

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 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)의 자산운용사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드자산보관자(신탁업자)인 '하나은행'의 확인을 받아 판매회사를 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드자산보관자(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 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 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식) | | AP548 | |
| 마이다스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호C(주식) | | AQ127 | |
| 마이다스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호Ce(주식) | | AQ128 | |
| 펀드의 종류 | 투자신탁/증권(주식형)/추가형/개방형/종류형/모자형 | 최초설정일 | 2014-03-17 |
| 운용기간 | 3개월(2014-03-17 ~ 2014-06-16) | 존속기간 | 추가형 |
| 자산운용사 | 마이다스에셋자산운용 | | |
| 펀드자산보관(신탁업자) | 하나은행 | 일반사무관리회사 | SC펀드서비스 |
| 판매회사 | NH농협은행(주) 하나은행 우리은행 우리투자증권 한국외환은행 부산은행 신한은행 하나대투증권 삼성생명 삼성증권 대구은행 한화투자증권 동부증권 펀드온라인코리아 대우증권 현대증권 키움증권 유진투자증권 | | |
| 상품의 특징 | 이 투자신탁은 서민과 젊은 세대의 목돈 마련 지원을 목적으로 합니다. 룡쏏전략을 통하여 금리+α의 수익률을 추구하는 주식모펀드(마이다스거북이주식모)에 70% 이상을 투자하며, 나머지는 채권모펀드(마이다스증권채권모)에 주로 투자합니다. 주식모펀드는 헤지 펀드의 주 운용전략인 룡쏏 전략을 비롯한 다양한 전략(이벤트드리븐, 차익거래)을 활용하여 주가지수의 등락에 관계없이 안정적인 운용성과를 추구하는 동시에 채권모펀드에서는 국공채 위주의 투자를 통해 안정적인 이자 수익을 추구합니다. | | |

- ☞ 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

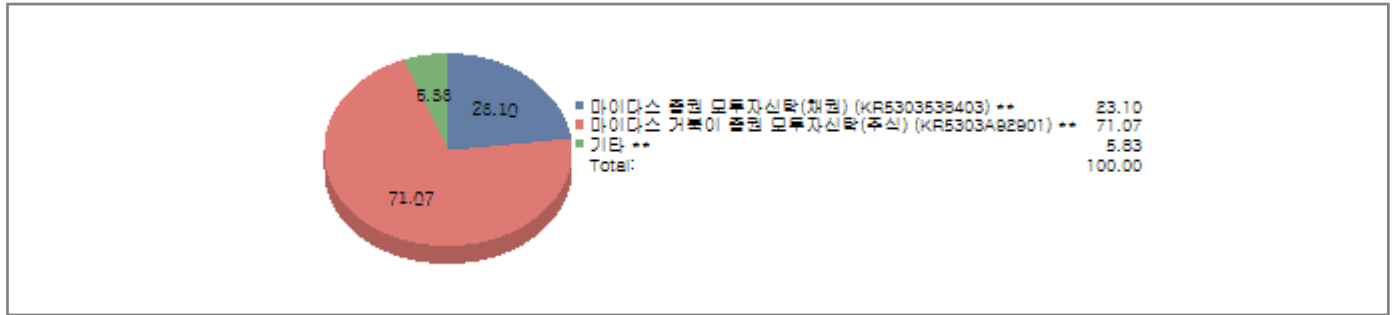
주된 투자대상



| 모펀드 | 비중 (%)* |
|---|---------|
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) (KR5303538403) ** | 0.35 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) (KR5303A92901) ** | 0.39 |



마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)



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.



| 종류형 펀드 | 종류(Class)별 비중(%)*** | A | B | C | D | E | F | H | I | P | W | J | 기타 |
|--------|------------------------|--------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|----|
| | | 100.00 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

