

MIDAS ASSET

마이다스에셋자산운용

자산운용보고서

마이다스 2스타 주가연동 증권투자신탁 SL-3호(ELS-파생형)

운용기간 2015.09.03 ~ 2015.12.02

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 2스타 주가연동 증권투자신탁 SL-3호(ELS-파생형)의 자산운용사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드자산보관자(신탁업자)인 '국민은행'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 2스타 주가연동 증권투자신탁 SL-3호(ELS-파생형)		A1887	
펀드의 종류	투자신탁/증권(파생형)/단위형/개방형	최초설정일	2013-06-03
운용기간	3개월(2015-09-03 ~ 2015-12-02)	존속기간	2016-07-03
자산운용사	마이다스에셋자산운용		
펀드자산보관(신탁업자)	국민은행	일반사무관리회사	SC은행 펀드서비스부
판매회사	국민은행		
상품의 특징	* 2Star 조기상환형 : 3년간 매6개월마다 조기상환 기회(만기포함 총6번) - 동 펀드는 삼성중공업 보통주와 LG디스플레이 보통주의 가격변동에 연계하여 수익이 결정되는 증권투자신탁(ELS-파생형)입니다. - 매 중간평가일(매 6개월)에 각 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 95%(6개월), 90%(12개월), 85%(18개월), 85%(24개월), 80%(30개월), 70%(36개월) 이상이면 연7.3%수준의 수익과 원금을 지급하고 조기상환되고, 조기상환이 안되고 만기에 이르렀을 경우 만기상환조건에 따라 사함됨		

- ☞ 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

▶ 재산현황

(단위 : 원, 좌/주, %)

	전기말	당기말	증감률
자산 총액	355,002,575	372,656,833	4.97
부채 총액	11,475	10,620	-7.45
순자산총액	354,991,100	372,646,213	4.97
기준가격	310.79	326.25	4.97

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.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 펀드는 삼성중공업 보통주와 LG디스플레이 보통주의 가격변동에 연계하여 수익이 결정되는 파생결합증권(ELS)을 편입하여 운용하며 수익구조는 다음과 같습니다.

- 1) 조기상환 : 매6개월(중간평가일)마다 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 95%(6개월), 90%(12개월), 85%(18개월), 85%(24개월), 80%(30개월)이상이면 연7.3%수준의 수익과 함께 조기상환
- 2) 조기상환되지 못하고 만기(36개월)에 이르렀을 경우
 - ㉠ 두 기초자산 모두 최초기준가격의 70%이상인 경우: 연 7.3%수준의 수익지급
 - ㉡ 두 기초자산 중 하나라도 최초기준가격의 70%미만인 경우 : 만기시점에서 최초기준가격대비 하락률이 큰 기초자산의 하락률만큼 원금 손실 발생 (최대가능손실률: -100%)

동 펀드의 최초기준가격은 삼성중공업 보통주와 LG디스플레이 보통주가 각각 35,716원, 31,366원이었습니다. 운용보고서 작성 기준일인 2015년 12월 2일 현재 삼성중공업 보통주와 LG디스플레이 보통주는 각각 11,550원, 25,000원으로 최초기준가격 대비 수익률은 각각 -67.66%, -20.30%입니다.

동 펀드의 기초자산 중 삼성중공업이 2015년 1월 5일 증가기준으로 KI(Knock-In)수준인 19,643.80원을 하회함에 따라, 동 펀드의 잔여 중간평가일과 만기평가일에 조기상환을 충족하지 못할 경우 원금손실 가능성이 발생하게 되었습니다. 비록 만기시 투자원금손실이 발생할 수 있는 조건인 KI(Knock-In)이 발생했다고 하여, 만기시 동 펀드가 반드시 원금손실이 되는 것은 아니라, 잔여 중간평가일과 만기평가일에 동 펀드의 조기상환조건을 충족시에는 KI 발생여부와 상관없이 연7.3% 수준으로 조기상환되게 됩니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

향후 만기 상환 평가기회가 남아있으며, 상환조건은 다음과 같습니다.

-제6차(만기) 평가일: 2016. 06. 03, 07, 08 중가의 산술평균, 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 70%이상

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년	설정일
마이더스 2스타 주가연동 증권투자신탁 SL-3호(ELS-파생형)	-13.96	4.97	-38.43	-47.68	-50.44	-61.48	-	-	-67.38
비교지수	-	-	-	-	-	-	-	-	-

비교지수(Benchmark) = 없음

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

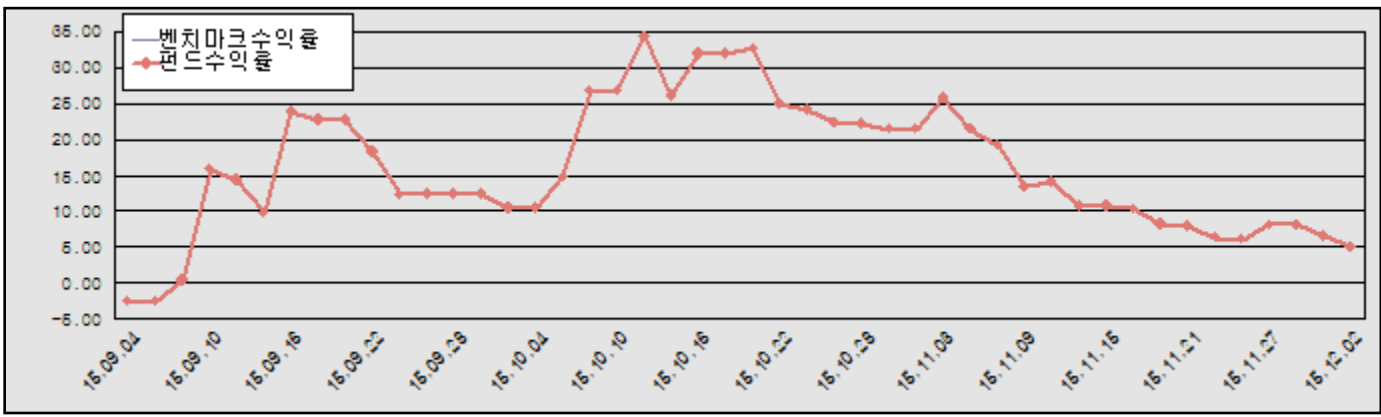
▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이더스 2스타 주가연동 증권투자신탁 SL-3호(ELS-파생형)	-50.44	-37.94	-	-
비교지수	-	-	-	-

