

MIDAS ASSET

마이다스에셋자산운용

자산운용보고서

마이다스 거북이 40 나눔 증권 자투자신탁

운용기간 2014.05.15 ~ 2014.08.14

Midas International Asset Management Ltd.

www.midasasset.com

이 자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월, 단, MMF는 1개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다. 이 자산운용보고서의 내용은 고객님의 가입하신 펀드 전체에 관한 내용으로, 고객님의 개인별 수익률 정보 확인 및 변경사항은 가입하신 판매회사를 통하여 확인하시기 바랍니다.

공지사항

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

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 거북이 40 나뉨 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 : 3등급

펀드명칭		금융투자협회 펀드코드	
마이다스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)		AQ654	
마이다스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호A(채권혼합)		AQ655	
마이다스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호C(채권혼합)		AQ656	
마이다스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호Ae(채권혼합)		AS489	
마이다스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호Ce(채권혼합)		AS501	
펀드의 종류	투자신탁/증권(혼합채권)/추가형/개방형/종류형/모자형	최초설정일	2014-05-15
운용기간	3개월(2014-05-15 ~ 2014-08-14)	존속기간	추가형
자산운용사	마이다스에셋자산운용		
펀드자산보관(신탁업자)	하나은행	일반사무관리회사	SC은행 펀드서비스부
판매회사	국민은행		
상품의 특징	롱숏전략을 통하여 금리+ α 의 수익률을 추구하는 주식모펀드(마이다스 거북이 주식모)에 40% 이상을 투자하며, 나머지는 채권모펀드(마이다스증권채권모)에 주로 투자합니다. 주식모펀드는 헤지 펀드의 주 운용전략인 롱숏 전략을 비롯한 다양한 전략(Event Driven, 차익거래)을 활용, 주가지수의 등락에 관계없이 안정적인 운용성과를 추구하며, 채권모펀드는 국공채 위주의 투자를 통한 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

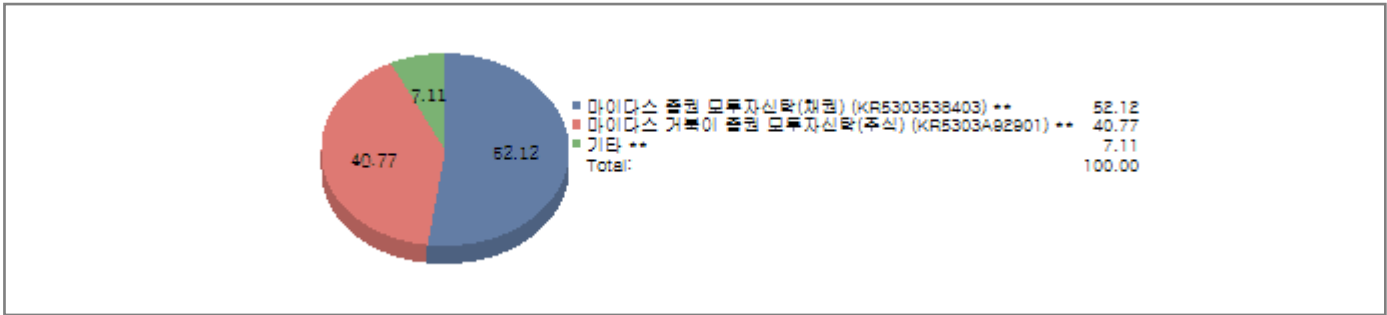
주된 투자대상

실제투자

모펀드	비중 (%)*
마이더스 증권 모투자신탁(채권) (KR5303538403) **	0.03
마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) (KR5303A92901) **	0.01

수익증권 매입

마이더스 거북이 40 나눈 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(%)***	8.93	-	91.07	-	-	-	-	-	-	-	-

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

▶ 자산현황

(단위 : 원, 좌/주. %)