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

▶ 재산현황

(단위 : 원, 좌/주. %)

| 마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|------------------------------------|-----|---------------|-----|
| 자산 총액 | - | 3,143,031,232 | - |
| 부채 총액 | - | 3,047,794 | - |
| 순자산총액 | - | 3,139,983,438 | - |
| 기준가격 | - | 1,001.37 | - |

(단위 : 원, 좌/주. %)

| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-------------------|-----|-----------------|-----|
| 자산 총액 | - | 206,309,425,185 | - |
| 부채 총액 | - | 301,661,194 | - |
| 순자산총액 | - | 206,007,763,991 | - |
| 기준가격 | - | 1,014.43 | - |

(단위 : 원, 좌/주. %)

| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-----------------------|-----|-----------------|-----|
| 자산 총액 | - | 611,423,331,111 | - |
| 부채 총액 | - | 39,697,952,297 | - |
| 순자산총액 | - | 571,725,378,814 | - |
| 기준가격 | - | 1,000.28 | - |

(단위 : 원. %)

| 종류(Class)별 기준가격 현황 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|---------------------------------------|-----|----------|-----|
| 마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호C (주식) | - | 998.45 | - |
| 마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호Ce (주식) | - | 1,002.12 | - |

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

거북이70소득자10e-주

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북이70소득자10-주

(단위 : 백만원, 좌)

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

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

지난 분기 펀드의 수익률은 -0.15%(Class C 기준)를 기록하였습니다. 동 기간 중, 펀더멘털 롱숏(Fundamental Long-Short) 전략, 테크니컬 롱숏(Technical Long-Short), 이벤트 차익거래(Event-driven) 전략 등의 다양한 전략을 사용했습니다. 분기 중 주식시장은 외국인 매수세 유입으로 인하여 대형주 및 경기민감주 위주의 흐름을 보였습니다. 반면, 펀드의 롱(주식) 포트폴리오에는 내수주와 중형주 비중이 높았기에 롱 주식 포트폴리오가 지수 대비 저조한 성과를 기록하면서, 롱숏전략에서 손실이 발생하였습니다. 롱(long) 포트폴리오 구성 종목 중에서는 SK하이닉스, LG디스플레이, CJ제일제당, LG화학 등이 KOSPI200 대비 양호한 주가 흐름을 보인 반면, SK이노베이션, GS건설, 대우조선해양 등은 KOSPI200 대비 저조한 흐름을 보였습니다. 또한 중소형주 중에서는 박산, 코오롱인더, 에스엘, KCC 등이 양호하였고, CJ헬로비전, 메가스터디 등이 부진하였습니다. 숏(short) 포트폴리오 구성종목 중에서는 현대엘리베이터, 락앤락, 인프라웨어 등의 주가가 하락함에 따라 펀드성과에 기여하였으나 CJ, LG전자 등은 주가상승으로 성과에 부정적인 영향을 미쳤습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

