22,671 | 16,821,882,000 | 2.94 |
| SK하이닉스 | 452,424 | 16,626,582,000 | 2.90 |

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

■ 총 발행수량의 1% 초과 종목

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 원, 주, %)

| 종목 | 보유수량 | 평가금액 | 비중 ※ | 비고 ※※ |
|--------|---------|---------------|------|-------|
| 서부T&D | 427,413 | 7,672,063,350 | 1.34 | 1.49 |
| 동양기전 | 482,258 | 4,991,370,300 | 0.87 | 1.52 |
| 백산 | 938,257 | 2,767,858,150 | 0.48 | 1.37 |
| KT서브마린 | 489,037 | 2,393,836,115 | 0.42 | 2.23 |

※비중 : 해당 종목의 포트폴리오 내 비중 ※※비고 : 해당 종목의 보유지분

▶ 채권

■ 상위 5개 종목

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 원, %)

| 종목 | 액면가액 | 평가금액 | 발행일 | 상환일 | 보증기관 | 신용등급 | 비중 |
|-----------|---------------|---------------|------------|------------|------|------|--------|
| 유니온스틸39CB | 1,000,000,000 | 1,019,177,000 | 2014-02-24 | 2017-02-24 | | A- | 100.00 |

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

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 원, %)

| 종목 | 액면가액 | 평가금액 | 발행일 | 상환일 | 보증기관 | 신용등급 | 비중 |
|--------------------|----------------|----------------|------------|------------|---------|------|-------|
| 국고02750-1606(13-3) | 48,000,000,000 | 48,365,472,000 | 2013-06-10 | 2016-06-10 | 대한민국 정부 | | 22.71 |
| 국고02750-1709(12-4) | 16,000,000,000 | 15,912,864,000 | 2012-09-10 | 2017-09-10 | 대한민국 정부 | | 7.47 |
| 예보상환기금채10-1 | 10,000,000,000 | 10,267,260,000 | 2010-02-18 | 2015-02-18 | | | 4.82 |
| 국고04500-1503(10-1) | 10,000,000,000 | 10,204,200,000 | 2010-03-10 | 2015-03-10 | 대한민국 정부 | | 4.79 |
| 국고03500-1703(12-1) | 10,000,000,000 | 10,190,750,000 | 2012-03-10 | 2017-03-10 | 대한민국 정부 | | 4.78 |

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

▶ 어음

해당사항 없음

▶ 집합투자증권

■ 상위 5개 종목

마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(단위 : 원)

| 종목 | 종류 | 자산운용사 | 설정원본 | 순자산금액 | 취득일 | 비중 |
|-------------|------|------------|----------------|----------------|------------|------|
| 마이더스증권모(채권) | 수익증권 | 마이더스에셋자산운용 | 11,092,458,295 | 11,054,013,390 | 2012-10-10 | 4.71 |
| 마이더스거북이주식모 | 수익증권 | 마이더스에셋자산운용 | 4,607,028,850 | 4,291,797,410 | 2012-10-10 | 0.63 |

※ 비중 : 자펀드가 해당 모펀드에서 차지하는 비중

▶ 장내파생상품

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 계약, 원)

| 종목명 | 매수/매도 | 계약수 | 미결제약정금액 | 위탁증거금 |
|-----------------|-------|-------|-----------------|---------------|
| 코스피200 F 201406 | 매도 | 2,817 | 369,801,675,000 | |
| 코스피200 F 201406 | 매도 | 650 | 85,328,750,000 | |
| 합계 | | 3,467 | 455,130,425,000 | 3,588,506,370 |

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 30 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|------------|--------|------------|-------------|------|------------|----|
| 콜 2일물 2.54 | 미래에셋증권 | 2014-04-08 | 500,035,195 | 2.54 | 2014-04-10 | |
| 예금 | 하나은행 | | 227,871,874 | 2.07 | | |

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|-------------------|---------|------------|----------------|------|------------|----|
| REPO매수 (14040817) | 서울외국환중개 | 2014-04-08 | 47,903,372,685 | 2.57 | 2014-04-10 | |
| 콜 2일물 2.54 | 미래에셋증권 | 2014-04-08 | 33,402,350,994 | 2.54 | 2014-04-10 | |
| REPO매수 (14040818) | 서울외국환중개 | 2014-04-08 | 15,501,099,863 | 2.59 | 2014-04-10 | |
| REPO매수 (14040831) | 서울외국환중개 | 2014-04-08 | 9,800,690,027 | 2.57 | 2014-04-10 | |
| REPO매수 (14040825) | 서울외국환중개 | 2014-04-08 | 9,600,675,945 | 2.57 | 2014-04-10 | |

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|-------------------|---------|------------|----------------|------|------------|----|
| REPO매수 (14040837) | 한국자금중개 | 2014-04-08 | 17,901,270,164 | 2.59 | 2014-04-10 | |
| REPO매수 (14040823) | 서울외국환중개 | 2014-04-08 | 3,500,248,356 | 2.59 | 2014-04-10 | |
| 예금 | 하나은행 | | 131,366,305 | 2.07 | | |