마이더스 거북이 40 나눈 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)	전기말	당기말	증감률
자산 총액	-	104,979,102	-
부채 총액	-	405	-
순자산총액	-	104,978,697	-
기준가격	-	1,009.67	-

(단위 : 원, 좌/주. %)

마이더스 증권 모투자신탁(채권)	전기말	당기말	증감률
자산 총액	-	182,991,568,471	-
부채 총액	-	1,052,543,564	-
순자산총액	-	181,939,024,907	-
기준가격	-	1,021.55	-

(단위 : 원, 좌/주. %)

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)	전기말	당기말	증감률
자산 총액	-	456,946,346,587	-
부채 총액	-	35,401,945,585	-
순자산총액	-	421,544,401,002	-
기준가격	-	1,007.75	-

(단위 : 원. %)

종류(Class)별 기준가격 현황	전기말	당기말	증감률
마이더스 거북이 40 나눈 증권 자투자신탁 1호A(채권혼합)	-	1,007.45	-
마이더스 거북이 40 나눈 증권 자투자신탁 1호C(채권혼합)	-	1,006.44	-
마이더스 거북이 40 나눈 증권 자투자신탁 1호Ae(채권혼합)	-	1,009.85	-
마이더스 거북이 40 나눈 증권 자투자신탁 1호Ce(채권혼합)	-	1,008.82	-

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

거북이40나눔자1Ae채

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북이40나눔자1A채혼

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북이40나눔자1Ce채

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북이40나눔자1C채혼

(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 0.74%(클래스 A 기준)로, 비교지수대비 0.46%포인트 저조한 수익률을 기록하였습니다. 지난 분기에 지수는 1,960~2,080포인트 사이의 흐름을 보였으나 분기 말로 갈수록 2,050선 이상에서 꾸준히 머무는 모습이었습니다. 이에 따라 주식 순매수 포지션을 평균 16.94%로 높게 가져갔으며 특히 분기말로 갈수록 19% 이상으로 높게 가져갔습니다. 또한 베이스스 및 지수 움직임에 따라 주식 순매수 포지션을 10 내지 20% 사이에서 탄력적으로 운용했습니다. 지수가 분기초 대비 2.61% 상승하여 주식 순매수 포지션을 15% 이상으로 열어둔 것은 성과에 긍정적이었습니다. 현재 롭포트폴리오의 주력업종은 전기전자, 자동차, 유통, 금융, 통신서비스 업종입니다. 특히 내수 부양 정책에 따라 은행, 보험 업종의 주가 상승이 이어져 비중을 확대했다 차익실현하면서 다시 비중을 축소했으며, APPI 상승 및 마케팅비용 절감에 따른 수익성개선 기대가 있는 통신서비스 업종의 비중 및 낙폭이 과대했던 화학업종의 비중은 확대했습니다. 하지만 해외 주주 모멘텀이 떨어지고 있는 기계 및 조선 업종의 비중은 축소했습니다. 은행, 보험, 통신업종은 해당 업종의 주가 상승으로 긍정적인 영향을 미쳤으나, 화학업종은 비중을 확대했음에도 주가가 하락하여 부정적인 영향을 미쳤습니다. 대형주중에서는 SK하이닉스, SK탈레콤, LG전자, 현대모비스, NAVER 등을 매수했으며 삼성전자, 현대제철 등을 매도했습니다. 중소형주 중에서는 아이마켓코리아, GS홈쇼핑 등을 매수했으며 박산, 현대해상, 힐라코리아 등을 매도했습니다. 그 중, 성과우수종목은 아모레퍼시픽, 호텔신라, 롯데칠성, 현대하이스코 등이며 성과부진 종목은 한진중공업, OCI, 삼성전기 등입니다. 전분기는 개별 주식 차입매도 비중을 전분기 6.22%에서 4.45%로 줄였습니다. 이는 지수의 지속적인 상승에 따라 차익 실현 및 추가 포지션을 확대하지 않았기 때문입니다. 지수가 고점이라 판단할 시 다시 매도 포지션을 다시 확대할 계획입니다. 주식매도(short)포지션에서는 철강, 기계, 소프트웨어 업종의 비중이 큰 편입니다. 전분기 숏포지션에서는 GS, 락앤락, 스카이라이프, 등 종목의 주가가 하락하면서 펀드성과가 기여했으나 LG전자, 현대엘리베이터, LG전자 등은 주가상승으로 인해 전체 펀드 성과에 부정적인 영향을 미쳤습니다. 테크니컬 롭숏 전략의 일환으로 시즈널리티 전략(강원랜드, 빅센타이어, 삼성정밀화학 등)을 사용하여 이익이 발생했으며 에스원, 한화케미칼 등 종목에서는 손실이 발생했습니다. IPO 참여종목은 쿠쿠전자였으며 현재 이익상태로 보유 중입니다. 블록딜에 참여한 종목은 기업은행, LG유플러스, 파라다이스 등이며 기업은행, LG유플러스에서 이익이 발생했고, 파라다이스는 일부 이익실현했으나 일부는 손실 중입니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

