

MIDAS ASSET

마이다스에셋자산운용

자산운용보고서

마이다스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁

운용기간 2015.07.07 ~ 2015.10.06

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.

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

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합)의 자산운용사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드자산보관자(신탁업자)인 'KEB하나은행(하나)'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 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) | | AL611 | |
| 마이다스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) C | | AL612 | |
| 마이다스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) Ce | | AL613 | |
| 펀드의 종류 | 투자신탁/증권(혼합주식)/추가형/개방형/종류형/모자형 | 최초설정일 | 2013-10-07 |
| 운용기간 | 3개월(2015-07-07 ~ 2015-10-06) | 존속기간 | 추가형 |
| 자산운용사 | 마이다스에셋자산운용 | | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | KEB하나은행(하나) | 일반사무관리회사 | SC은행 펀드서비스부 |
| 판매회사 | 미래에셋증권 하나금융투자 삼성증권 우리투자증권 한국투자증권 KEB하나은행(외환) 신한금융투자 유진투자증권 삼성생명 우리은행 한화투자증권 | | |
| 상품의 특징 | 본 상품은 혼합형 펀드로서 주식에 50%~60%, 채권등에 50% 이하를 투자하고 있습니다. KOSPI등락률5%+매경BP 종합채권지수 1~2년물 수익률 95%를 벤치마크로 하여 벤치마크대비 초과성과를 목표로 하고 있습니다. 따라서 수익자는 주식형 펀드와 비교하여 상대적으로 안정된 수익을 기대할 수 있는 상품입니다. 룡숏 전략 등 다양한 절대수익 추구전략을 복합적으로 활용하여 투자위험을 축소하고, 국내 주식 매매차익에 대한 비과세로 주식투자부분에 대해 절세효과를 기대할 수 있습니다. 본 상품은 자산의 50%~60%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

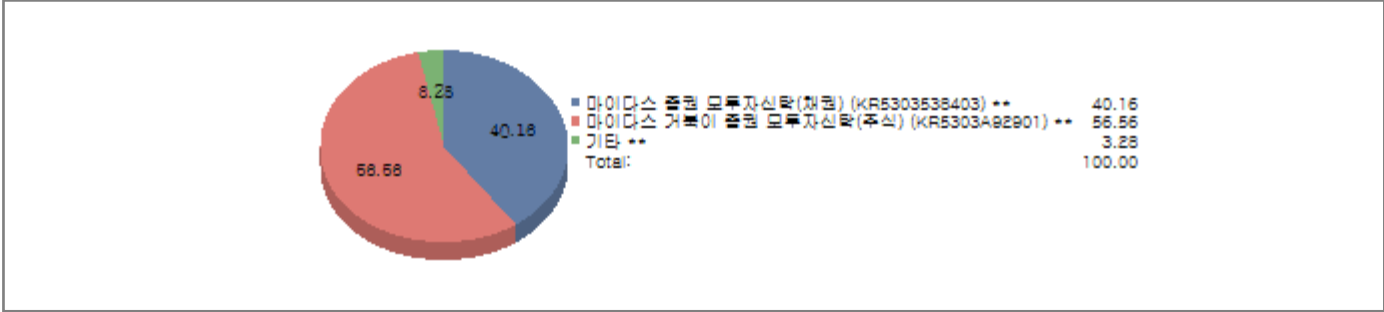
주된 투자대상

실제투자

| 모펀드 | 비중 (%)* |
|---|---------|
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) (KR5303538403) ** | 1.00 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) (KR5303A92901) ** | 1.84 |

수익증권 매입

마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합)



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 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 11.38 |

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

▶ 재산현황

(단위 : 원, 좌/주, %)

| 마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-----------------------------------|---------------|---------------|-------|
| 자산 총액 | 2,773,396,154 | 2,903,418,209 | 4.69 |
| 부채 총액 | 0 | 0 | 0.00 |
| 순자산총액 | 2,773,396,154 | 2,903,418,209 | 4.69 |
| 기준가격 | 1,090.20 | 1,077.49 | -1.17 |

