

MIDAS ASSET

마이다스에셋자산운용

자산운용보고서

마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)

운용기간 2015.10.01 ~ 2015.12.30

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 70 증권 자투자신탁 1호(주식)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 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식) | | AL006 | |
| 마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호A(주식) | | AL007 | |
| 마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호Ae(주식) | | AL009 | |
| 마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호C2(주식) | | AL196 | |
| 마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호C3(주식) | | AL197 | |
| 마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호Ce(주식) | | AL010 | |
| 펀드의 종류 | 투자신탁/증권(주식형)/추가형/개방형/종류형/모자형 | 최초설정일 | 2013-10-01 |
| 운용기간 | 3개월(2015-10-01 ~ 2015-12-30) | 존속기간 | 추가형 |
| 자산운용사 | 마이다스에셋자산운용 | | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | KEB하나은행(하나) | 일반사무관리회사 | SC은행 펀드서비스부 |
| 판매회사 | KEB하나은행(하나) 스탠다드차타드은행 한국씨티은행 삼성증권 삼성생명 펀드온라인코리아 키움증권 | | |
| 상품의 특징 | 본 상품은 혼합형 펀드로서 주식에 70%~80%, 채권등에 30% 이하를 투자하고 있습니다. KOSPI등락률7%+매경BP 종합채권지수 1~2년물 수익률 93%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) ** | 1.42 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) (KR5303A92901) ** | 4.80 |

수익증권 매입

마이더스 거북이 70 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(%)*** | 71.28 | - | 28.72 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

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

▶ 재산현황

(단위 : 원, 좌/주. %)

| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-----------------------------|---------------|---------------|--------|
| 자산 총액 | 5,803,619,838 | 5,243,991,181 | -9.64 |
| 부채 총액 | 4,055,216 | 1,782,000 | -56.06 |
| 순자산총액 | 5,799,564,622 | 5,242,209,181 | -9.61 |
| 기준가격 | 1,082.32 | 1,083.17 | 0.08 |

(단위 : 원, 좌/주. %)

| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-------------------|-----------------|-----------------|-----------|
| 자산 총액 | 116,487,072,473 | 104,001,675,472 | -10.72 |
| 부채 총액 | 2,763,340 | 1,052,272,374 | 37,979.73 |
| 순자산총액 | 116,484,309,133 | 102,949,403,098 | -11.62 |
| 기준가격 | 1,020.33 | 1,023.36 | 0.30 |

(단위 : 원, 좌/주. %)

| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-----------------------|----------------|----------------|-----------|
| 자산 총액 | 88,621,678,700 | 79,465,584,863 | -10.33 |
| 부채 총액 | -67,132,773 | 1,382,995,225 | -2,160.09 |
| 순자산총액 | 88,688,811,473 | 78,082,589,638 | -11.96 |
| 기준가격 | 1,028.67 | 1,028.31 | -0.03 |

(단위 : 원. %)

| 종류(Class)별 기준가격 현황 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|-------------------------------|----------|----------|-------|
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호A(주식) | 1,005.91 | 997.46 | -0.84 |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호Ae(주식) | 1,009.62 | 998.36 | -1.12 |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호C2(주식) | 1,006.01 | 996.47 | -0.95 |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호C3(주식) | - | 1,002.30 | - |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호Ce(주식) | 1,007.93 | 997.95 | -0.99 |

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, 재투자기준가격은 클래스 A(1000.00) 클래스 Ae(1000.00) 입니다.

※ 분배금내역

거북70증권자1A(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북70증권자1Ae-주식

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북70증권자1C2(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북70증권자1C3(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북70증권자1Ce(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

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

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

12월 30일 기준, 3개월 펀드수익률은 -0.25%(클래스 A 기준)로 비교지수 대비 -0.51%포인트 낮은 수익률을 기록했습니다. 주식모펀드에서 펀더멘털 룩아웃전략과 스펙 등의 공모주 참여로부터 손실이 발생하여 주식모펀드 기준, 약 -0.04%의 손실이 발생했습니다. 같은 기간, KOSPI가 1.21% 상승한 가운데 건설업, 통신업, 비금속광물제품 등의 성과가 부진했습니다. 펀드 내 편입비중이 높은 전기전자, 서비스업, 화학 등의 업종의 성과가 양호하였지만, 주가가 상승함에 따라 주식 숏(Short) 포지션에서의 성과가 더욱 부진하여 전체 펀드성과에 부정적으로 작용하였습니다. 종목별로는 한미약품, SK이노베이션, NAVER 등의 성과가 우수하였던 반면, 엠지메드, 현대산업, 한전KPS 등은 성과가 부진하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

