

MIDAS ASSET

마이다스에셋자산운용

자산운용보고서

마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)

운용기간 2014.07.02 ~ 2014.10.01

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 90 증권 자투자신탁 1호(주식)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 : 1등급

펀드명칭		금융투자협회 펀드코드	
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)		AL420	
마이다스 거북이 90증권 자투자신탁 1호A(주식)		AL421	
마이다스 거북이 90증권 자투자신탁 1호Ae(주식)		AL426	
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C1(주식)		AL422	
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)		AL427	
마이다스 거북이90 증권 자투자신탁 1호C-W(주식)		AN413	
펀드의 종류	투자신탁/증권(주식형)/추가형/개방형/종류형/모자형	최초설정일	2013-10-02
운용기간	3개월(2014-07-02 ~ 2014-10-01)	존속기간	추가형
자산운용사	마이다스에셋자산운용		
펀드자산보관(신탁업자)	하나은행	일반사무관리회사	SC은행 펀드서비스부
판매회사	하나은행 삼성증권 한국씨티은행 삼성생명 우리투자증권 한화투자증권 한국투자증권 신한금융투자 하나대투증권 신영증권 대우증권 대신증권 키움증권 한국외환은행 현대증권 교보증권 동부증권 KB투자증권		
상품의 특징	본 상품은 혼합형 펀드로서 주식에 80%이상, 채권 등에 20% 이하를 투자하고 있습니다. KOSPI등락률9%+매경BP 종합채권지수 1~2년물 수익률 91%를 벤치마크로 하여 벤치마크대비 초과성적을 목표로 하고 있습니다. 따라서 수익자는 주식형 펀드와 비교하여 상대적으로 안정된 수익을 기대할 수 있는 상품입니다. 롱숏 전략 등 다양한 절대수익 추구전략을 복합적으로 활용하여 투자위험을 축소하고, 국내 주식 매매차익에 대한 비과세로 주식투자부분에 대해 절세효과를 기대할 수 있습니다. 본 상품은 자산의 70%~80%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) **	8.39
마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) (KR5303A92901) **	70.48

수익증권 매입

마이더스 거북이 90 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.

수익증권 매입

종류형 펀드	종류(Class)별	A	B	C	D	E	F	H	I	P	W	J	S	S-P	기타
	비중(%)***	62.76	-	36.56	-	-	-	-	-	-	0.68	-	-	-	-

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

▶ 재산현황

(단위 : 원, 좌/주. %)

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)	전기말	당기말	증감률
자산 총액	417,496,939,895	260,811,536,490	-37.53
부채 총액	2,202,177,330	802,039,205	-63.58
순자산총액	415,294,762,565	260,009,497,285	-37.39
기준가격	1,045.13	1,061.44	1.56

(단위 : 원, 좌/주. %)

마이더스 증권 모투자신탁(채권)	전기말	당기말	증감률
자산 총액	196,292,083,183	184,102,710,790	-6.21
부채 총액	2,190,164	10,643,844,921	485,883.92
순자산총액	196,289,893,019	173,458,865,869	-11.63
기준가격	1,016.13	1,029.31	1.30

(단위 : 원, 좌/주. %)

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)	전기말	당기말	증감률
자산 총액	558,267,121,963	357,479,445,472	-35.97
부채 총액	41,887,464,048	19,064,447,577	-54.49
순자산총액	516,379,657,915	338,414,997,895	-34.46
기준가격	1,008.65	1,024.66	1.59

(단위 : 원. %)

종류(Class)별 기준가격 현황	전기말	당기말	증감률
마이더스 거북이 90증권 자투자신탁 1호A(주식)	1,034.20	1,046.66	1.20
마이더스 거북이 90증권 자투자신탁 1호Ae(주식)	1,026.10	1,039.39	1.30
마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C1(주식)	1,028.23	1,038.59	1.01
마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)	1,020.99	1,033.88	1.26
마이더스 거북이90 증권 자투자신탁 1호C-W(주식)	1,023.95	1,038.14	1.39

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.