(단위 : 원, 좌/주, %)

| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-------------------|-----------------|-----------------|--------|
| 자산 총액 | 110,875,668,949 | 116,483,107,269 | 5.06 |
| 부채 총액 | 227,387,496 | 2,956,684 | -98.70 |
| 순자산총액 | 110,648,281,453 | 116,480,150,585 | 5.27 |
| 기준가격 | 1,013.94 | 1,020.47 | 0.64 |

(단위 : 원, 좌/주, %)

| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-----------------------|----------------|----------------|--------|
| 자산 총액 | 98,126,557,969 | 90,992,862,229 | -7.27 |
| 부채 총액 | 259,976,403 | 1,934,043,737 | 643.93 |
| 순자산총액 | 97,866,581,566 | 89,058,818,492 | -9.00 |
| 기준가격 | 1,060.36 | 1,032.94 | -2.59 |

(단위 : 원, %)

| 종류(Class)별 기준가격 현황 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|--------------------------------------|----------|----------|-------|
| 마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) C | 1,029.13 | 1,013.94 | -1.48 |
| 마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) Ce | 1,032.18 | 1,017.98 | -1.38 |

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 C(1000.00) 클래스 (1000.00) 입니다.

※ 분배금내역

거북50연금자1C(주혼)

(단위 : 백만원, 좌)

| 분배금 기준일 | 분배금 지급금액 | 분배후 수탁고 | 기준가격(원) | | 비고 |
|------------|----------|---------------|----------|----------|----|
| | | | 분배금 지급전 | 분배금 지급후 | |
| 2015-10-06 | 0 | 2,563,308,431 | 1,013.94 | 1,000.00 | |

거북50연금자1Ce(주혼)

(단위 : 백만원, 좌)

| 분배금 기준일 | 분배금 지급금액 | 분배후 수탁고 | 기준가격(원) | | 비고 |
|------------|----------|-------------|----------|----------|----|
| | | | 분배금 지급전 | 분배금 지급후 | |
| 2015-10-06 | 0 | 290,837,910 | 1,017.98 | 1,000.00 | |

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

해당 기간 펀드의 수익률은 -1.48%(클래스 C 기준)로, 비교지수 대비 -1.95%p 저조한 성과를 기록하였습니다. KOSPI는 -3.08% 하락함에 따라 주식 롱 포지션에서는 손실(모펀드 기준 -4.20%)이 발생했습니다. 한편, 시장이 하락하는 상황 하에서 지수선물 숏 포지션과 개별주식 숏 포지션에서는 일부 수익이 발생하였지만 롱 포지션에서의 손실을 만회하지 못하여 종합적으로 모펀드 기준 -2.59% 손실을 기록하였습니다. 동 기간, 채권모펀드는 0.64% 상승하여 일부 이익을 더하였으나 전체 펀드는 롱 포지션에서 충분한 수익을 거두지 못한 것이 주요한 원인으로 작용하여 비교지수 대비 낮은 성과를 기록하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

중기적인 측면에서 여전히 구조적인 성장이 가능한 헬스케어, 제약 및 바이오, 화장품 등의 업종을 선호하고 있습니다. 전세계적인 성장률 둔화와 그 동안 한국경제의 성장을 주도해왔던 자동차 및 전기전자 업종의 성장 둔화로 인해 앞에 열거한 구조적인 성장세가 기대되는 업종 및 기업에 대한 선호현상이 지속될 것으로 판단하기 때문입니다. 그러나 단기적으로는, 시장 내 변동성이 확대되는 국면이라 판단하여 '전통적인 후반기 강세' 업종인 내수 및 고배당 업종의 비중을 확대하여 운용할 계획입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 1개월 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 | 설정일 |
|--------------------------------------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) | 0.47 | -1.17 | 1.16 | 2.42 | 2.65 | 7.75 | - | - | 7.75 |
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 0.20 | 0.64 | 1.11 | 2.07 | 2.82 | 6.68 | 9.63 | 18.09 | 52.07 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 0.69 | -2.59 | 1.10 | 2.60 | 2.40 | 8.37 | 21.81 | - | 33.34 |
| 마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) C | 0.37 | -1.48 | 0.54 | 1.48 | 1.39 | 5.13 | - | - | 5.13 |
| 마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) Ce | 0.41 | -1.38 | 0.74 | 1.78 | 1.80 | - | - | - | 5.23 |
| 비교지수 | 0.47 | 0.47 | 0.95 | 2.37 | 2.87 | 6.52 | - | - | 6.52 |