미국증시는 다우지수가 17,000pt를 넘어 신고가 행진을 이어나가고 있으나 국내 증시는 연초부터 1,900~2,050pt사이의 박스권 흐름이 지속되고 있습니다. 미국 증시는 매크로 지표호조, 기업 실적 개선 등 호재가 많으나 국내 증시는 원화강세, 이라크 정세 불안에 따른 유가 상승 및 내수침체에 따른 기업 실적 기대감 약화 등의 영향으로 지수 상단을 뚫을 수 있는 뚜렷한 호재가 없는 상황입니다. 향후에도 박스권 장세가 유지될 것으로 보입니다. 한편 원화환율 변화에 따라 외인들의 수급도 급변하고 있어 시장의 방향성을 예측하기 쉽지 않습니다. 이에 따라 3분기에는 환율 변화 및 외인수급을 면밀히 체크하여 모펀드 기준으로 5~20% 범위 내에서 적극적으로 주식 순매수포지션을 조정할 예정입니다. 또한 원화강세 기조가 이어진다면 수출주와 대형주 중심의 포트폴리오보다는 소형주, 내수주를 일정 부분 편입하는 현재의 균형 잡힌 포트폴리오가 유효할 것으로 판단됩니다. 하지만 매크로 환경이 변화한다면 주식시장의 성격이 대형주, 수출주 위주로 바뀔 수 있으므로 시장의 변화 움직임을 적극적으로 모니터링하면서 반도체, 자동차, 은행, 화학 업종 중심으로 운용방향을 선회할 계획입니다. 이와 동시에 가격대 및 밸류에이션 수준에 따른 차별적인 대응을 해나갈 계획입니다. 또한 2분기 실적 발표가 이어지는 7월 중순 이후에는 종목별로 차별화된 움직임이 예상되므로 적극적으로 종목별 비중 변화도 줄 계획입니다. 펀더멘털 롱숏 전략과 관련하여, 주식 롱 포트폴리오는 올해 연간으로 이익성장이 예상되는 업종과 수급상 과매도권에 있는 일부종목 중심으로 비중을 확대하고, 경기민감업종 중 실적이 뒷받침되지 못하는 기업들은 비중을 축소하거나 주식 숏 포트폴리오에 편입할 계획입니다. 테크니컬 롱숏 전략은 당사의 매매 신호 발생에 따라 페어트레이딩(Pair trading) 형태와 계절성을 이용한 전략으로 지속 실행해 나갈 것이며 기타 이벤트 차익거래의 경우, 시장에서 불규칙적으로 발생하는 기회들을 잘 포착하여 추가 수익으로 연결시키도록 하겠습니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 | 설정일 |
|--------------------------------------|-------|--------|--------|------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식) | 0.09 | 0.14 | - | - | - | - | - | - | 0.14 |
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 0.37 | 0.82 | 1.73 | 2.47 | 3.07 | 6.64 | 10.95 | 21.39 | 45.78 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | -0.01 | -0.17 | 1.79 | 4.25 | 8.40 | 24.42 | - | - | 27.35 |
| 마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호C(주식) | -0.01 | -0.15 | - | - | - | - | - | - | -0.15 |
| 마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호Ce(주식) | 0.02 | - | - | - | - | - | - | - | 0.21 |
| 비교지수 | 0.27 | 1.03 | - | - | - | - | - | - | 1.03 |

비교지수(Benchmark) = KOSPI 7% + 매경BP종합채권지수(국고채1~2년) 93%

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

▶ 연평균 수익률

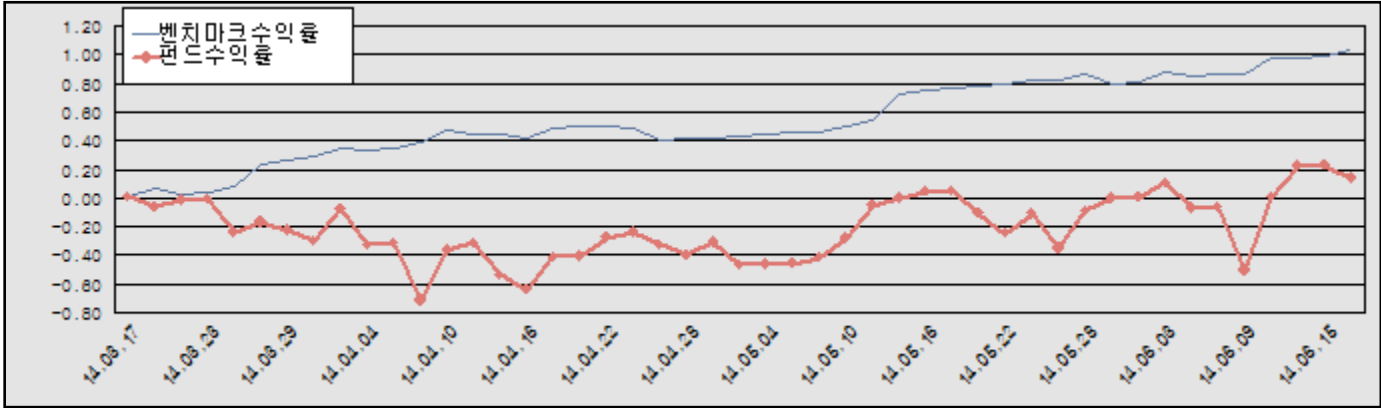
(단위 : %)

