

# MIDAS ASSET

마이다스에셋자산운용

## 자산운용보고서

### 마이다스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁

운용기간 2015.03.17 ~ 2015.06.16

Midas International Asset Management Ltd.

[www.midasasset.com](http://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 거북이70 소득공제 장기 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 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(2015-03-17 ~ 2015-06-16)   | 존속기간        | 추가형         |
| 자산운용사                                 | 마이다스에셋자산운용   |             |             |
| 펀드재산보관(신탁업자)                          | 하나은행   | 일반사무관리회사    | SC은행 펀드서비스부 |
| 판매회사                                  | NH농협은행(주) 하나은행 우리은행 우리투자증권 부산은행 신한은행 한국외환은행 삼성생명<br>하나대투증권 삼성증권 대구은행 펀드온라인코리아 한화투자증권 동부증권 대우증권<br>현대증권 키움증권 유진투자증권   |             |             |
| 상품의 특징                                | 이 투자신탁은 서민과 젊은 세대의 목돈 마련 지원을 목적으로 합니다. 롱숏전략을 통하여 금리+α의 수익률을 추구하는 주식모펀드(마이다스거북이주식모)에 70% 이상을 투자하며, 나머지는 채권모펀드(마이다스증권채권모)에 주로 투자합니다. 주식모펀드는 헤지 펀드의 주 운용전략인 롱숏 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

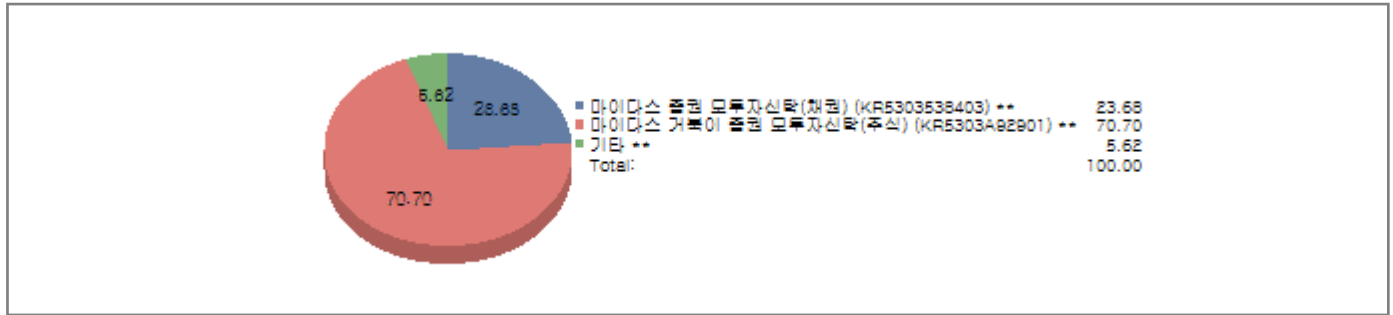
주된 투자대상

실제투자

| 모펀드                                     | 비중 (%)* |
|---|---------|
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) (KR5303538403) **     | 1.29    |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) (KR5303A92901) ** | 4.08    |

수익증권 매입

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.

수익증권 매입

| 종류형 펀드 | 종류(Class)별 | A      | B | C | D | E | F | H | I | P | W | J | S | S-P | 기타 |
|--------|------------|--------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|-----|----|
|        | 비중(%)***   | 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                              | 5,179,646,882 | 6,060,215,769 | 17.00  |
| 부채 총액                              | 3,214,596     | 769,859       | -76.05 |
| 순자산총액                              | 5,176,432,286 | 6,059,445,910 | 17.06  |
| 기준가격                               | 1,024.53      | 1,049.57      | 2.44   |

(단위 : 원, 좌/주. %)

| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 전기말             | 당기말             | 증감률    |
|-------------------|-----------------|-----------------|--------|
| 자산 총액             | 128,919,048,986 | 111,611,455,432 | -13.43 |
| 부채 총액             | 1,667,541       | 9,912,317       | 494.43 |
| 순자산총액             | 128,917,381,445 | 111,601,543,115 | -13.43 |
| 기준가격              | 1,006.42        | 1,013.03        | 0.66   |