비교지수(Benchmark) = KOSPI 5% + 매경BP종합채권지수(국고채1~2년) 95%

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

▶ 연평균 수익률

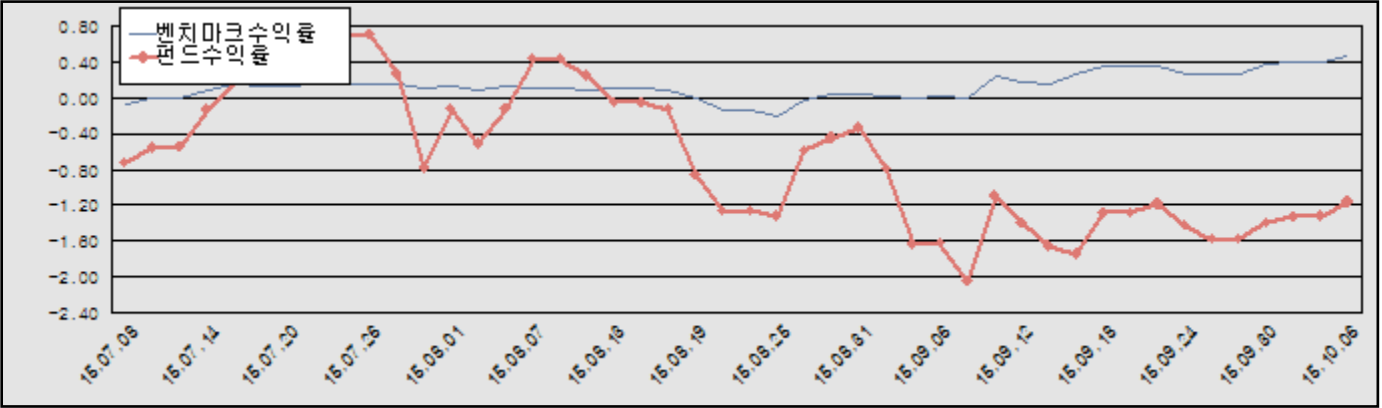
(단위 : %)

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|--------------------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) | 2.65 | 3.80 | - | - |
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 2.82 | 3.29 | 3.11 | 3.38 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 2.40 | 4.10 | 6.80 | - |
| 마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) C | 1.39 | 2.53 | - | - |
| 마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) Ce | 1.80 | - | - | - |
| 비교지수 | 2.87 | 3.21 | - | - |

비교지수(Benchmark) = KOSPI 5% + 매경BP종합채권지수(국고채1~2년) 95%

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

마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합)



비교지수(Benchmark) = KOSPI 5% + 매경BP종합채권지수(국고채1~2년) 95%

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

▶ 손익현황

마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합)

(단위 : 백만원)

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|------|----|----|----|--------|------|----|-----|------|----|-----------|----|------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | - | - | - | -34 | - | - | - | - | - | 0 | - | -34 |
| 전기손익 | - | - | - | 65 | - | - | - | - | - | 0 | - | 65 |

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 백만원)

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|------|----|-----|----|--------|------|----|-----|------|----|-----------|----|------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | - | 674 | 29 | - | - | - | - | - | - | 33 | -2 | 734 |
| 전기손익 | - | 505 | 2 | 5 | -8 | - | - | - | - | 20 | -2 | 522 |

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 백만원)