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|---------------------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 마이다스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식) | - | - | - | - |
| 마이다스 증권 모투자신탁(채권) | 3.07 | 3.27 | 3.52 | 3.95 |
| 마이다스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 8.40 | 11.55 | - | - |
| 마이다스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호C (주식) | - | - | - | - |
| 마이다스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호Ce (주식) | - | - | - | - |
| 비교지수 | - | - | - | - |

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

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

마이다스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)



비교지수(Benchmark) = KOSPI 7% + 매경BP종합채권지수(국고채1-2년) 93%

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

▶ 손익현황

마이다스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)

(단위 : 백만원)

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|------|----|----|----|---------|------|----|-----|------|----|-----------|----|------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | - | - | - | 13 | - | - | - | - | - | 0 | - | 13 |
| 전기손익 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

마이다스 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 | - | 1,714 | 65 | - | - | - | - | - | - | 28 | -3 | 1,804 |
| 전기손익 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

마이다스 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 | 12,860 | 10 | 427 | 119 | -13,799 | - | - | - | - | 348 | -1,351 | -1,386 |
| 전기손익 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(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 | - | - | - | 2,957 (94.07) | - | - | - | - | - | 186 (5.93) | - | 3,143 (100.00) |
| 합계 | - | - | - | 2,957 (94.07) | - | - | - | - | - | 186 (5.93) | - | 3,143 (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 | - | 189,528 (91.87) | - | - | - | - | - | - | - | 6,710 (3.25) | 10,071 (4.88) | 206,309 (100.00) |
| 합계 | - | 189,528 (91.87) | - | - | - | - | - | - | - | 6,710 (3.25) | 10,071 (4.88) | 206,309 (100.00) |

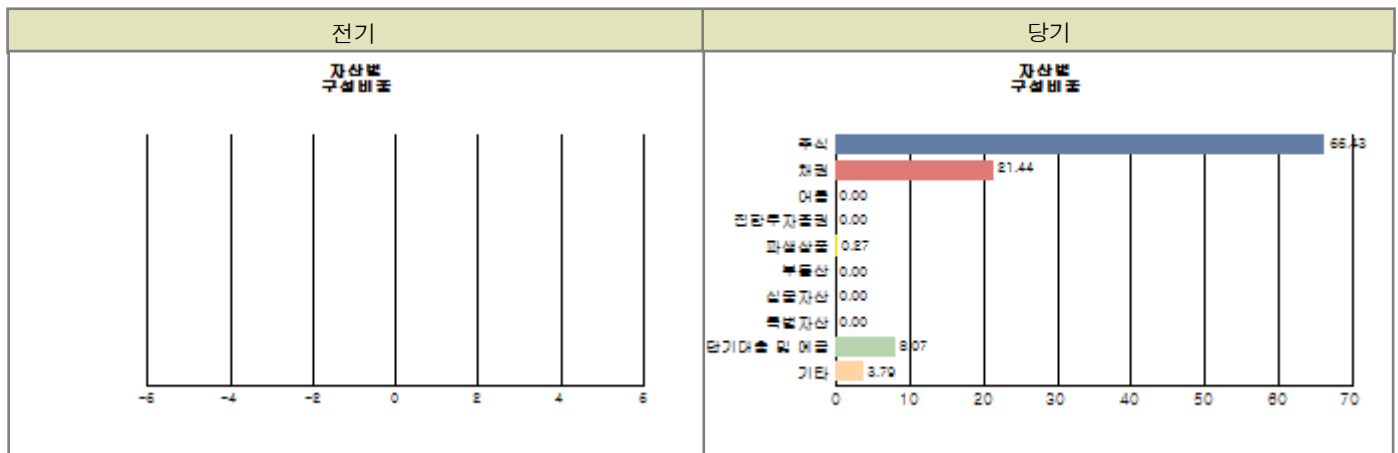
※ ()내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.