(단위 : 원, 좌/주. %)

| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 전기말             | 당기말             | 증감률    |
|-----------------------|-----------------|-----------------|--------|
| 자산 총액                 | 197,240,823,130 | 111,139,544,646 | -43.65 |
| 부채 총액                 | 18,436,147,115  | 6,129,124,683   | -66.75 |
| 순자산총액                 | 178,804,676,015 | 105,010,419,963 | -41.27 |
| 기준가격                  | 1,007.68        | 1,039.90        | 3.20   |

(단위 : 원. %)

| 종류(Class)별 기준가격 현황                    | 전기말      | 당기말      | 증감률  |
|---------------------------------------|----------|----------|------|
| 마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호C (주식)  | 1,012.68 | 1,021.47 | 0.87 |
| 마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호Ce (주식) | 1,019.09 | 1,022.36 | 0.32 |

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 전기말 기준가격은 결산부기준가격이며, 채투자기준가격은 클래스 B(1000.00) 클래스 B(1000.00) 입니다.

※ 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

6월 16일 기준, 3개월 펀드수익률은 2.15%(클래스 C 기준)로 비교지수 대비 1.37%포인트 높은 수익률을 기록했습니다. 주식모펀드의 여러 전략 중, 펀더멘털 룻숏전략과 스팩 등의 공모주 참여로부터 수익이 발생했으며 테크니컬 룻숏에서는 일부 손실이 발생하여 펀드 전체적으로는 주식모펀드 기준, 3.20%의 수익이 발생했습니다. 채권모펀드는 0.65%의 채권투자수익을 더했습니다. 같은 기간, KOSPI가 2% 가까이 상승한 가운데 의약품, 증권, 서비스업, 유통업 등의 성과가 우수했습니다. 이 중, 펀드 내 편입비중이 높은 서비스업, 증권업의 주가 상승이 전체 펀드성과에 긍정적으로 작용하였습니다. 종목별로는 대한항공, 아모레퍼시픽, 아모레G우, CJ CGV, 엔에스쇼핑 등의 성과가 우수하였던 반면, 제일모직, 경남은행, 삼성전자 등은 성과가 부진하였습니다.

### ▶ 투자환경 및 운용계획

1분기 기업실적 발표 이후, 실적 개선이 확인되었거나 향후 구조적인 외형 성장 및 실적 개선 가능성 등을 고려하여 업종별 비중을 조정하는 작업을 진행하고 있습니다. 기업실적 개선에 대한 기대감으로 중소형 제약, 바이오, 의료기기 업종과 더불어 일부 화장품 업종에 대해 비중을 확대한 반면, 엔저의 영향으로 실적 부진이 예상되는 자동차와 일부 엔터테인먼트 업종의 비중을 축소하였습니다. 추후 기업실적을 반영한 업종 및 종목별 비중 조정을 꾸준히 실시할 계획입니다. 채권모펀드는 변동성이 확대된 장에서 듀레이션 변동폭을 조정하여 안정적으로 관리할 계획이며 향후 기준금리의 향방에 발맞추어 수익률을 관리할 것입니다.

### ▶ 기간수익률

(단위 : %)

| 구분                                    | 최근 1개월 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 | 설정일   |
|---------------------------------------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)    | 0.57   | 2.44   | 5.40   | 3.50   | 4.81  | -     | -     | -     | 4.96  |
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권)                     | 0.34   | 0.66   | 1.53   | 2.38   | 3.55  | 6.73  | 10.43 | 19.36 | 50.96 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)                 | 0.68   | 3.20   | 7.07   | 4.01   | 5.41  | 14.26 | 31.15 | -     | 34.23 |
| 마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호C (주식)  | 0.47   | 2.15   | 4.80   | 2.60   | 3.60  | -     | -     | -     | 3.44  |
| 마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호Ce (주식) | 0.50   | 2.24   | 4.98   | 2.87   | 3.97  | -     | -     | -     | 4.19  |
| 비교지수                                  | 0.04   | 0.78   | 1.97   | 2.28   | 3.60  | -     | -     | -     | 4.66  |