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|------|--------|----|----|--------|-------|----|-----|------|----|-----------|------|--------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | -4,335 | - | 71 | 51 | 1,965 | - | - | - | - | 30 | -196 | -2,414 |
| 전기손익 | 3,150 | - | 97 | - | 1,383 | - | - | - | - | 24 | -375 | 4,279 |

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합)

(단위 : 백만원, %)

| 통화별 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|--------|----|----|-----------|------------------|------|----|-----|------|----|--------------|----|-------------------|
| | 주식 | 채권 | 어음 및 기타증권 | 집합투자증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 원화 | - | - | - | 2,808 (96.72) | - | - | - | - | - | 95 (3.28) | - | 2,903 (100.00) |
| 합계 | - | - | - | 2,808 (96.72) | - | - | - | - | - | 95 (3.28) | - | 2,903 (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 | 집합투자증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 원화 | - | 103,383 (88.75) | - | - | - | - | - | - | - | 13,100 (11.25) | - | 116,483 (100.00) |
| 합계 | - | 103,383 (88.75) | - | - | - | - | - | - | - | 13,100 (11.25) | - | 116,483 (100.00) |

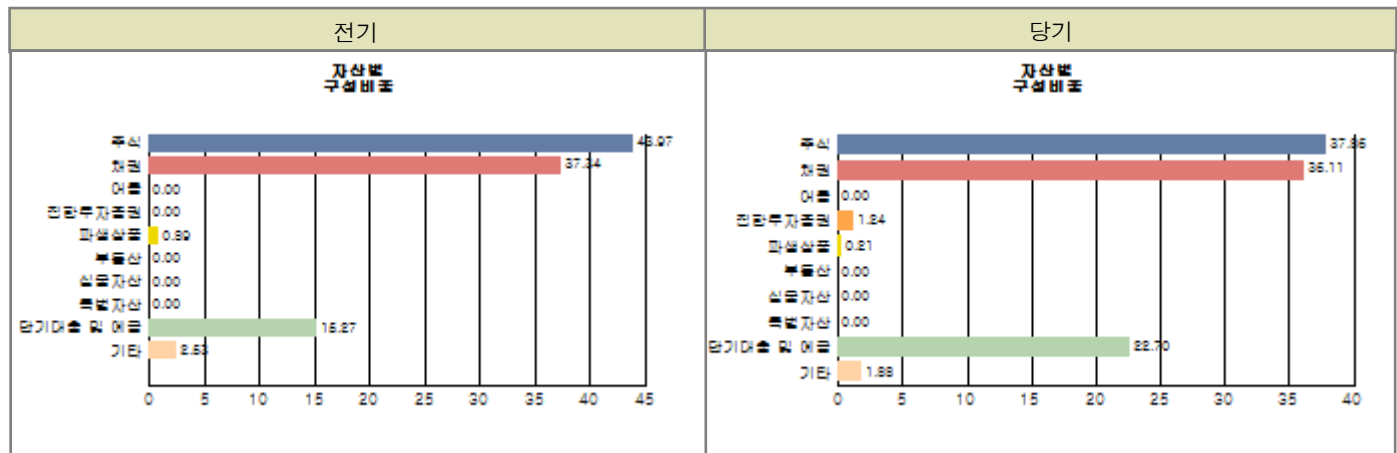
※ ()내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.

마이더스 거북이 증권 모두자신탁(주식)

(단위 : 백만원, %)

| 통화별 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|--------|-------------------|----|-----------|-----------------|---------------|----|-----|------|----|-------------------|-----------------|--------------------|
| | 주식 | 채권 | 어음 및 기타증권 | 집합투자증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 원화 | 58,835 (64.65) | - | - | 1,929 (2.12) | 333 (0.36) | - | - | - | - | 28,153 (30.93) | 2,919 (3.20) | 92,169 (101.26) |
| 합계 | 58,835 (64.65) | - | - | 1,929 (2.12) | 333 (0.36) | - | - | - | - | 28,153 (30.93) | 2,919 (3.20) | 92,169 (101.26) |

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



주) 위의 자산구성현황은 투자자가 가입한 펀드의 실제 자산구성내역이 아니고, 투자자의 이해를 돕기위해, 모펀드의 자산구성 내역과 해당 펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율 등을 감안하여 산출한 것입니다.