주) 위 당기말 기준가격은 결산부기준가격이며, 재투자기준가격은 클래스 A(1000.00) 클래스 Ae(1000.00) 입니다.

※ 분배금내역

거북90증권자1A(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

분배금 기준일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
2014-10-01	0	153,376,420,768	1,046.66	1,000.00	

거북90증권자1Ae(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

분배금 기준일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
2014-10-01	0	2,009,591,748	1,039.39	1,000.00	

거북90증권자1C1(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

분배금 기준일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
2014-10-01	0	78,661,560,506	1,038.59	1,000.00	

거북90증권자1Ce(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

분배금 기준일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
2014-10-01	0	12,449,860,354	1,033.88	1,000.00	

거북90증권자1CW(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

분배금 기준일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
2014-10-01	0	1,702,577,583	1,038.14	1,000.00	

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

펀드의 분기 수익률은 1.20%(클래스 A 기준)로, 참고지표 대비 0.01%포인트의 초과성적을 기록하였습니다. 분기초 지수가 급등기에 집중적으로 올랐던 업종(은행, 건설, 증권등)으로 시장분위기에 휩쓸려 포트폴리오를 조정하지 않아 일시적으로 수익률은 저조했던 이후 시장이 다시 제자리로 돌아오는 과정에서 기존의 포트폴리오를 통해 손실분 이상의 이익이 났으며, 이후 조정기에 수익을 방어해 함으로써 펀드가 참고지표 대비 우수한 성과를 기록하였습니다.

현재 시장대비 편입비중이 높은 업종은 유통, 유틸리티, 음식료, 통신서비스, 섬유 의복 등입니다. 엔화약세 심화 및 3분기 실적 저조에 대한 우려로 인하여 대형-수출주의 비중은 낮춘 반면, 정책 효과에 대한 기대로 내수 중심의 업종 비중을 높였습니다. 다행히 비중을 확대했던 유통, 유틸리티, 음식료, 통신서비스, 섬유 의복 업종의 주가가 상승함에 따라 펀드 성과에 긍정적으로 작용하였습니다. 반면, 전기전자, 운수장비, 화학 업종은 시장비중보다 비중을 낮게 가져가고는 있지만, 절대 비중이 높아 주가 하락에 따라 전체 펀드 성과에 소폭 부정적으로 작용하였습니다. 신규로 매수한 종목은 KT&G, 롯데칠성, 신세계인터내셔널 등의 종목 등입니다. KT&G는 연말 배당기대감이 및 시장 조정기에 주가 방어에 긍정적인 측면이 반영되었으며, 롯데칠성은 자산가치 및 '클라우드' 맥주의 초기 급격한 시장비중 확대, 신세계인터내셔널은 신세계 그룹 내에서의 사업영역 조정에 따른 확실한 사업모델 구축에 따른 턴어라운드 기대감으로 신규로 매수했습니다. 반면, 3분기 모바일 사업의 침체로 3분기 실적악화가 예상되었던 삼성전자의 비중은 크게 줄었으며, 그룹내 지배구조 이슈로 실적 악화 및 불확실성이 높아진 KB금융 종목은 편입 목록에서 제외하였습니다. 롯데칠성, 신세계인터내셔널은 주가 상승으로, 삼성전자 및 KB금융은 주가하락으로 펀드성과에 긍정적이었으며, KT&G는 주가 변화가 거의 없어 펀드성과에 중립적이었습니다.

해당분기동안 오픈포지션(모펀드 기준)은 주로 현-선물간 베이스에 따라 13%~20% 사이에서 탄력적으로 운용했으며, 지수상승기에는 17% 이상 높게, 지수 조정기나 변동성 상승기에 포지션을 15%이하로 가져가며 포지션 조정을 했습니다. 이에 따라 선물헤지 포지션이 전체 성과에 기여한 부분은 0.68%(모펀드 기준) 정도 긍정적인 운용성과가 나왔습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