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

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

▶ 연평균 수익률

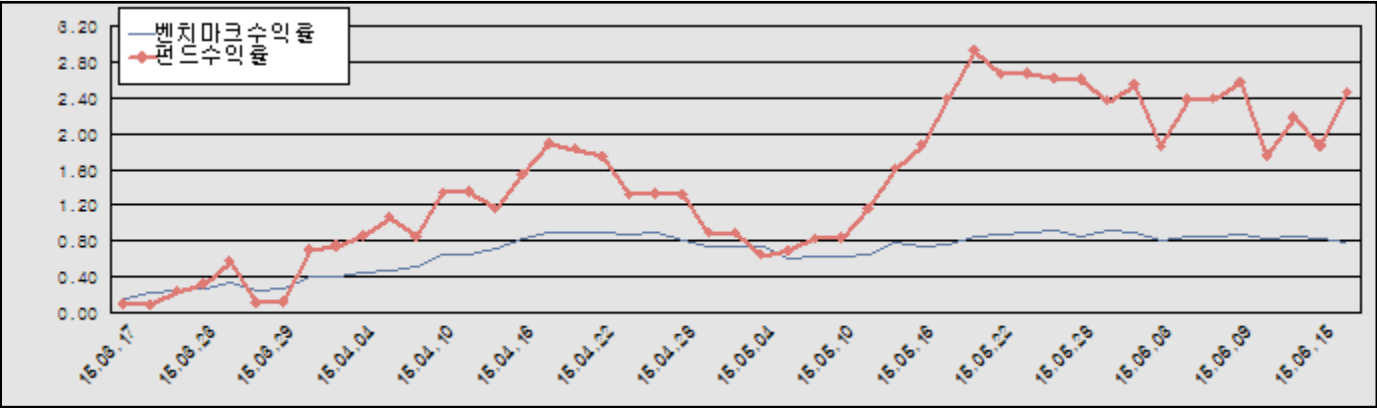
(단위 : %)

| 구분                                    | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|---------------------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 마이다스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)    | 4.81  | -     | -     | -     |
| 마이다스 증권 모투자신탁(채권)                     | 3.55  | 3.31  | 3.36  | 3.60  |
| 마이다스 거북이 증권 모투자신탁(주식)                 | 5.41  | 6.89  | 9.46  | -     |
| 마이다스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호C (주식)  | 3.60  | -     | -     | -     |
| 마이다스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호Ce (주식) | 3.97  | -     | -     | -     |
| 비교지수                                  | 3.60  | -     | -     | -     |

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

\* 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 | -  | -  | -  | 131     | -    | -  | -   | -    | -  | 1         | -  | 132  |
| 전기손익 | -  | -  | -  | 126     | -    | -  | -   | -    | -  | 1         | -  | 127  |

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 | -  | 761   | 2  | 9       | -8   | -  | -   | -    | -  | 21        | -2 | 783   |
| 전기손익 | -  | 1,175 | 6  | -9      | -    | -  | -   | -    | -  | 28        | 25 | 1,225 |

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 | 4,985  | -  | 126 | -       | -173   | -  | -   | -    | -  | 25        | -494  | 4,469 |
| 전기손익 | 12,434 | -  | 192 | 58      | -4,889 | -  | -   | -    | -  | 60        | 1,513 | 9,368 |

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     | -  | -  | -         | 5,719<br>(94.37) | -    | -  | -   | -    | -  | 341<br>(5.63) | -  | 6,060<br>(100.00) |
| 합계     | -  | -  | -         | 5,719<br>(94.37) | -    | -  | -   | -    | -  | 341<br>(5.63) | -  | 6,060<br>(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     | -  | 107,401<br>(96.23) | -         | -       | -    | -  | -   | -    | -  | 4,210<br>(3.77) | -  | 111,611<br>(100.00) |
| 합계     | -  | 107,401<br>(96.23) | -         | -       | -    | -  | -   | -    | -  | 4,210<br>(3.77) | -  | 111,611<br>(100.00) |