12월 KOSPI는 지난 달 대비 1.54%, KOSDAQ은 0.88% 하락하였습니다. 시장의 예상과 달리ECB의 추가 양적완화 발표가 무산되자 투자심리가 악화되며 증시는 월초 약세를 보였습니다. 이후, 국제 유가급락과 美 연준의 기준금리 인상에 대한 부담감으로 외국인의 매도세가 지속되며 지수 상승을 방해하였습니다. 그러나 월 중순 이후 연말 배당수익을 겨냥한 연기금 및 기관의 매수세가 지수의 추가하락을 저지하며 마감하였습니다. 업종별로는 음식료, 보험, 화학, 유틸리티 업종의 주가가 상승한 반면, 건설, 은행, 통신업종은 큰 폭의 하락세를 보였습니다. 향후 시장은 美 금리의 추가인상 속도에 대한 불확실성과 상품가격의 불안정성에 따라 변동성이 확대될 수 있는 국면으로 예상됩니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 1개월 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 | 설정일 |
|------------------------------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식) | 0.63 | 0.08 | -1.58 | 1.55 | 2.30 | 5.89 | - | - | 8.32 |
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 0.31 | 0.30 | 0.96 | 1.48 | 2.46 | 6.26 | 9.34 | 17.71 | 52.50 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 0.74 | -0.03 | -2.63 | 1.56 | 2.20 | 5.58 | 19.18 | - | 32.74 |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호A(주식) | 0.52 | -0.25 | -2.24 | 0.53 | 0.94 | 3.10 | - | - | 5.12 |

| | | | | | | | | | |
|-------------------------------|------|-------|-------|------|------|------|---|---|------|
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호Ae(주식) | 0.55 | -0.16 | -2.06 | 0.81 | 1.31 | - | - | - | 3.44 |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호C2(주식) | 0.49 | -0.35 | -2.44 | 0.23 | 0.54 | - | - | - | 0.25 |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호C3(주식) | 0.50 | - | - | - | - | - | - | - | 0.23 |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호Ce(주식) | 0.53 | -0.20 | -2.14 | 0.69 | 1.14 | - | - | - | 2.57 |
| 비교지수 | 0.21 | 0.26 | 0.50 | 1.16 | 2.56 | 5.79 | - | - | 6.58 |

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

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

▶ 연평균 수익률

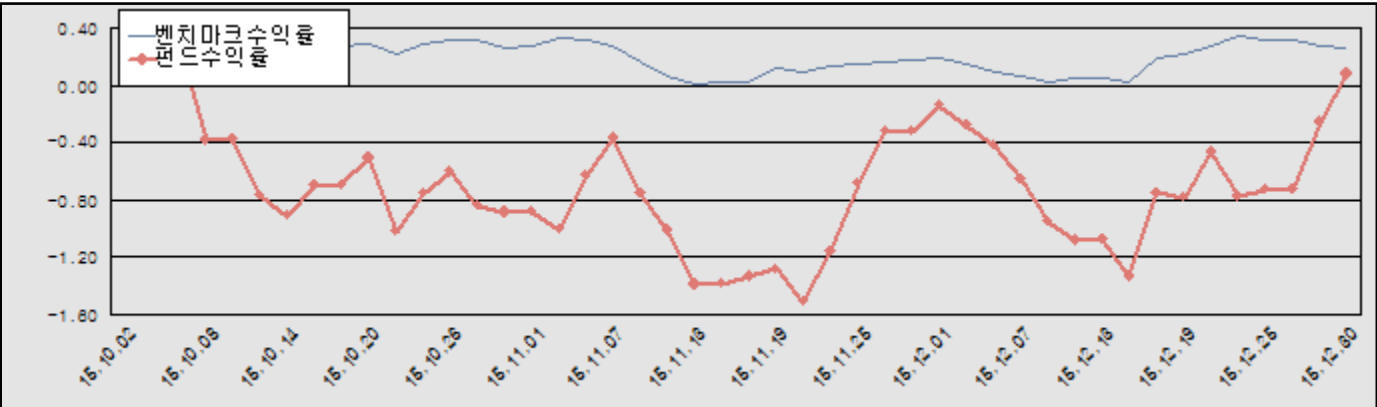
(단위 : %)