엘런 美 연방준비제도이사회 의장이 미국 금리의 조기 인상에 대한 우려를 불식시키며 분기 초반, 달러의 강세가 이어졌습니다. 그에 따라 '엔저' 현상이 지속되었으며 이는 일본 기업과 수출 시장에서 경쟁해야 하는 국내 기업들에게 부정적으로 작용하였습니다. 이러한 흐름은 다소간 이어질 것으로 판단되며, 중동의 지정학적 리스크 및 유로존의 러시아 제재강화에 따른 유로존의 경기둔화 흐름역시 4분기 글로벌 증시에 큰 영향을 줄 요소로 판단되며, 국내증시에도 일정부분 부정적인 영향을 줄 것으로 판단합니다. 신임 경제부총리를 필두로 한 정부의 경기 부양 의지가 확인됨에 따라 지난 분기 초 종합주가지수는 2,100포인트를 바라봤습니다. 그러나 앞서 언급드렸던 환리스크로 인해 외국인 매도세가 10영업일 이상 계속되면서 센터먼트가 악화되었고, 여전히 외국인의 매도세는 지속되고 있습니다. 이에 따라 지수를 구성하는 주요 종목의 주가약세는 불가피하다고 판단되며, 3분기 실적 호전이 예상되는 종목을 선별하여 집중적으로 투자해야 할 국면으로 판단합니다. 따라서 3분기 실적 예상을 면밀하게 해야 할 시기로 판단합니다.

향후 시장은 미국이 엔화약세에 대해 용인을 해주고 있는 분위기이나, 일본 자국내에서도 110엔 이상 엔화 가치가 떨어지는 부분에 대해 우려를 하고 있고, 원화역시 엔화가 초약세가 될 시 더불어 약세가 될 수 있으므로 110엔 이상 될 시 오히려 국내 기업에 좋은 영향을 줄 수 있다고 판단합니다. 따라서 엔화약세 심화의 부작용이 심화되고 속도조절을 하는 시기가 돌아온다면 국내 증시역시 반등의 기회로 삼을 수 있다고 판단합니다. 또한 달러강세가 줄어드는 시점에 원자재 가격도 다시 반등할 수 있으므로 달러 및 엔화 흐름이 중요할 것으로 판단됩니다. 따라서 환율변화에 중요한 변화가 감지된다면 대형-수출주 및 원자재 가격상승에 따라 주가 모멘텀이 발생할 수 있는 화학, 정유, 철강 등의 소재 업종의 비중을 적극적으로 확대할 생각입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년	설정일
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)	0.81	1.56	2.57	3.71	6.14	-	-	-	6.14
마이다스 증권 모투자신탁(채권)	0.62	1.30	2.23	3.05	3.82	6.73	11.43	21.80	47.92
마이다스 거북이 증권 모투자신탁(주식)	0.84	1.59	2.59	3.76	6.58	20.50	-	-	30.45
마이다스 거북이 90증권 자투자신탁 1호A(주식)	0.70	1.20	1.85	2.63	4.67	-	-	-	4.67
마이다스 거북이 90증권 자투자신탁 1호Ae(주식)	0.72	1.30	2.03	2.90	-	-	-	-	3.94
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C1(주식)	0.63	1.01	1.46	2.04	3.86	-	-	-	3.86
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)	0.72	1.26	1.97	2.80	-	-	-	-	3.39
마이다스 거북이90 증권 자투자신탁 1호C-W(주식)	0.75	1.39	2.22	3.18	-	-	-	-	3.81
비교지수	0.21	1.19	2.07	2.71	3.49	-	-	-	3.49