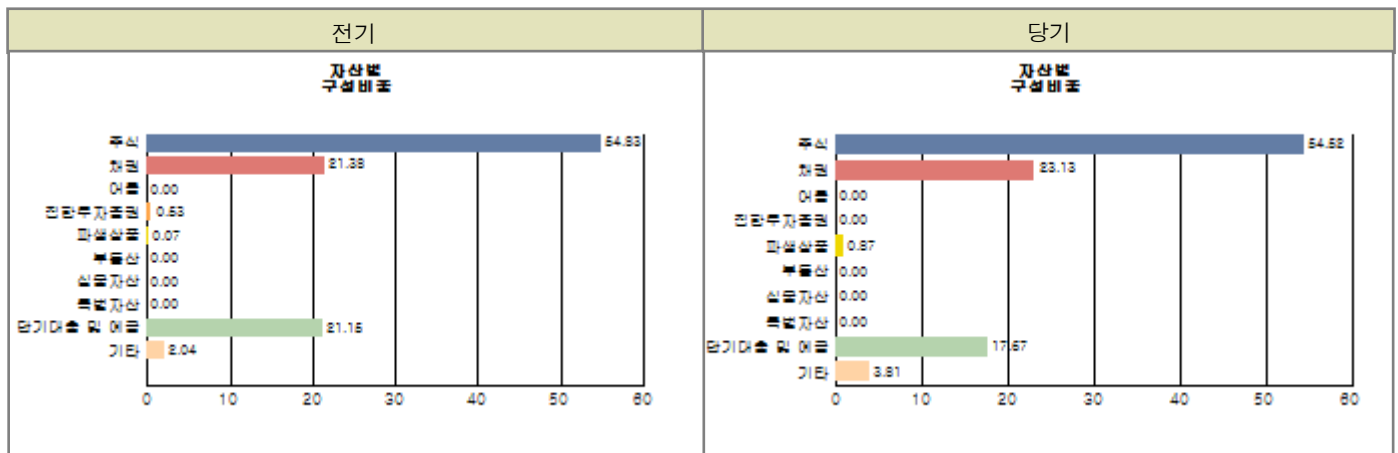
※ ( )내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.

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     | 79,774<br>(71.78) | -  | -         | -       | 1,268<br>(1.14) | -  | -   | -    | -  | 24,523<br>(22.06) | 5,575<br>(5.02) | 111,140<br>(100.00) |
| 합계     | 79,774<br>(71.78) | -  | -         | -       | 1,268<br>(1.14) | -  | -   | -    | -  | 24,523<br>(22.06) | 5,575<br>(5.02) | 111,140<br>(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)

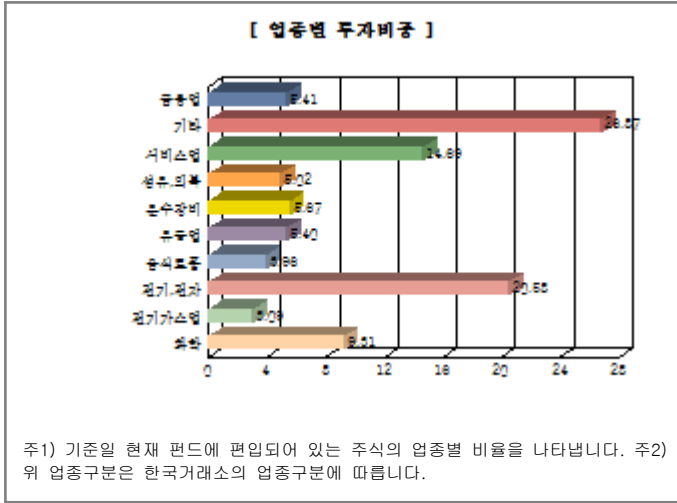
주식투자 상위 10종목

| 종 목    | 비 중(%) | 종 목         | 비 중(%) |
|--------|--------|-------------|--------|
| 삼성전자   | 18.63  | 제일모직        | 4.15   |
| 아모레퍼시픽 | 3.38   | 한국전력        | 2.88   |
| SK C&C | 2.40   | 오리온         | 2.37   |
| 현대글로비스 | 2.22   | SK텔레콤       | 2.22   |
| 아모레G우  | 2.16   | BNK금융지주(주교) | 2.11   |