지난 분기 글로벌 증시는 아르헨티나 디폴트 선언, 포르투갈 BES 유동성위기, 미국의 조기 금리인상 시사, 러시아 제재 강화, 중동 가자지구 공습 등의 이벤트로 인해 최근 지속적으로 상승했던 미국, 유럽 증시의 조정을 이끌어 내는 모습이었습니다. 국내 증시는 최경환 경제부총리 취임 이후 배당소득세율 인하, 대기업 유보현금 과세, LTV와 DTI 규제완화 등 내수 경기 부양을 위한 정책들이 구체적으로 쏟아져 나오면서 글로벌 증시 흐름과 무관하게 증시 상승의 흐름이 이어졌습니다. 특히 지수상승의 흐름이 전체적으로 이루어지기보다는 은행, 보험, 증권, 건설, 화학, 자동차 및 고배당주 중심으로 선별적으로 상승한 모습이었으며, 삼성전자를 비롯한 핸드폰 관련 기업의 '어닝쇼크'가 이어졌던 것이 특이한 점이었습니다. 하지만 연초부터 1,900~2,050포인트 사이의 박스권 흐름이 레벨업되어 2,050~2,100포인트의 새로운 박스권을 형성하고 있으며 내수 경기회복 기대감 등으로 증시 추가 상승에 대한 기대감은 있으나, 엔화의 약세가 심화되는 것에 대한 우려감이 더해지고 있습니다. 이에 따라 외인들의 수급 변화에 대해 적극적인 모니터링이 필요한 시기가 판단합니다. 3분기에는 환율 변화 및 외인수급을 면밀히 체크하여 모펀드 기준으로 5~20% 범위내에서 적극적으로 주식 순매수 포지션을 조절할 예정입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년	설정일
마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)	-0.22	0.97	-	-	-	-	-	-	0.97
마이더스 증권 모투자신탁(채권)	0.33	1.10	1.81	2.74	3.54	6.38	10.89	21.64	46.80
마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)	-1.07	0.80	1.42	3.12	6.03	25.12	-	-	28.30
마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호A(채권혼합)	-0.29	0.74	-	-	-	-	-	-	0.74
마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호C(채권혼합)	-0.32	0.64	-	-	-	-	-	-	0.64
마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호Ae(채권혼합)	-0.27	-	-	-	-	-	-	-	0.98
마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호Ce(채권혼합)	-0.29	-	-	-	-	-	-	-	0.88
비교지수	0.51	1.21	-	-	-	-	-	-	1.21