비교지수(Benchmark) = KOSPI 9% + 매경BP종합채권지수(국고채1~2년) 91%

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

▶ 연평균 수익률

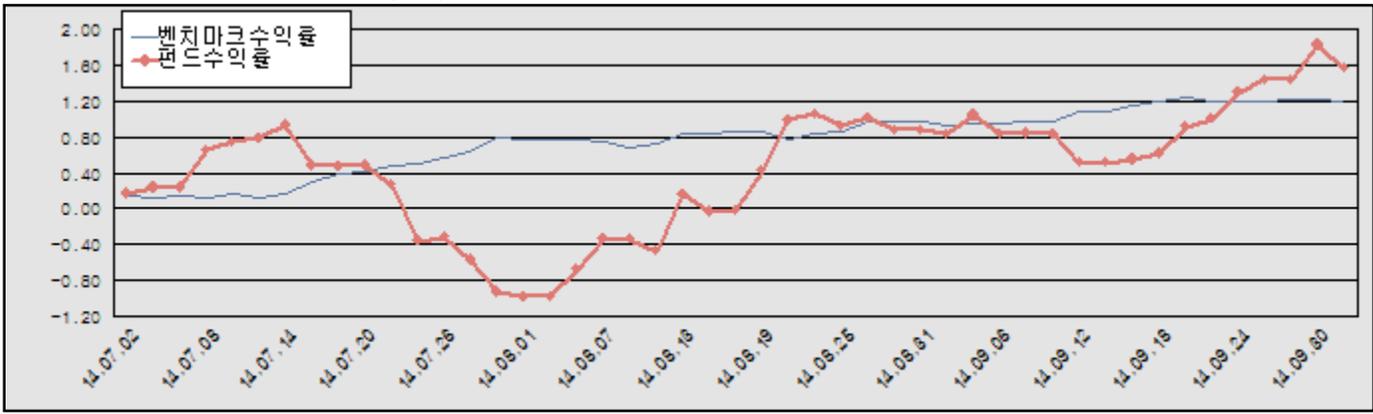
(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)	6.14	-	-	-
마이다스 증권 모투자신탁(채권)	3.82	3.31	3.67	4.02
마이다스 거북이 증권 모투자신탁(주식)	6.58	9.77	-	-
마이다스 거북이 90증권 자투자신탁 1호A(주식)	4.67	-	-	-
마이다스 거북이 90증권 자투자신탁 1호Ae(주식)	-	-	-	-
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C1(주식)	3.86	-	-	-
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)	-	-	-	-
마이다스 거북이90 증권 자투자신탁 1호C-W(주식)	-	-	-	-
비교지수	3.49	-	-	-

비교지수(Benchmark) = KOSPI 9% + 매경BP종합채권지수(국고채1~2년) 91%

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

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)



비교지수(Benchmark) = KOSPI 9% + 매경BP종합채권지수(국고채1~2년) 91%

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

▶ 손익현황

마이더스 거북이 90 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	-	-	4	4,571	-	-	-	-	-	61	2	4,638
전기손익	-	-	3	4,200	-	-	-	-	-	44	2	4,249

마이더스 증권 모두자산신탁(채권)

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	-	2,266	64	22	-	-	-	-	-	5	-3	2,354
전기손익	-	1,904	73	1	-	-	-	-	-	15	-3	1,990

마이더스 거북이 증권 모두자산신탁(주식)

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	4,480	-	264	-14	2,742	-	-	-	-	233	-1,757	5,948
전기손익	5,049	-17	368	-37	1,162	-	-	-	-	257	-1,475	5,307

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

마이더스 거북이 90 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	-	-	-	253,077 (97.03)	-	-	-	-	-	7,735 (2.97)	-	260,812 (100.00)
합계	-	-	-	253,077 (97.03)	-	-	-	-	-	7,735 (2.97)	-	260,812 (100.00)

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

마이더스 증권 모두자산신탁(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	-	165,301 (89.79)	-	3,033 (1.65)	-	-	-	-	-	5,616 (3.05)	10,153 (5.51)	184,103 (100.00)
합계	-	165,301 (89.79)	-	3,033 (1.65)	-	-	-	-	-	5,616 (3.05)	10,153 (5.51)	184,103 (100.00)