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

| 종 목    | 비 중(%) | 종 목  | 비 중(%) |
|--------|--------|------|--------|
| 전기, 전자 | 20.58  | 서비스업 | 14.69  |
| 화학     | 9.31   | 운수장비 | 5.67   |
| 금융업    | 5.41   | 유통업  | 5.40   |
| 섬유, 의복 | 5.02   | 음식료품 | 3.96   |
| 전기가공업  | 3.09   | 기타   | 26.87  |

※ 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              | 13.37 | 2   | 단기대출및예금 | 콜 1일물 1.54 |
| 3  | 단기대출및예금 | REPO매수 (15061620) | 9.00  | 4   | 주식      | 제일모직       |
| 5  | 주식      | 아모레퍼시픽            | 2.43  | 6   | 주식      | 한국전력       |
| 7  | 주식      | SK C&C            | 1.72  | 8   | 주식      | 오리온        |
| 9  | 주식      | 현대글로벌비스           | 1.59  | 10  | 주식      | SK텔레콤      |

※ 비중 : 펀드내 순자산 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : %)

| 구분 | 종목명 | 비중                 | 구분    | 종목명 | 비중      |                    |
|----|-----|--------------------|-------|-----|---------|--------------------|
| 1  | 채권  | 국고03500-1703(12-1) | 25.16 | 2   | 채권      | 국고0300-1612(13-7)  |
| 3  | 채권  | 통안0222-1610-02     | 18.13 | 4   | 채권      | 통안0196-1702-02     |
| 5  | 채권  | 통안0171-1704-02     | 8.99  | 6   | 채권      | 기업(신)1412할1A-09    |
| 7  | 채권  | 통안0279-1606-02     | 4.54  | 8   | 단기대출및예금 | 콜 1일물 1.54         |
| 9  | 채권  | 대구도시공사보상1411       | 1.28  | 10  | 채권      | 국고03500-1609(11-5) |

※ 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   | 11,843 | 14,862,965,000 | 18.63 |
| 제일모직   | 19,580 | 3,309,020,000  | 4.15  |
| 아모레퍼시픽 | 6,960  | 2,697,000,000  | 3.38  |
| 한국전력   | 53,391 | 2,295,813,000  | 2.88  |
| SK C&C | 7,202  | 1,912,131,000  | 2.40  |

※ 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 ※※ |
|-----------|---------|-------------|------|-------|
| SK1호스팩    | 152,141 | 322,538,920 | 0.40 | 2.77  |
| 대우SBI스팩1호 | 84,950  | 222,993,750 | 0.28 | 2.40  |
| 케이티비스팩2호  | 88,565  | 185,543,675 | 0.23 | 1.61  |

※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    |
|--------------------|----------------|----------------|------------|------------|---------|------|-------|
| 국고03500-1703(12-1) | 27,000,000,000 | 28,082,268,000 | 2012-03-10 | 2017-03-10 | 대한민국 정부 |      | 26.15 |
| 국고0300-1612(13-7)  | 21,000,000,000 | 21,418,614,000 | 2013-12-10 | 2016-12-10 | 대한민국 정부 |      | 19.94 |
| 통안0222-1610-02     | 20,000,000,000 | 20,235,240,000 | 2014-10-02 | 2016-10-02 | 대한민국 정부 |      | 18.84 |
| 통안0196-1702-02     | 10,000,000,000 | 10,069,020,000 | 2015-02-02 | 2017-02-02 | 대한민국 정부 |      | 9.38  |
| 통안0171-1704-02     | 10,000,000,000 | 10,037,430,000 | 2015-04-02 | 2017-04-02 | 대한민국 정부 |      | 9.35  |