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

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

▶ 연평균 수익률

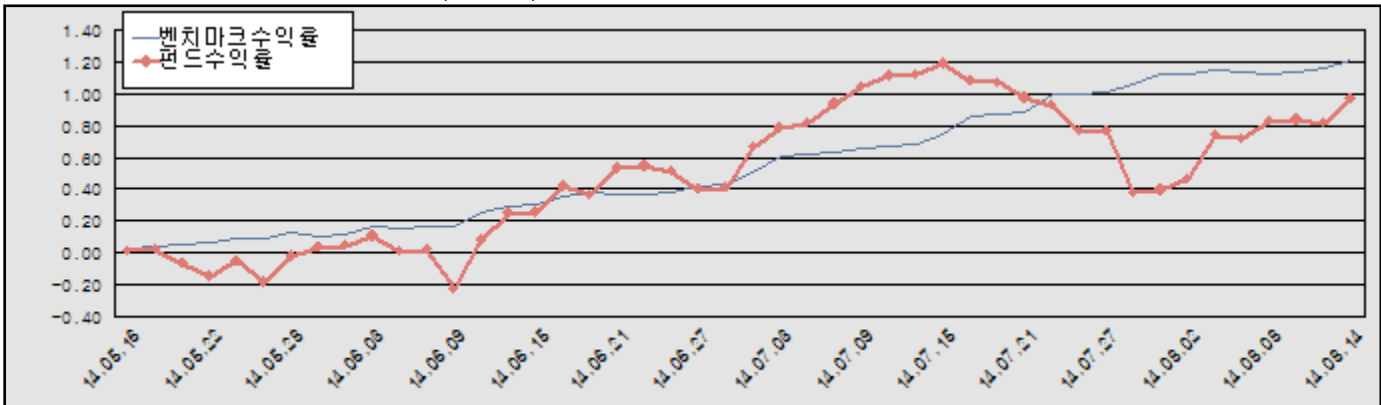
(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)	-	-	-	-
마이더스 증권 모투자신탁(채권)	3.54	3.14	3.51	4.00
마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)	6.03	11.86	-	-
마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호A(채권혼합)	-	-	-	-
마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호C(채권혼합)	-	-	-	-
마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호Ae(채권혼합)	-	-	-	-
마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호Ce(채권혼합)	-	-	-	-
비교지수	-	-	-	-

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

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

마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)



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

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

▶ 손익현황

마이더스 거북이 40 나뉨 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	-	-	-	1	-	-	-	-	-	0	0	1
전기손익	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

마이더스 증권 모두자신탁(채권)

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	-	2,084	72	13	-	-	-	-	-	11	-2	2,178
전기손익	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

마이더스 거북이 증권 모두자신탁(주식)

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	7,713	-	216	0	-2,041	-	-	-	-	226	-1,918	4,196
전기손익	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

마이더스 거북이 40 나뉨 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	-	-	-	98 (92.88)	-	-	-	-	-	7 (7.12)	-	105 (100.00)
합계	-	-	-	98 (92.88)	-	-	-	-	-	7 (7.12)	-	105 (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	-	167,228 (91.39)	-	3,023 (1.65)	-	-	-	-	-	12,741 (6.96)	-	182,992 (100.00)
합계	-	167,228 (91.39)	-	3,023 (1.65)	-	-	-	-	-	12,741 (6.96)	-	182,992 (100.00)