▶ 업종별, 국가별 투자비중

마이더스 거북이 증권 모두자신탁(주식)

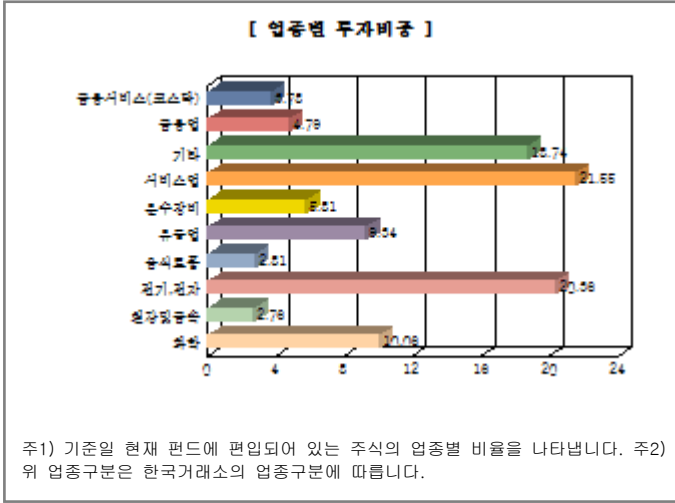
주식투자 상위 10종목

| 종 목 | 비 중(%) | 종 목 | 비 중(%) |
|--------|--------|--------|--------|
| 삼성전자 | 17.51 | SK | 3.55 |
| 아모레퍼시픽 | 2.97 | SK텔레콤 | 2.48 |
| 삼성물산 | 2.45 | 한국전력 | 2.19 |
| LG생활건강 | 1.99 | NAVER | 1.89 |
| CJ | 1.85 | 현대글로비스 | 1.74 |

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

| 종 목 | 비 중(%) | 종 목 | 비 중(%) |
|------------|--------|--------|--------|
| 서비스업 | 21.55 | 전기, 전자 | 20.36 |
| 화학 | 10.06 | 유통업 | 9.34 |
| 운수장비 | 5.81 | 금융업 | 4.79 |
| 금융서비스(코스닥) | 3.78 | 음식료품 | 2.81 |
| 철강및금속 | 2.76 | 기타 | 18.74 |

※ 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 | 11.32 | 2 | 단기대출및예금 | REPO매수(15100649) | 9.89 |
| 3 | 단기대출및예금 | REPO매수(15100626) | 9.23 | 4 | 단기대출및예금 | 콜 2일물 1.54 | 8.46 |
| 5 | 단기대출및예금 | REPO매수(15100651) | 3.30 | 6 | 주식 | SK | 2.29 |
| 7 | 집합투자증권 | KODEX 레버리지 | 2.12 | 8 | 주식 | 아모레퍼시픽 | 1.92 |
| 9 | 주식 | SK텔레콤 | 1.61 | 10 | 주식 | 삼성물산 | 1.59 |

※ 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) | 23.88 | 2 | 채권 | 통안0222-1610-02 | 17.29 |
| 3 | 채권 | 국고0300-1612(13-7) | 9.70 | 4 | 채권 | 국고05750-1809(08-5) | 9.63 |
| 5 | 채권 | 국고02750-1803(13-1) | 8.84 | 6 | 채권 | 국고02000-1712(14-6) | 8.72 |
| 7 | 채권 | 기업(신)1412할1A-09 | 8.56 | 8 | 단기대출및예금 | 콜 2일물 1.54 | 8.50 |
| 9 | 단기대출및예금 | REPO매수(15100634) | 2.58 | 10 | 채권 | 대구도시공사보상1411 | 1.24 |

※ 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 | 8,953 | 10,304,903,000 | 17.51 |
| SK | 8,215 | 2,086,610,000 | 3.55 |
| 아모레퍼시픽 | 4,410 | 1,746,360,000 | 2.97 |
| SK텔레콤 | 5,640 | 1,460,760,000 | 2.48 |
| 삼성물산 | 9,563 | 1,444,013,000 | 2.45 |