※ 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 | 4,162,154,980 | 4,284,319,501 | 2014-03-18 | 4.08 |
| 마이더스증권모(채권) | 수익증권 | 마이더스에셋자산운용 | 1,425,648,281 | 1,434,855,169 | 2014-03-18 | 1.29 |

※ 비중 : 자펀드가 해당 모펀드에서 차지하는 비중

▶ 장내파생상품

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 계약, 원)

| 종목명             | 매수/매도 | 계약수 | 미결제약정금액        | 위탁증거금       |
|-----------------|-------|-----|----------------|-------------|
| 코스피200 F 201509 | 매도    | 440 | 54,626,000,000 |             |
| 합계              |       | 440 | 54,626,000,000 | 595,669,455 |

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 모투자신탁(주식)

| 종류               | 금융기관         | 대출(예금)일자   | 대출(예금)액        | 적용금리 | 만기일        | 비고 |
|------------------|--------------|------------|----------------|------|------------|----|
| 콜 1일물 1.54       | 미래에셋증권       | 2015-06-16 | 12,700,535,835 | 1.54 | 2015-06-17 |    |
| REPO매수(15061620) | 국민은행(자금팀)    | 2015-06-16 | 10,000,400,000 | 1.46 | 2015-06-17 |    |
| 예금               | 하나은행         |            | 621,762,191    | 1.15 |            |    |
| REPO매수(15061616) | HMC투자증권(구신흥) | 2015-06-16 | 600,024,657    | 1.50 | 2015-06-17 |    |
| REPO매수(15061618) | 전북은행         | 2015-06-16 | 600,024,493    | 1.49 | 2015-06-17 |    |

\* 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)

| 종류         | 금융기관   | 대출(예금)일자   | 대출(예금)액     | 적용금리 | 만기일        | 비고 |
|------------|--------|------------|-------------|------|------------|----|
| 콜 1일물 1.54 | 미래에셋증권 | 2015-06-16 | 200,008,438 | 1.54 | 2015-06-17 |    |
| 예금         | 하나은행   |            | 141,032,661 | 1.15 |            |    |

\* 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

| 종류         | 금융기관   | 대출(예금)일자   | 대출(예금)액       | 적용금리 | 만기일        | 비고 |
|------------|--------|------------|---------------|------|------------|----|
| 콜 1일물 1.54 | 미래에셋증권 | 2015-06-16 | 4,100,172,986 | 1.54 | 2015-06-17 |    |
| 예금         | 하나은행   |            | 110,299,294   | 1.15 |            |    |

\* 상위 5개 종목만 기재함.

▶ 기타

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 원,%)

| 종류        | 평가금액          | 비고 |
|-----------|---------------|----|
| 유가증권매도미수금 | 5,475,672,809 |    |

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 | 2014-03-17 | 책임운용역  | 10            | 18,613 | 서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이더스에셋자산운용 총괄대표                 | 2109000325 |
| 오종록 | 2014-03-17 | 책임운용역  | 13            | 5,853  | 서울대학교 경제학과, 교보투신, 한누리투자증권, 이트레이드증권, 알리안츠생명보험 자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 채권운용파트장                           | 2109000845 |
| 최종혁 | 2015-01-12 | 부책임운용역 | 9             | 8,958  | 성균관대학교 경제학과, 대우증권, 유리자산운용 마이더스에셋자산운용 주식운용파트 팀장  | 2109001142 |
| 채경섭 | 2015-05-29 | 부책임운용역 | 10            | 20,994 | BASF Company.Ltd. ,신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 주식운용파트 팀장                                   | 2109000941 |
| 정승호 | 2014-10-01 | 부책임운용역 | 13            | 20,235 | 뉴욕주립대학교(알바니) 대학원 회계학석사, CFA, AICPA, CMA/CFM, 델로이트안진회계법인 리서치, GS자산운용 채권운용팀, 現 마이더스에셋자산운용 채권운용파트 부장 | 2110000746 |

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)  
 최종혁 : 없음  
 채경섭 : 없음  
 적승호 : 없음