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 | 529,813 (86.65) | - | - | - | 2,184 (0.36) | - | - | - | - | 58,304 (9.54) | 21,122 (3.45) | 611,423 (100.00) |
| 합계 | 529,813 (86.65) | - | - | - | 2,184 (0.36) | - | - | - | - | 58,304 (9.54) | 21,122 (3.45) | 611,423 (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 모두자신탁(주식)

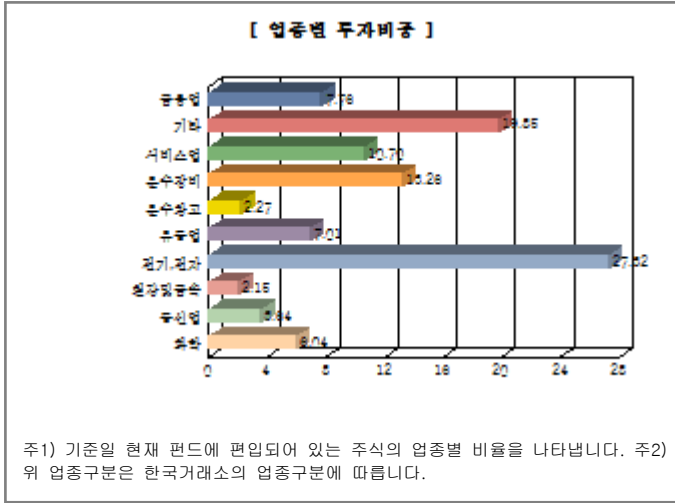
주식투자 상위 10종목

| 종 목 | 비 중(%) | 종 목 | 비 중(%) |
|--------|--------|-------|--------|
| 삼성전자 | 16.76 | 현대차 | 5.20 |
| SK하이닉스 | 5.20 | 현대모비스 | 3.61 |
| NAVER | 2.86 | 강원랜드 | 2.69 |
| 하나금융지주 | 2.63 | LG화학 | 2.29 |
| 신한지주 | 2.25 | 삼성물산 | 2.21 |

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

| 종 목 | 비 중(%) | 종 목 | 비 중(%) |
|--------|--------|------|--------|
| 전기, 전자 | 27.32 | 운수장비 | 13.26 |
| 서비스업 | 10.70 | 금융업 | 7.76 |
| 유통업 | 7.01 | 화학 | 6.04 |
| 통신업 | 3.64 | 운수장고 | 2.27 |
| 철강및금속 | 2.15 | 기타 | 19.85 |

※ 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 | 14.52 | 2 | 단기대출및예금 | 콜 1일물 2.54 | 4.73 |
| 3 | 주식 | 현대차 | 4.51 | 4 | 주식 | SK하이닉스 | 4.50 |
| 5 | 주식 | 현대모비스 | 3.13 | 6 | 주식 | NAVER | 2.48 |
| 7 | 주식 | 강원랜드 | 2.33 | 8 | 주식 | 하나금융지주 | 2.28 |
| 9 | 주식 | LG화학 | 1.99 | 10 | 주식 | 신한지주 | 1.95 |

※ 비중 : 펀드내 순자산 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : %)

| 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 종목명 | 비중 | | |
|----|-----|-------------------|-------|-----|----|--------------------|-------|
| 1 | 채권 | 국고0300-1612(13-7) | 23.93 | 2 | 채권 | 국고02750-1606(13-3) | 13.11 |
| 3 | 채권 | 예보상환기금채10-1 | 9.89 | 4 | 채권 | 예보상환기금채12-2 | 4.96 |
| 5 | 채권 | 통안0278-1410-02 | 4.88 | 6 | 채권 | 통안0290-1512-02 | 4.87 |
| 7 | 채권 | 한국철도공사105 | 4.87 | 8 | 채권 | 통안0279-1606-02 | 4.86 |
| 9 | 채권 | 기업(신)1402할1A-18 | 4.76 | 10 | 채권 | 통안0273-1407-01 | 4.39 |