※ 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 | 324,060,330 | 0.55 | 2.77 |
| 엔에이치스팩9호 | 119,735 | 252,640,850 | 0.43 | 1.32 |
| 대우SBI스팩1호 | 84,950 | 191,562,250 | 0.33 | 2.40 |
| 케이티비스팩2호 | 88,565 | 188,200,625 | 0.32 | 1.61 |
| 동부스팩3호 | 49,229 | 103,380,900 | 0.18 | 1.11 |

※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 | 27,813,240,000 | 2012-03-10 | 2017-03-10 | 대한민국 정부 | | 26.90 |
| 통안0222-1610-02 | 20,000,000,000 | 20,144,320,000 | 2014-10-02 | 2016-10-02 | 대한민국 정부 | | 19.49 |
| 국고0300-1612(13-7) | 11,000,000,000 | 11,296,406,000 | 2013-12-10 | 2016-12-10 | 대한민국 정부 | | 10.93 |
| 국고05750-1809(08-5) | 10,000,000,000 | 11,221,030,000 | 2008-09-10 | 2018-09-10 | 대한민국 정부 | | 10.85 |
| 국고02750-1803(13-1) | 10,000,000,000 | 10,297,500,000 | 2013-03-10 | 2018-03-10 | 대한민국 정부 | | 9.96 |

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

▶ 어음

해당사항 없음

▶ 집합투자증권

■ 상위 5개 종목

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 원)

| 종목 | 종류 | 자산운용사 | 설정원본 | 순자산금액 | 취득일 | 비중 |
|------------|------|------------|---------------|---------------|------------|--------|
| KODEX 레버리지 | 수익증권 | 마이더스에셋자산운용 | 1,878,475,115 | 1,929,000,000 | 2015-08-10 | 100.00 |

※ 비중 : 보유한 전체 집합투자증권 중 해당 수익증권이 차지하는 비중

마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합)

(단위 : 원)

| 종목 | 종류 | 자산운용사 | 설정원본 | 순자산금액 | 취득일 | 비중 |
|-------------|------|------------|---------------|---------------|------------|------|
| 마이더스거북이주식모 | 수익증권 | 마이더스에셋자산운용 | 1,642,161,442 | 1,642,161,442 | 2013-10-11 | 1.84 |
| 마이더스증권모(채권) | 수익증권 | 마이더스에셋자산운용 | 1,165,981,541 | 1,165,981,541 | 2013-10-10 | 1.00 |

※ 비중 : 자펀드가 해당 모펀드에서 차지하는 비중

▶ 장내파생상품

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 계약, 원)

| 종목명 | 매수/매도 | 계약수 | 미결제약정금액 | 위탁증거금 |
|-----------------|-------|-----|----------------|-------------|
| 코스피200 F 201512 | 매도 | 320 | 38,424,000,000 | |
| 코스피200 F 201512 | 매도 | 57 | 6,844,275,000 | |
| 합계 | | 377 | 45,268,275,000 | 331,945,035 |

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 |
|-------------------|----------------|------------|---------------|------|------------|----|
| REPO매수 (15100649) | 동양투자신탁 | 2015-10-06 | 9,000,357,534 | 1.45 | 2015-10-07 | |
| REPO매수 (15100626) | 한화증권 (신탁_REPO) | 2015-10-06 | 8,400,329,096 | 1.43 | 2015-10-08 | |
| 콜 2일물 1.54 | 미래에셋증권 | 2015-10-06 | 7,700,331,037 | 1.54 | 2015-10-08 | |
| REPO매수 (15100651) | 동양투자신탁 | 2015-10-06 | 3,000,119,178 | 1.45 | 2015-10-07 | |
| 예금 | KEB하나은행(하나) | | 51,735,233 | 1.15 | | |

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|----|-------------|----------|------------|------|-----|----|
| 예금 | KEB하나은행(하나) | | 95,275,226 | 1.15 | | |