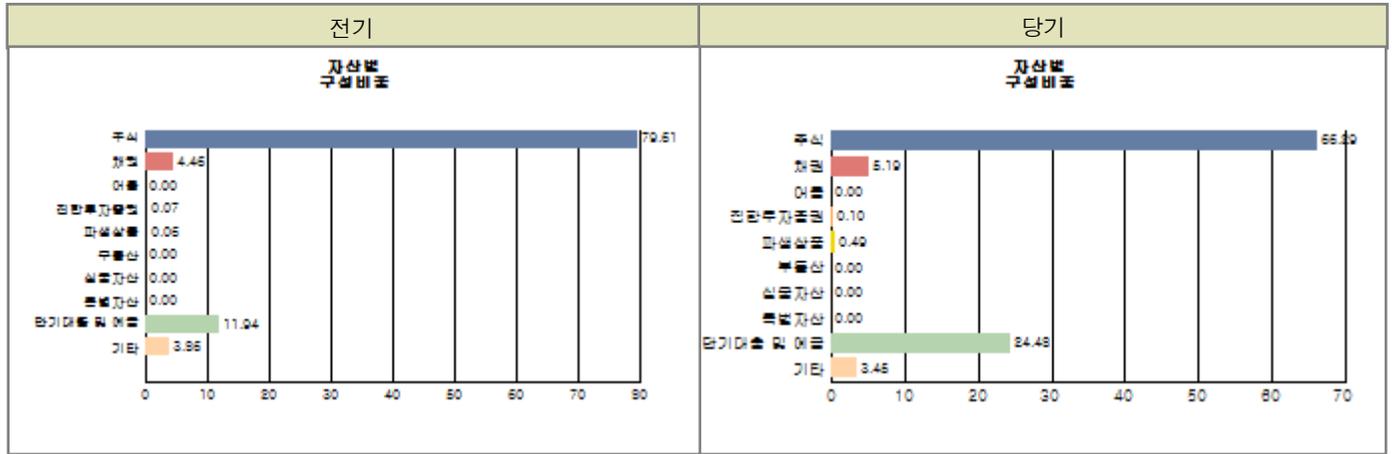
※ ()내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.

마이더스 거북이 증권 모두자산탁(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	251,505 (70.35)	-	-	-	1,857 (0.52)	-	-	-	-	92,254 (25.81)	11,863 (3.32)	357,479 (100.00)
합계	251,505 (70.35)	-	-	-	1,857 (0.52)	-	-	-	-	92,254 (25.81)	11,863 (3.32)	357,479 (100.00)

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



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

▶ 업종별, 국가별 투자비중

마이더스 거북이 증권 모두자산탁(주식)

주식투자 상위 10종목

종 목	비 중 (%)	종 목	비 중 (%)
삼성전자	11.79	SK하이닉스	4.62
NAVER	4.32	한국전력	3.54
현대위아	2.64	SK텔레콤	2.57
삼성물산	2.47	삼성생명	2.32
현대차	2.30	기아차	2.06

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

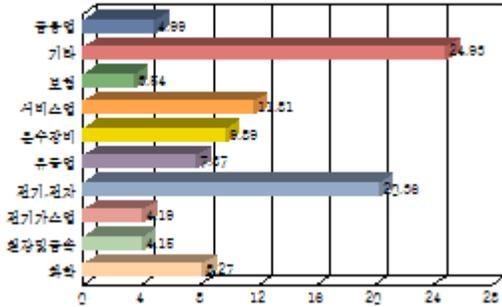
마이더스 거북이 증권 모두자산탁(주식)

업종별 투자비중

종 목	비 중 (%)	종 목	비 중 (%)
전기, 전자	20.36	서비스업	11.81
운수장비	9.89	화학	8.27
유통업	7.87	금융업	4.99
전기가스업	4.19	철강및금속	4.15
보험	3.54	기타	24.93

※ 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	8.29	2	단기대출및예금	콜 1일물 2.29	8.22
3	단기대출및예금	REPO매수 (14100112)	5.37	4	단기대출및예금	REPO매수 (14100131)	3.64
5	주식	SK하이닉스	3.25	6	주식	NAVER	3.04
7	단기대출및예금	REPO매수 (14100153)	2.99	8	단기대출및예금	REPO매수 (14100154)	2.88
9	주식	한국전력	2.49	10	단기대출및예금	REPO매수 (14100125)	2.07