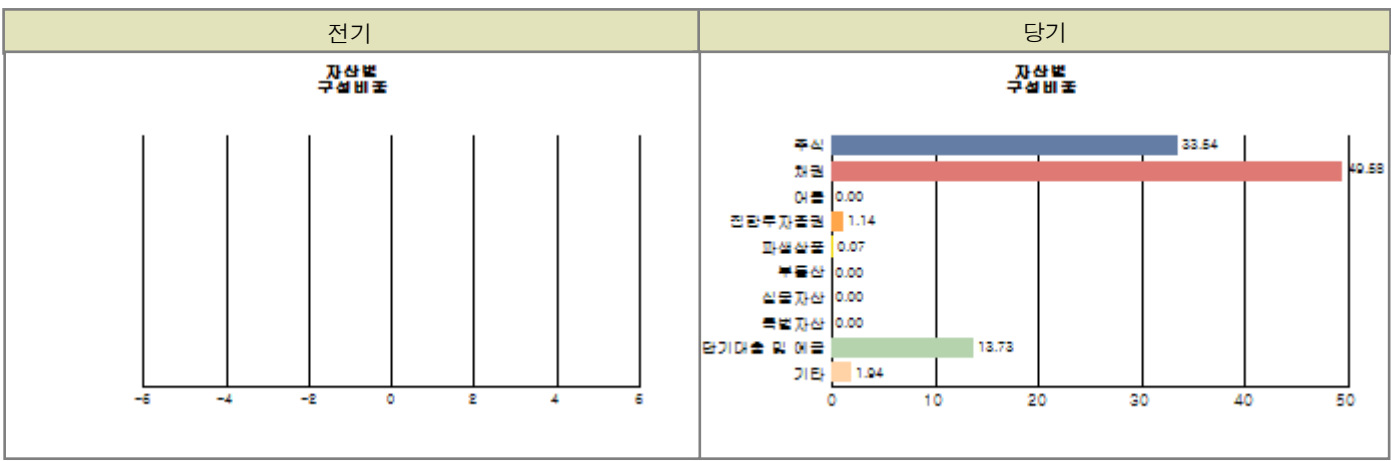
※ ()내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.

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	335,031 (73.32)	-	-	2,445 (0.54)	650 (0.14)	-	-	-	-	99,390 (21.75)	19,430 (4.25)	456,946 (100.00)
합계	335,031 (73.32)	-	-	2,445 (0.54)	650 (0.14)	-	-	-	-	99,390 (21.75)	19,430 (4.25)	456,946 (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	14.22	SK하이닉스	5.00
현대차	4.10	NAVER	3.80
LG화학	2.51	신한지주	2.44
LG전자	2.36	기아차	2.17
SK텔레콤	2.14	서부T&D	2.01

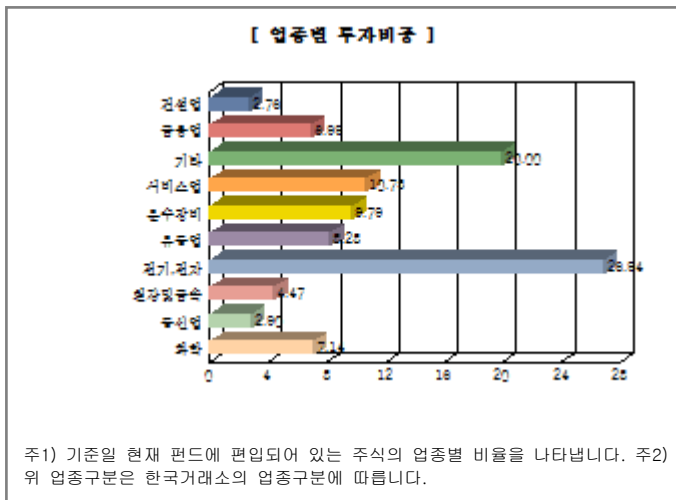
※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

업종별 투자비중

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
전기, 전자	26.94	서비스업	10.73
운수장비	9.79	유통업	8.28
화학	7.14	금융업	6.99
철강및금속	4.47	통신업	2.90
건설업	2.76	기타	20.00

※ 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	2	단기대출및예금	콜 4일물 2.29
3	단기대출및예금	콜 4일물 2.21	4	주식	SK하이닉스
5	단기대출및예금	REPO매수 (14081407)	6	주식	현대차
7	단기대출및예금	REPO매수 (14081429)	8	주식	NAVER
9	주식	LG화학	10	단기대출및예금	REPO매수 (14081426)