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|-------------------|-------------|------------|---------------|------|------------|----|
| 콜 2일물 1.54 | 미래에셋증권 | 2015-10-06 | 9,900,425,618 | 1.54 | 2015-10-08 | |
| REPO매수 (15100634) | 동양투자신탁 | 2015-10-06 | 3,000,119,178 | 1.45 | 2015-10-07 | |
| 예금 | KEB하나은행(하나) | | 199,112,228 | 1.15 | | |

※ 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 | 2013-10-09 | 대표이사 | 9 | 17,056 | 서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이더스에셋자산운용 총괄대표 | 2109000325 |
| 오종록 | 2013-10-09 | 책임운용역 | 12 | 5,319 | 서울대학교 경제학과, 교보투신, 한누리투자증권, 이트레이드증권, 알리안츠생명보험 자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 채권운용파트장 | 2109000845 |
| 채경섭 | 2015-05-29 | 부책임운용역 | 9 | 54,703 | BASF Company.Ltd., 신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 주식운용파트 팀장 | 2109000941 |
| 정승호 | 2014-10-01 | 부책임운용역 | 12 | 54,098 | 뉴욕주립대학교(알바니) 대학원 회계학석사, CFA, AICPA, CMA/CFM, 딜로이트안진회계법인 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)

채경섭 : 없음

정승호 : 없음

▶ 운용전문인력 변경내역

| 기간 | 운용전문인력 |
|-------------------------|--------|
| 2013-10-07 ~ 현재 | 박정환 |
| 2013-10-09 ~ 2014-09-30 | 권순신 |
| 2013-10-09 ~ 현재 | 오종록 |
| 2013-10-09 ~ 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 거복이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합)

(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** | 2 | 0.00 | 2 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | 0 | 1 | 0.00 | |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | |
| | 합계 | 0 | 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** | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | 188 | 92 | 0.10 | |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | 162 | 97 | 0.11 | |
| | 합계 | 350 | 190 | 0.21 | |
| 증권거래세 | 366 | 0.31 | 203 | 0.22 | |

마이더스 거북이50 연금지축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) C

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | 3 | 0.10 | 3 | 0.10 | |
| 판매회사 | 5 | 0.20 | 5 | 0.20 | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 0 | 0.00 | 0 | 0.01 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.00 | 0 | 0.01 | |
| 보수 합계 | 8 | 0.31 | 8 | 0.31 | |
| 기타비용** | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | - | - | - | |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | |
| | 합계 | - | - | - | |
| 증권거래세 | - | - | - | - | |

마이더스 거북이50 연금지축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) Ce

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | 0 | 0.10 | 0 | 0.10 | |
| 판매회사 | 0 | 0.10 | 0 | 0.10 | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 0 | 0.00 | 0 | 0.01 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.00 | 0 | 0.01 | |
| 보수 합계 | 1 | 0.21 | 1 | 0.21 | |
| 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

마이더스 거북이50 연금지축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | - | - | 0.00 | 0.66 |
| 당기 | - | - | 0.00 | 0.46 |

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 | 1.18 | 0.00 | 1.18 |
| 당기 | 0.00 | 0.82 | 0.00 | 0.82 |

마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) C

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | 1.24 | - | 1.25 | 0.66 |
| 당기 | 1.24 | - | 1.25 | 0.46 |

마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합) Ce

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | 0.84 | - | 0.84 | 0.65 |
| 당기 | 0.84 | - | 0.84 | 0.45 |

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 |
| 1,044,346 | 48,854,845,765 | 1,940,236 | 65,211,497,030 | 100.81 | 399.95 |

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 주,원,%)

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

마이더스 거북이50 연금저축 증권 자투자신탁 1호(주식혼합)

(단위 : 주,원,%)

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

※ 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가격의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가격으로 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 : %)

| 2015-07-07 ~ 2015-10-06 | 2015-04-07 ~ 2015-07-06 | 2015-01-07 ~ 2015-04-06 |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 100.81 | 124.46 | 121.91 |