※ 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)	17.84	2	채권	국고03250-1809(13-5)	7.31
3	채권	국고03500-1703(12-1)	5.61	4	채권	국고02750-1706(14-3)	5.55
5	채권	예보상환기금채10-1	5.52	6	채권	예보기금특별채2012-2	5.50
7	채권	통안0290-1512-02	5.49	8	채권	한국철도공사105	5.48
9	채권	통안0266-1506-01	5.46	10	채권	통안0284-1412-02	5.45

※ 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	25,650	29,651,400,000	11.79
SK하이닉스	250,553	11,625,659,200	4.62
NAVER	13,514	10,865,256,000	4.32
한국전력	182,644	8,903,895,000	3.54
현대위아	30,622	6,629,663,000	2.64

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

▶ 채권

■ 상위 5개 종목

마이더스 증권 모두자신탁(채권)

(단위 : 원,%)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
국고0300-1612(13-7)	32,000,000,000	32,850,944,000	2013-12-10	2016-12-10	대한민국 정부		19.87
국고03250-1809(13-5)	13,000,000,000	13,463,190,000	2013-09-10	2018-09-10	대한민국 정부		8.14
국고03500-1703(12-1)	10,000,000,000	10,325,630,000	2012-03-10	2017-03-10	대한민국 정부		6.25
국고02750-1706(14-3)	10,000,000,000	10,225,000,000	2014-06-10	2017-06-10	대한민국 정부		6.19
예보상환기금채10-1	10,000,000,000	10,167,700,000	2010-02-18	2015-02-18			6.15

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

▶ 어음

해당사항 없음

▶ 집합투자증권

■ 상위 5개 종목

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)

(단위 : 원)

종목	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	취득일	비중
마이더스거북이주식모	수익증권	마이더스에셋자산운용	238,515,504,581	238,515,504,581	2013-10-04	70.48
마이더스증권모(채권)	수익증권	마이더스에셋자산운용	14,561,516,175	14,561,516,175	2013-10-04	8.39

* 비중 : 자펀드가 해당 모펀드에서 차지하는 비중

마이더스 증권 모두자신탁(채권)

(단위 : 원)

종목	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	취득일	비중
KStar 단기통안채		마이더스에셋자산운용	3,009,286,350	3,032,700,000	2014-06-26	100.00

* 비중 : 보유한 전체 집합투자증권 중 해당 수익증권이 차지하는 비중

▶ 장내파생상품

마이더스 거북이 증권 모두자신탁(주식)

(단위 : 계약, 원)

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
코스피200 F 201412	매도	700	89,040,000,000	
코스피200 F 201412	매도	550	69,960,000,000	
코스피200 F 201412	매도	250	31,800,000,000	
합계		1,500	190,800,000,000	2,150,560

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 90 증권 자투자신탁 1호(주식)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
콜 1일물 2.29	미래에셋증권	2014-10-01	7,600,476,822	2.29	2014-10-02	

예금	하나은행		134,038,912	1.84		
----	------	--	-------------	------	--	--

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
콜 1일물 2.29	미래에셋증권	2014-10-01	29,401,844,548	2.29	2014-10-02	
REPO매수(14100112)	서울외국환중개	2014-10-01	19,201,209,863	2.30	2014-10-02	
REPO매수(14100131)	KIDB자금중개	2014-10-01	13,000,812,054	2.28	2014-10-02	
REPO매수(14100153)	한국자금중개	2014-10-01	10,700,680,109	2.32	2014-10-02	
REPO매수(14100154)	한국자금중개	2014-10-01	10,300,654,684	2.32	2014-10-02	

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
콜 1일물 2.29	미래에셋증권	2014-10-01	5,600,351,342	2.29	2014-10-02	
예금	하나은행		15,418,698	1.84		

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ 기타

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 원,%)