비교지수(Benchmark) = 없음

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



비교지수(Benchmark) = 없음

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

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	-	-	-	-	-	18	-	-	-	0	0	18
전기손익	-	-	-	-	-	-813	-	-	-	0	1	-812

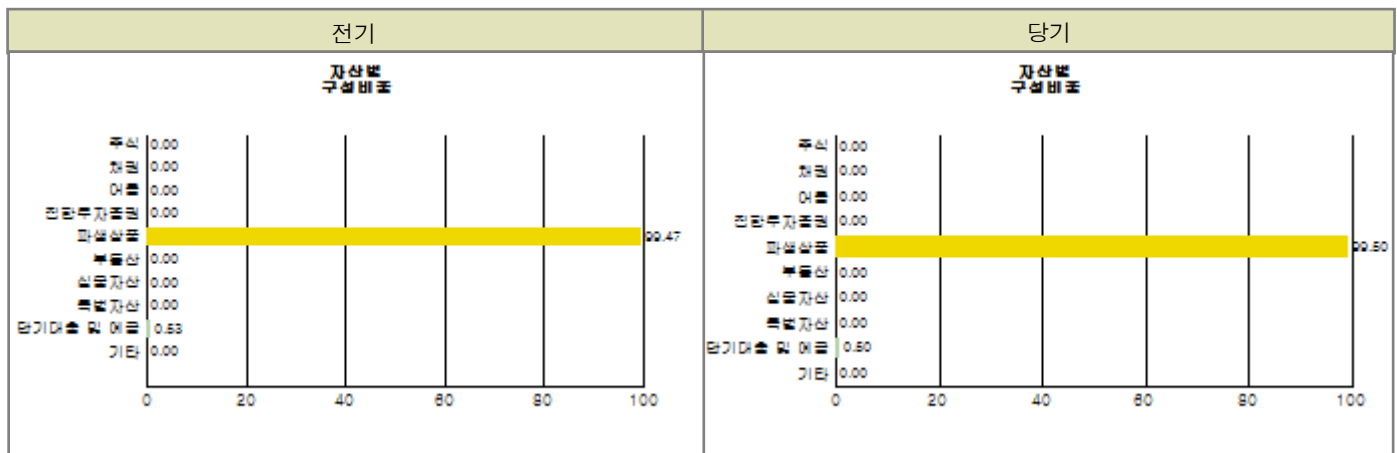
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음 및 기타증권	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
원화	-	-	-	-	-	371 (99.50)	-	-	-	2 (0.50)	-	373 (100.00)
합계	-	-	-	-	-	371 (99.50)	-	-	-	2 (0.50)	-	373 (100.00)

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



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	파생결합증권 대우증권(ELS)9485	26.17	2	파생결합증권 한국투자(ELS)3335	26.16
3	파생결합증권 현대증권(ELS)13-2924	26.15	4	파생결합증권 대신증권(ELS)3439	21.02
5	단기대출및예금 예금	0.50			

※ 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

해당사항 없음

▶ 채권

해당사항 없음

▶ 어음

해당사항 없음

▶ 집합투자증권

해당사항 없음

▶ 장내파생상품

해당사항 없음

▶ 장외파생상품

(단위 : 원)

종류	기초자산	구분	계약금액	평가금액	
거래상대방	만기일		취득가격	비고	
한국투자(ELS)3335		매수		97,485,274	
한국투자증권	2016-06-10		299,901,015		
현대증권(ELS)13-2924		매수		97,442,800	
현대증권	2016-06-10		299,901,015		
대우증권(ELS)9485		매수		97,518,040	
대우증권	2016-06-10		299,901,015		
대신증권(ELS)3439		매수		78,346,413	
대신증권	2016-06-10		241,124,805		
합계				370,792,527	
			1,140,827,850		

주) 개별계약 등의 위험평가액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

주) 상기 "비고"란의 등급 표시는 거래상대방의 신용등급입니다.

▶ 부동산(임대)

해당사항 없음

▶ 부동산(자금대여 및 차입)

해당사항 없음

▶ 특별자산

해당사항 없음

▶ 유동성

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
예금	국민은행		1,864,306	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		
박정환		운용역	54	225,184	서울대학교 대학원 경영학과 (경영학 석사) 제일경제연구소 연구소, 국민투자신탁, 현대투신운용, SK투신운용, 아이투신운용, 한국투신운용 채권운용팀 現 마이다스에셋 자산운용(주) 채권운용본부장	03-02002-0026

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말합니다.

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

(단위 : 백만원,%)

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

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매, 중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매, 중개수수료 비율
전기	0.02	-	0.02	-
당기	0.02	-	0.02	-

- 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

(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

해당사항 없음