※ 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 | 64,615 | 88,781,010,000 | 16.76 |
| 현대차 | 122,529 | 27,569,025,000 | 5.20 |
| SK하이닉스 | 569,271 | 27,524,252,850 | 5.20 |
| 현대모비스 | 67,134 | 19,133,190,000 | 3.61 |
| NAVER | 19,066 | 15,138,404,000 | 2.86 |

※ 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 | 463,061 | 8,682,393,750 | 1.64 | 1.48 |
| 백산 | 844,161 | 4,550,027,790 | 0.86 | 1.23 |
| 동양기전 | 319,948 | 3,129,091,440 | 0.59 | 1.01 |
| 솔루에다 | 76,756 | 2,153,005,800 | 0.41 | 1.39 |

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

▶ 채권

■ 상위 5개 종목

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 원, %)

| 종목 | 액면가액 | 평가금액 | 발행일 | 상환일 | 보증기관 | 신용등급 | 비중 |
|--------------------|----------------|----------------|------------|------------|---------|------|-------|
| 국고0300-1612(13-7) | 49,000,000,000 | 49,366,471,000 | 2013-12-10 | 2016-12-10 | 대한민국 정부 | | 26.05 |
| 국고02750-1606(13-3) | 27,000,000,000 | 27,053,865,000 | 2013-06-10 | 2016-06-10 | 대한민국 정부 | | 14.27 |
| 예보상환기금채10-1 | 20,000,000,000 | 20,395,420,000 | 2010-02-18 | 2015-02-18 | | | 10.76 |
| 예보상환기금채12-2 | 10,000,000,000 | 10,229,550,000 | 2012-01-10 | 2015-01-10 | | | 5.40 |
| 통안0278-1410-02 | 10,000,000,000 | 10,063,710,000 | 2012-10-02 | 2014-10-02 | 대한민국 정부 | | 5.31 |

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

▶ 어음

해당사항 없음

▶ 집합투자증권

■ 상위 5개 종목

마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)

(단위 : 원)

| 종목 | 종류 | 자산운용사 | 설정원본 | 순자산금액 | 취득일 | 비중 |
|-------------|------|------------|---------------|---------------|------------|------|
| 마이더스거북이주식모 | 수익증권 | 마이더스에셋자산운용 | 2,222,360,000 | 2,231,433,476 | 2014-03-18 | 0.39 |
| 마이더스증권모(채권) | 수익증권 | 마이더스에셋자산운용 | 721,000,000 | 725,224,309 | 2014-03-18 | 0.35 |

※ 비중 : 자펀드가 해당 모펀드에서 차지하는 비중

▶ 장내파생상품

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 계약, 원)

| 종목명 | 매수/매도 | 계약수 | 미결제약정금액 | 위탁증거금 |
|-----------------|-------|-------|-----------------|---------------|
| 코스피200 F 201409 | 매도 | 2,463 | 321,175,200,000 | |
| 코스피200 F 201409 | 매도 | 675 | 88,020,000,000 | |
| 합계 | | 3,138 | 409,195,200,000 | 2,184,447,500 |

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 모두자산탁(주식)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|-------------------|---------|------------|----------------|------|------------|----|
| 콜 1일물 2.54 | 미래에셋증권 | 2014-06-16 | 28,902,011,123 | 2.54 | 2014-06-17 | |
| 콜 1일물 2.53 | 동부화재 | 2014-06-16 | 11,500,797,123 | 2.53 | 2014-06-17 | |
| REPO매수 (14061643) | 서울외국환중개 | 2014-06-16 | 7,700,533,726 | 2.53 | 2014-06-17 | |
| 콜 1일물 2.33 | 신한은행 | 2014-06-16 | 6,500,414,931 | 2.33 | 2014-06-17 | |
| REPO매수 (14061642) | 서울외국환중개 | 2014-06-16 | 3,300,228,739 | 2.53 | 2014-06-17 | |