▶ 운용전문인력 변경내역

| 기간                      | 운용전문인력 |
|-------------------------|--------|
| 2014-03-17 ~ 2014-09-30 | 권순신    |
| 2014-03-17 ~ 현재         | 오종록    |
| 2014-03-17 ~ 현재         | 허필석    |
| 2014-10-01 ~ 현재         | 정승호    |
| 2015-01-12 ~ 2015-05-28 | 최종혁    |
| 2015-05-29 ~ 현재         | 채경섭    |

## 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<br>중개<br>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   | 2    | 0.00   |      |
| 매매<br>중개<br>수수료 | 단순매매/중개수수료      | 1      | 0.00 | 0      | 0.00 |
|                 | 조사분석업무 등 서비스수수료 | -      | -    | -      | -    |
|                 | 합계              | 1      | 0.00 | 0      | 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   | 0    | 0.00   |      |
| 매매<br>중개<br>수수료 | 단순매매/중개수수료      | 435    | 0.19 | 230    | 0.17 |
|                 | 조사분석업무 등 서비스수수료 | 264    | 0.12 | 193    | 0.15 |
|                 | 합계              | 699    | 0.31 | 423    | 0.32 |
| 증권거래세           | 637             | 0.28   | 433  | 0.33   |      |

마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호C(주식)

(단위 : 백만원,%)

| 구분              | 전기              |        | 당기 |        | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
|                 | 금액              | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* |    |
| 자산운용사           | 5               | 0.10   | 6  | 0.11   |    |
| 판매회사            | 8               | 0.17   | 9  | 0.18   |    |
| 펀드재산보관(신탁업자)    | 0               | 0.00   | 0  | 0.01   |    |
| 일반사무관리회사        | 0               | 0.00   | 0  | 0.01   |    |
| 보수 합계           | 13              | 0.29   | 16 | 0.29   |    |
| 기타비용**          | 0               | 0.00   | 0  | 0.00   |    |
| 매매<br>중개<br>수수료 | 단순매매/중개수수료      | -      | -  | -      | -  |
|                 | 조사분석업무 등 서비스수수료 | -      | -  | -      | -  |
|                 | 합계              | -      | -  | -      | -  |
| 증권거래세           | -               | -      | -  | -      |    |

마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)

(단위 : 백만원,%)

| 구분              | 전기              |        | 당기 |        | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
|                 | 금액              | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* |    |
| 자산운용사           | 0               | 0.10   | 0  | 0.11   |    |
| 판매회사            | 0               | 0.09   | 0  | 0.09   |    |
| 펀드재산보관(신탁업자)    | 0               | 0.00   | 0  | 0.01   |    |
| 일반사무관리회사        | 0               | 0.00   | 0  | 0.01   |    |
| 보수 합계           | 0               | 0.20   | 0  | 0.20   |    |
| 기타비용**          | 0               | 0.00   | 0  | 0.00   |    |
| 매매<br>중개<br>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 | -        | 0.00        | 0.00        | 0.94        |
| 당기 | -        | 0.00        | 0.00        | 0.90        |

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     | 1.25        | 0.00        | 1.25        |
| 당기 | 0.00     | 1.27        | 0.00        | 1.27        |

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 | 1.16     | -           | 1.16        | 0.94        |
| 당기 | 1.16     | -           | 1.16        | 0.90        |

마이더스 거북이70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호Ce (주식)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드    |             | 상위펀드 비용 합산  |             |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
|    | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | 0.81     | -           | 0.81        | 0.96        |
| 당기 | 0.81     | -           | 0.81        | 0.90        |

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 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 주,원,%)

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

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 주,원,%)

| 매수        |                | 매도        |                 | 매매회전율  |        |
|-----------|----------------|-----------|-----------------|--------|--------|
| 수량        | 금액             | 수량        | 금액              | 3개월    | 연환산    |
| 2,914,206 | 73,465,770,650 | 4,109,978 | 135,549,921,475 | 132.86 | 527.11 |

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 : %)

| 2015-03-17 ~ 2015-06-16 | 2014-12-17 ~ 2015-03-16 | 2014-09-17 ~ 2014-12-16 |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 132.86                  | 102.00                  | 119.87                  |