※ 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 | | |
| 허필석 | 2012-10-09 | 대표이사 | 12 | 904,100 | 서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이더스에셋자산운용 대표이사 주요운용펀드 : 마이더스블루칩배당증권투자신탁1호(주식) | 2109000325 |
| 오종록 | 2012-10-09 | 채권운용파트장 | 12 | 995,930 | 서울대학교 경제학과, 교보투신, 한누리투자증권, 이트레이드증권, 알리안츠생명보험 자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 채권운용본부 부장 주요운용펀드 : 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 2109000845 |
| 채경섭 | 2013-04-09 | 팀장 | 10 | 843,650 | BASF Company.Ltd., 신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 주식운용본부 팀장 주요운용펀드 : 마이더스신성장기업포커스증권투자신탁(주) | 2109000941 |
| 권순신 | 2013-09-11 | 과장 | 8 | 700,440 | 서울대학교 재료공학부, 메트라이프, 알리안츠, 現 마이더스에셋자산운용 채권운용본부 | 2110000311 |

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

권순신 : 없음

▶ 운용전문인력 변경내역

| 기간 | 운용전문인력 |
|-----------------|--------|
| 2012-10-09 ~ 현재 | 박정환 |
| 2012-10-09 ~ 현재 | 오종록 |
| 2012-10-09 ~ 현재 | 허필석 |
| 2013-04-09 ~ 현재 | 채경섭 |
| 2013-09-11 ~ 현재 | 권순신 |

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|------|--------|------|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | - | - | - | - | |
| 판매회사 | - | - | - | - | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | - | - | - | - | |
| 일반사무관리회사 | - | - | - | - | |
| 보수 합계 | - | - | - | - | |
| 기타비용** | - | - | - | - | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | - |
| | 합계 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| 증권거래세 | - | - | - | - | |

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|------|--------|------|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | - | - | - | - | |
| 판매회사 | - | - | - | - | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | - | - | - | - | |
| 일반사무관리회사 | - | - | - | - | |
| 보수 합계 | - | - | - | - | |
| 기타비용** | 2 | 0.00 | 3 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | 1 | 0.00 | 1 | 0.00 |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | - |
| | 합계 | 1 | 0.00 | 1 | 0.00 |
| 증권거래세 | - | - | - | - | |

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|------|--------|------|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | - | - | - | - | |
| 판매회사 | - | - | - | - | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | - | - | - | - | |
| 일반사무관리회사 | - | - | - | - | |
| 보수 합계 | - | - | - | - | |
| 기타비용** | 2 | 0.00 | 3 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | 316 | 0.16 | 667 | 0.13 |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | 407 | 0.21 | 592 | 0.11 |
| | 합계 | 722 | 0.37 | 1,259 | 0.24 |
| 증권거래세 | 519 | 0.27 | 677 | 0.13 | |

마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호A(채권혼합)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | 2 | 0.09 | 3 | 0.09 | |
| 판매회사 | 2 | 0.09 | 3 | 0.09 | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| 보수 합계 | 4 | 0.19 | 7 | 0.18 | |
| 기타비용** | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | - | - | - | - |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | - |
| | 합계 | - | - | - | - |
| 증권거래세 | - | - | - | - | |

마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호C(채권혼합)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | 5 | 0.09 | 6 | 0.09 | |
| 판매회사 | 10 | 0.18 | 11 | 0.17 | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| 보수 합계 | 16 | 0.28 | 18 | 0.27 | |
| 기타비용** | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | - | - | - | - |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | - |
| | 합계 | - | - | - | - |
| 증권거래세 | - | - | - | - | |

* 펀드의 순자산평가 대비 비율

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

▶ 총보수비용 비율

마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | - | 0.00 | 0.01 | 0.49 |
| 당기 | - | 0.00 | 0.01 | 0.27 |

마이더스 증권 모투자신탁(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 모투자신탁(주식)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | 0.00 | 1.48 | 0.00 | 1.48 |
| 당기 | 0.00 | 0.99 | 0.00 | 0.99 |

마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호A(채권혼합)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | 0.75 | - | 0.76 | 0.47 |
| 당기 | 0.75 | - | 0.76 | 0.27 |

마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호C(채권혼합)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | 1.10 | - | 1.10 | 0.50 |
| 당기 | 1.10 | - | 1.10 | 0.27 |

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

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 주,원,%)

| 매수 | | 매도 | | 매매회전율 | |
|------------|-----------------|-----------|-----------------|-------|--------|
| 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 3개월 | 연환산 |
| 14,287,483 | 484,465,855,754 | 6,130,699 | 172,326,175,660 | 42.97 | 176.23 |

마이더스 거북이 30 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(단위 : 주,원,%)

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

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 주,원,%)

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

※ 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 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

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : %)

| 2014-01-09 ~ 2014-04-08 | 2013-10-09 ~ 2014-01-08 | 2013-07-09 ~ 2013-10-08 |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 42.97 | 87.71 | 199.17 |