

자산운용보고서

공지사항

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

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 2스타 주가연동 증권투자신탁 LK-1호(ELS-파생형)의 자산운용사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드자산보관자(신탁업자)인 '국민은행'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 2스타 주가연동 증권투자신탁 LK-1호(ELS-파생형) | | AK412 | |
| 펀드의 종류 | 투자신탁/증권(파생형)/단위형/개방형 | 최초설정일 | 2013-08-12 |
| 운용기간 | 2014-02-12 ~ 2014-05-11 | 존속기간 | 2016-09-12 |
| 자산운용사 | 마이다스에셋자산운용 | | |
| 펀드자산보관(신탁업자) | 국민은행 | 일반사무관리회사 | SC펀드서비스 |
| 판매회사 | 국민은행 | | |
| 상품의 특징 | * 2Star 조기상환형 : 3년간 매6개월마다 조기상환 기회(만기포함 총6번) - 동 펀드는 한국전력 보통주와 LG전자 보통주의 가격변동에 연계하여 수익이 결정되는 증권투자신탁(ELS-파생형)입니다. - 매 중간평가일(매 6개월)에 각 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 95%(6개월), 90%(12개월), 85%(18개월), 85%(24개월), 80%(30개월), 70%(36개월) 이상이면 연7.6%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

▶ 재산현황

(단위 : 원, 좌/주, %)

| | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-------|-------------|-------------|--------|
| 자산 총액 | 754,280,262 | 809,516,519 | 7.32 |
| 부채 총액 | 432,371 | 12,568 | -97.09 |
| 순자산총액 | 753,847,891 | 809,503,951 | 7.38 |
| 기준가격 | 958.14 | 1,052.71 | 9.87 |

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 한국전력 보통주와 LG전자 보통주의 가격변동에 연계하여 수익이 결정되는 파생결합증권(ELS)을 편입하여 운용하며 수익구조는 다음과 같습니다.

1) 조기상환 : 매6개월(중간평가일)마다 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 95%(6개월), 90%(12개월), 85%(18개월), 85%(24개월), 80%(30개월)이상이면 연7.6%수준의 수익과 함께 조기상환

2) 조기상환되지 못하고 만기(36개월)에 이르렀을 경우

㉔ 두 기초자산 모두 최초기준가격의 70%이상인 경우 : 연 7.6%수준의 수익지급

㉕ 두 기초자산 중 하나라도 최초기준가격의 70%미만인 경우 : 만기시점에서 최초기준가격대비 하락률이 큰 기초자산의 하락률만큼 원금 손실 발생 (최대가손실률: -100%)

동 펀드의 최초기준가격은 한국전력 보통주와 LG전자 보통주가 각각 29,300원, 73,000원이었습니다.

운용보고서 작성 기준일인 2014년 5월 9일 현재 한국전력 보통주와 LG전자 보통주는 각각 41,350원, 67,400원으로 최초기준가격 대비 수익률은 각각 41.13%, -7.67%입니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

향후 만기 포함 총 5회의 조기상환 평가기회가 남아있으며, 각 시점별 조기상환조건은 다음과 같습니다.

-제2차 조기상환평가일: 2014. 08. 13, 14, 18 종가의 산술평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 90%이상

-제3차 조기상환평가일: 2015. 02. 11, 12, 13 종가의 산술평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 85%이상

-제4차 조기상환평가일: 2015. 08. 14, 17, 18 종가의 산술평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 85%이상

-제5차 조기상환평가일: 2016. 02. 15, 16, 17 종가의 산술평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 80%이상

-제6차(만기) 평가일: 2016. 08. 12, 16, 17 종가의 산술평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 70%이상

▶ 기간수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 1개월 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 | 설정일 |
|-------------------------------------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|-------|------|
| 마이더스 2스타 주가연동 증권투자신탁 LK-1호(ELS-파생형) | -0.32 | 9.87 | 15.10 | 5.27 | - | - | - | - | 5.27 |
| 비교지수 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

비교지수(Benchmark) = 없음

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

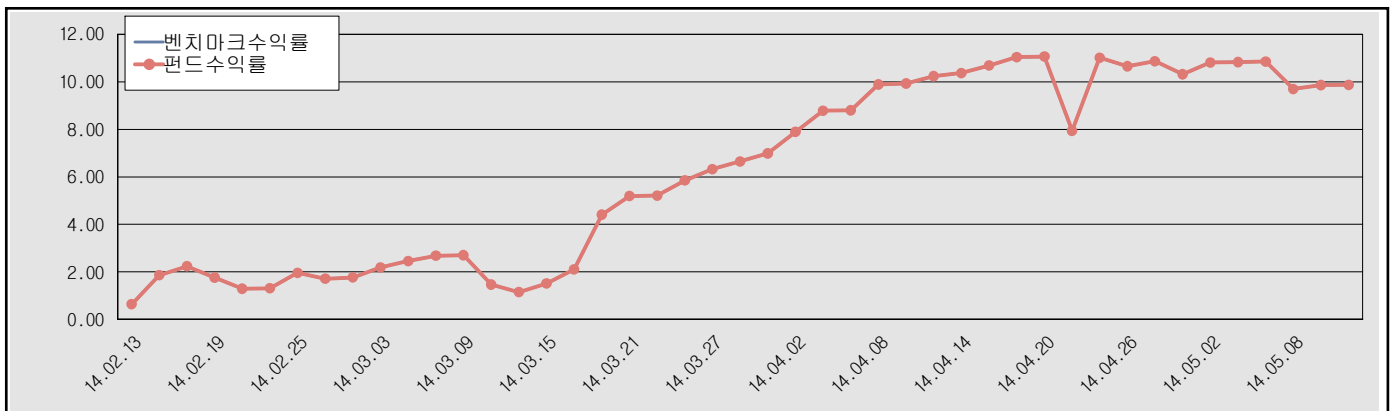
▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|-------------------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 마이더스 2스타 주가연동 증권투자신탁 LK-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(Benchmark) = 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 | 집합투자증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | - | - | - | - | - | 74 | - | - | - | 0 | 1 | 75 |
| 전기손익 | - | - | - | - | - | 35 | - | - | - | 0 | 0 | 35 |