※ 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)	2	채권	예보상환기금채10-1
3	채권	국고03250-1809(13-5)	4	단기대출및예금	REPO매수 (14081417)
5	채권	토지주택채권248	6	채권	통안0290-1512-02
7	채권	한국철도공사105	8	채권	예보기금특별채2012-2
9	채권	통안0284-1412-02	10	채권	기업(신)1402할1A-18

※ 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	37,770	47,627,970,000	14.22
SK하이닉스	384,542	16,746,804,100	5.00
현대차	59,670	13,724,100,000	4.10
NAVER	16,055	12,747,670,000	3.80
LG화학	30,949	8,418,128,000	2.51

※ 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 ※※
한진해운홀딩스	150,000	1,470,000,000	0.44	1.15

※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)	46,000,000,000	46,753,894,000	2013-12-10	2016-12-10	대한민국 정부		27.96
예보상환기금채10-1	20,000,000,000	20,509,220,000	2010-02-18	2015-02-18			12.26
국고03250-1809(13-5)	13,000,000,000	13,451,425,000	2013-09-10	2018-09-10	대한민국 정부		8.04
토지주택채권248	10,000,000,000	10,205,810,000	2013-12-13	2016-12-13		AAA	6.10
통안0290-1512-02	10,000,000,000	10,122,640,000	2013-12-02	2015-12-02	대한민국 정부		6.05

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

▶ 어음

해당사항 없음

▶ 집합투자증권

■ 상위 5개 종목

마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(단위 : 원)

종 목	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	취득일	비 중
마이더스증권외(채권)	수익증권	마이더스에셋자산운용	54,291,857	54,709,979	2014-05-16	0.03
마이더스거북이주식모	수익증권	마이더스에셋자산운용	42,566,962	42,795,138	2014-05-16	0.01

※ 비중 : 자펀드가 해당 모펀드에서 차지하는 비중

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 원)

종 목	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	취득일	비 중
KODEX 레버리지	수익증권	마이더스에셋자산운용	2,425,423,000	2,445,000,000	2014-08-13	100.00

※ 비중 : 보유한 전체 집합투자증권 중 해당 수익증권이 차지하는 비중

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 원)

종 목	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	취득일	비 중
KStar 단기통안채		마이더스에셋자산운용	3,009,286,350	3,022,500,000	2014-06-26	100.00

※ 비중 : 보유한 전체 집합투자증권 중 해당 수익증권이 차지하는 비중

▶ 장내파생상품

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 계약, 원)

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
코스피200 F 201409	매도	963	128,560,500,000	
코스피200 F 201409	매도	437	58,339,500,000	
코스피200 F 201409	매도	300	40,050,000,000	
합계		1,700	226,950,000,000	412,296,550

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 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
예금	하나은행		7,473,985	2.07		

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
콜 4일물 2.29	미래에셋증권	2014-08-14	36,802,397,142	2.29	2014-08-18	
콜 4일물 2.21	NH농협은행	2014-08-14	20,001,258,958	2.21	2014-08-18	
REPO매수(14081407)	한국자금융개	2014-08-14	14,300,901,096	2.30	2014-08-18	
REPO매수(14081429)	서울외국환중개	2014-08-14	13,300,838,082	2.30	2014-08-18	
REPO매수(14081426)	한국자금융개	2014-08-14	8,400,529,315	2.30	2014-08-18	