종류	평가금액	비고
유가증권매도미수금	10,153,000,000	

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	2013-10-09	대표이사	9	79,538	서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이더스에셋자산운용 대표이사	2109000325
오종록	2013-10-09	이사	12	75,081	서울대학교 경제학과, 교보투신, 한누리투자증권, 이트레이드증권, 알리안츠생명보험 자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 채권운용파트 이사	2109000845
권순신	2013-10-09	과장	10	74,967	서울대학교 재료공학부, 메트라이프, 알리안츠, 現 마이더스에셋자산운용 채권운용파트 과장	2110000311
채경섭	2013-10-09	팀장	8	60,785	BASF Company.Ltd., 신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 주식운용파트 팀장	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)

권순신 : 없음

채경섭 : 없음

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2013-10-02 ~ 현재	박정환
2013-10-09 ~ 현재	권순신
2013-10-09 ~ 현재	오종록
2013-10-09 ~ 현재	채경섭
2013-10-09 ~ 현재	허필석

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	-	-	-	-	
판매회사	-	-	-	-	
펀드재산보관(신탁업자)	-	-	-	-	
일반사무관리회사	-	-	-	-	
보수 합계	-	-	-	-	
기타비용**	1	0.00	0	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	1	1	0.00	
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	
	합계	1	0.00	1	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**	3	0.00	3	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	1	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**	1	0.00	0	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	941	881	0.21	
	조사분석업무 등 서비스수수료	780	627	0.15	
	합계	1,721	1,508	0.36	
증권거래세	1,419	0.22	1,452	0.35	

마이더스 거북이 90증권 자투자신탁 1호A(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	531	0.16	336	0.16	
판매회사	588	0.18	372	0.18	
펀드재산보관(신탁업자)	16	0.00	10	0.01	
일반사무관리회사	16	0.00	10	0.01	
보수 합계	1,152	0.35	729	0.36	
기타비용**	2	0.00	1	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	
	합계	-	-	-	
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이 90증권 자투자신탁 1호Ae(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	6	0.16	4	0.16	
판매회사	3	0.09	2	0.09	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	10	0.26	7	0.26	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	
	합계	-	-	-	
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	263	0.16	169	0.16	
판매회사	607	0.37	390	0.38	
펀드재산보관(신탁업자)	8	0.00	5	0.01	
일반사무관리회사	8	0.00	5	0.01	
보수 합계	886	0.55	570	0.55	
기타비용**	1	0.00	1	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	
	합계	-	-	-	
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	26	0.16	22	0.16	
판매회사	20	0.12	17	0.12	
펀드재산보관(신탁업자)	1	0.00	1	0.01	
일반사무관리회사	1	0.00	1	0.01	
보수 합계	47	0.29	40	0.30	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	
	합계	-	-	-	
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이90 증권 자투자신탁 1호C-W(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	10	0.16	5	0.16	
판매회사	-	-	-	-	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	10	0.17	6	0.17	
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.

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.00	0.00	0.00	1.00
당기	0.00	0.00	0.00	1.32

마이더스 증권 모두자산탁(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 모두자산탁(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.00	1.09	0.00	1.09
당기	0.00	1.43	0.00	1.43

마이더스 거북이 90증권 자투자신탁 1호A(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.41	-	1.41	1.00
당기	1.41	-	1.41	1.32

마이더스 거북이 90증권 자투자신탁 1호Ae(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.05	-	1.05	1.01
당기	1.05	-	1.05	1.31

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.19	-	2.19	1.01
당기	2.19	-	2.19	1.32

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.18	-	1.18	1.01
당기	1.18	-	1.18	1.31

마이더스 거북이90 증권 자투자신탁 1호C-W(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.69	-	0.69	0.97
당기	0.69	-	0.69	1.33

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 회전을

마이더스 거북이 증권 모두자산탁(주식)

(단위 : 주,원,%)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	3개월	연환산
6,918,402	240,559,661,520	12,239,874	462,298,112,960	132.74	532.41

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)

(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 주가가액의 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 매매회전을 추이

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : %)

2014-07-02 ~ 2014-10-01	2014-04-02 ~ 2014-07-01	2014-01-02 ~ 2014-04-01
132.74	74.71	48.47