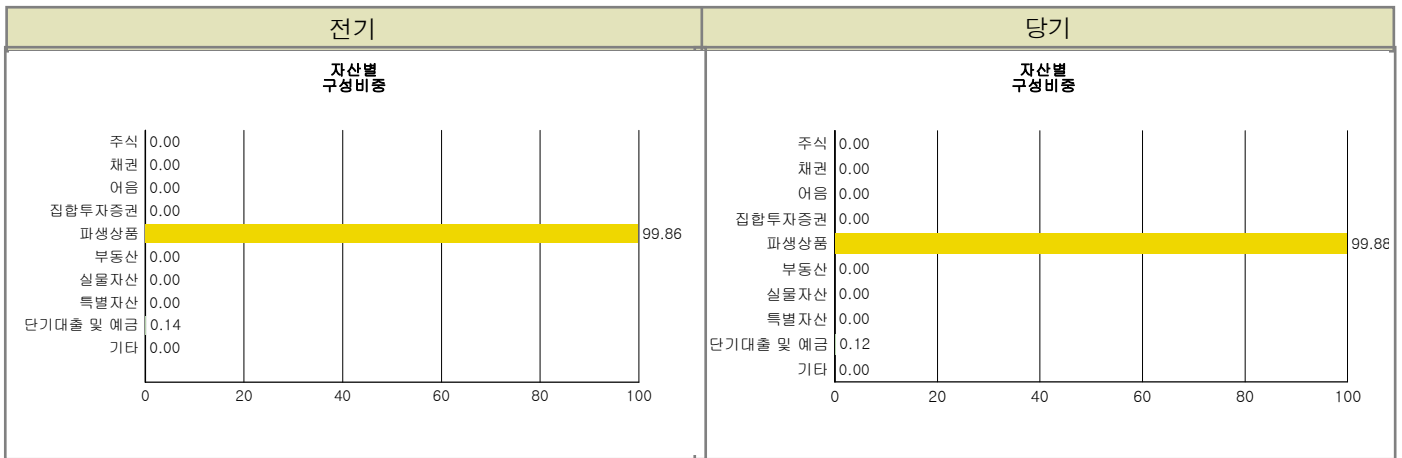
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

| 통화별 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|--------|----|----|-----------|--------|------|----------------|-----|------|----|-------------|----|-----------------|
| | 주식 | 채권 | 어음 및 기타증권 | 집합투자증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 원화 | - | - | - | - | - | 809 (99.88) | - | - | - | 1 (0.12) | - | 810 (100.00) |
| 합계 | - | - | - | - | - | 809 (99.88) | - | - | - | 1 (0.12) | - | 810 (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 한국투자(ELS)3442 | 25.61 | 2 | 파생결합증권 대신증권(ELS)3584 | 25.60 |
| 3 | 파생결합증권 신한금융(ELS)7409 | 25.35 | 4 | 파생결합증권 현대증권2013-3026ELS | 23.32 |
| 5 | 단기대출및예금 예금 | 0.12 | | | |

* 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

해당사항 없음

▶ 채권

해당사항 없음

▶ 어음

해당사항 없음

▶ 집합투자증권

해당사항 없음

▶ 장내파생상품

해당사항 없음

▶ 장외파생상품

(단위 : 원)

| 종류 | 기초자산 | 구분 | 계약금액 | 평가금액 | 비고 |
|------------------|------------|----|-------------|-------------|----|
| 거래상대방 | 만기일 | | 취득가격 | | |
| 대신증권(ELS)3584 | | 매수 | | 207,200,982 | |
| 대신증권 | 2016-08-19 | | 196,414,950 | | |
| 신한금융(ELS)7409 | | 매수 | | 205,249,946 | |
| 신한금융투자 | 2016-08-19 | | 196,414,950 | | |
| 한국투자(ELS)3442 | | 매수 | | 207,335,899 | |
| 한국투자증권 | 2016-08-19 | | 196,414,950 | | |
| 현대증권2013-3026ELS | | 매수 | | 188,744,307 | |
| 현대증권 | 2016-08-19 | | 178,829,535 | | |
| 합계 | | | | 808,531,134 | |
| | | | 768,074,385 | | |

주) 개별계약 등의 위험평가액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재
 주) 상기 "비고"란의 등급 표시는 거래상대방의 신용등급입니다.

▶ 부동산(임대)

해당사항 없음

▶ 부동산(자금대여 및 차입)

해당사항 없음

▶ 특별자산

해당사항 없음

▶ 유동성

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|----|------|----------|---------|------|-----|----|
| 예금 | 국민은행 | | 985,385 | 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 | | |
| 박정환 | | 운용역 | 54 | 263,885 | 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 | 0 | 0.05 | 0 | 0.00 | |
| 판매회사 | - | - | - | - | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| 보수 합계 | 0 | 0.06 | 0 | 0.00 | |
| 기타비용** | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | - | - | - | |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | |
| | 합계 | - | - | - | |
| 증권거래세 | - | - | - | - | |

* 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 | 0.23 | - | 0.23 | - |
| 당기 | 0.01 | - | 0.01 | - |

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

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

※ 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

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.