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
REPO매수(14081417)	한국자금중개	2014-08-14	10,800,680,548	2.30	2014-08-18	
REPO매수(14081423)	한국자금중개	2014-08-14	1,900,119,726	2.30	2014-08-18	
예금	하나은행		40,167,367	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	2014-05-15	대표이사	11	566,710	서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이더스에셋자산운용 대표이사 주요운용펀드 : 마이더스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	2109000325
오종록	2014-05-15	이사	13	665,718	서울대학교 경제학과, 교보투신, 한누리투자증권, 이트레이드증권, 알리안츠생명보험 자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 채권운용파트 이사 주요운용펀드 : 마이더스 증권 모투자신탁(채권)	2109000845
채경섭	2014-05-15	팀장	8	510,643	BASF Company.Ltd., 신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 주식운용파트 팀장 주요운용펀드 : 마이더스신성장기업포커스증권투자신탁(주)	2109000941
권순신	2014-05-15	과장	11	536,280	서울대학교 재료공학부, 메트라이프, 알리안츠, 現 마이더스에셋자산운용 채권운용파트 과장	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
2014-05-15 ~ 현재	권순신
2014-05-15 ~ 현재	오종록
2014-05-15 ~ 현재	채경섭
2014-05-15 ~ 현재	허필석

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

마이더스 거북이 40 나승 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	-	-	-	
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	
	합계	-	-	-	
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	-	-	-	-	
판매회사	-	-	-	-	
펀드재산보관(신탁업자)	-	-	-	-	
일반사무관리회사	-	-	-	-	
보수 합계	-	-	-	-	
기타비용**	-	-	3	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**	-	-	0	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	1,030	0.19	
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	827	0.16	
	합계	-	1,857	0.35	
증권거래세	-	-	1,825	0.34	

마이더스 거북이 40 나승 증권 자투자신탁 1호A(채권혼합)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	-	-	0	0.11	
판매회사	-	-	0	0.11	
펀드재산보관(신탁업자)	-	-	0	0.00	
일반사무관리회사	-	-	0	0.00	
보수 합계	-	-	0	0.22	
기타비용**	-	-	-	-	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	
	합계	-	-	-	
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호C(채권혼합)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	-	-	0	0.11	
판매회사	-	-	0	0.21	
펀드재산보관(신탁업자)	-	-	0	0.00	
일반사무관리회사	-	-	0	0.00	
보수 합계	-	-	0	0.32	
기타비용**	-	-	-	-	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	
	합계	-	-	-	
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호Ae(채권혼합)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	-	-	0	0.08	
판매회사	-	-	0	0.04	
펀드재산보관(신탁업자)	-	-	0	0.00	
일반사무관리회사	-	-	0	0.00	
보수 합계	-	-	0	0.13	
기타비용**	-	-	-	-	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	
	합계	-	-	-	
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호Ce(채권혼합)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	-	-	0	0.09	
판매회사	-	-	0	0.09	
펀드재산보관(신탁업자)	-	-	0	0.00	
일반사무관리회사	-	-	0	0.00	
보수 합계	-	-	0	0.18	
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 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	-	-	-	-
당기	-	-	0.00	0.61

마이더스 증권 모두자신탁(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	1.39	0.00	1.39

마이더스 거북이 40 나능 증권 자투자신탁 1호A(채권혼합)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	-	-	-	-
당기	0.87	-	0.88	0.58

마이더스 거북이 40 나능 증권 자투자신탁 1호C(채권혼합)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	-	-	-	-
당기	1.28	-	1.28	0.62

마이더스 거북이 40 나능 증권 자투자신탁 1호Ae(채권혼합)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	-	-	-	-
당기	0.59	-	0.59	0.65

마이더스 거북이 40 나능 증권 자투자신탁 1호Ce(채권혼합)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	-	-	-	-
당기	0.85	-	0.86	0.62

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균(보수,비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수,비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매/중개수수료 비율이란 매매/중개수수료를 순자산 연평균액(보수,비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매/중개수수료의 수준을 나타냅니다.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전율

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 주,원,%)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	3개월	연환산
8,446,016	296,825,124,845	14,256,308	550,236,725,920	115.14	461.83

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 주,원,%)

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

마이더스 거북이 40 나능 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)

(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 : %)

2014-05-15 ~ 2014-08-14	2014-05-14 ~ 2014-05-14	2014-05-14 ~ 2014-05-13
115.14	1.17	-