* 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|----|------|----------|-------------|------|-----|----|
| 예금 | 하나은행 | | 186,373,447 | 2.07 | | |

* 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 증권 모두자산탁(채권)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|------------|------|------------|---------------|------|------------|----|
| 콜 1일물 2.62 | 동부증권 | 2014-06-16 | 6,700,480,931 | 2.62 | 2014-06-17 | |
| 예금 | 하나은행 | | 9,507,449 | 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 | 2014-03-17 | CEO | 13 | 791,262 | 서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이더스에셋자산운용 대표이사 주요운용펀드 : 마이더스블루칩배당증권투자신탁1호(주식) | 2109000325 |
| 오중록 | 2014-03-17 | 이사 | 14 | 1,357,664 | 서울대학교 경제학과, 교보투신, 한누리투자증권, 이트레이드증권, 알리안츠생명보험 자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 채권운용본부 부장 주요운용펀드 : 마이더스 증권 모두자산탁(채권) | 2109000845 |
| 채경섭 | 2014-03-17 | 팀장 | 11 | 25,736 | BASF Company.Ltd., 신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 주식운용본부 팀장 주요운용펀드 : 마이더스신성장기업포커스증권투자신탁(주) | 2109000941 |
| 권순신 | 2014-03-17 | 과장 | 4 | 385,016 | 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

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

채경섭 : 없음

권순신 : 없음

▶ 운용전문인력 변경내역

| 기간 | 운용전문인력 |
|-----------------|--------|
| 2014-03-17 ~ 현재 | 박정환 |
| 2014-03-17 ~ 현재 | 권순신 |
| 2014-03-17 ~ 현재 | 오종록 |
| 2014-03-17 ~ 현재 | 채경섭 |
| 2014-03-17 ~ 현재 | 허필석 |

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)

(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 | |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | |
| | 합계 | - | 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** | - | - | 4 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | - | 1 | 0.00 | |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | |
| | 합계 | - | 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** | - | - | 1 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | - | 916 | 0.14 | |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | 728 | 0.11 | |
| | 합계 | - | 1,644 | 0.25 | |
| 증권거래세 | - | - | 1,177 | 0.18 | |

마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호C (주식)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | - | - | 2 | 0.11 | |
| 판매회사 | - | - | 3 | 0.18 | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | - | - | 0 | 0.01 | |
| 일반사무관리회사 | - | - | 0 | 0.01 | |
| 보수 합계 | - | - | 5 | 0.29 | |
| 기타비용** | - | - | 0 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | - | - | - | |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | |
| | 합계 | - | - | - | |
| 증권거래세 | - | - | - | - | |

마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호Cg (주식)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | - | - | 0 | 0.08 | |
| 판매회사 | - | - | 0 | 0.07 | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | - | - | 0 | 0.00 | |
| 일반사무관리회사 | - | - | 0 | 0.00 | |
| 보수 합계 | - | - | 0 | 0.16 | |
| 기타비용** | - | - | - | - | |
| 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 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | - | - | - | - |
| 당기 | - | 0.00 | 0.00 | 0.77 |

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - |
| 당기 | 0.00 | 1.00 | 0.00 | 1.00 |

마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호C (주식)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | - | - | - | - |
| 당기 | 1.16 | - | 1.16 | 0.77 |

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | - | - | - | - |
| 당기 | 0.80 | - | 0.81 | 0.86 |

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 |
| 11,288,142 | 397,266,688,610 | 9,426,651 | 329,401,858,070 | 59.34 | 238.03 |

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 주,원,%)

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

마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)

(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 : %)

| 2014-03-17 ~ 2014-06-16 | 2014-03-16 ~ 2014-03-16 | 2014-03-16 ~ 2014-03-15 |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 59.34 | - | - |