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|-------------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식) | 2.30 | 2.90 | - | - |
| 마이더스 증권 모투자신탁(채권) | 2.46 | 3.08 | 3.02 | 3.31 |
| 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) | 2.20 | 2.75 | 6.02 | - |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호A(주식) | 0.94 | 1.54 | - | - |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호Ae(주식) | 1.31 | - | - | - |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호C2(주식) | 0.54 | - | - | - |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호C3(주식) | - | - | - | - |
| 마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호Ce(주식) | 1.14 | - | - | - |
| 비교지수 | 2.56 | 2.86 | - | - |

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

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

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)



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

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

▶ 손익현황

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)

(단위 : 백만원)

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|------|----|----|----|--------|------|----|-----|------|----|-----------|----|------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | - | - | - | 1 | - | - | - | - | - | 0 | 0 | 1 |
| 전기손익 | - | - | - | -97 | - | - | - | - | - | 0 | 0 | -97 |

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 | - | 282 | 18 | - | - | - | - | - | - | 6 | -2 | 304 |
| 전기손익 | - | 695 | 30 | - | - | - | - | - | - | 31 | -2 | 754 |

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|------|--------|----|----|---------|-------|----|-----|------|----|-----------|------|--------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | -584 | - | 44 | 538 | -911 | - | - | - | - | 9 | 757 | -147 |
| 전기손익 | -5,799 | - | 72 | -5 | 3,540 | - | - | - | - | 28 | -205 | -2,369 |

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

마이더스 거북이 70 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 | - | - | - | 5,213 (99.41) | - | - | - | - | - | 14 (0.27) | 17 (0.32) | 5,244 (100.00) |
| 합계 | - | - | - | 5,213 (99.41) | - | - | - | - | - | 14 (0.27) | 17 (0.32) | 5,244 (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 | - | 98,295 (94.51) | - | - | - | - | - | - | - | 5,707 (5.49) | - | 104,002 (100.00) |
| 합계 | - | 98,295 (94.51) | - | - | - | - | - | - | - | 5,707 (5.49) | - | 104,002 (100.00) |

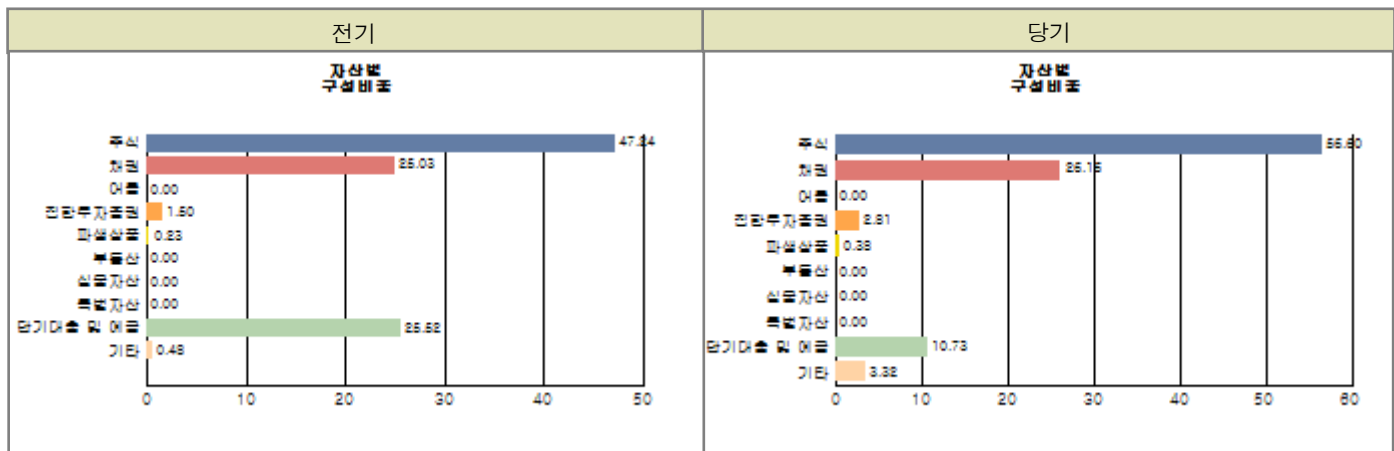
※ ()내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.

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 | 63,110 (79.40) | - | - | 3,139 (3.95) | 428 (0.53) | - | - | - | - | 10,268 (12.92) | 3,697 (4.65) | 80,642 (101.45) |
| 합계 | 63,110 (79.40) | - | - | 3,139 (3.95) | 428 (0.53) | - | - | - | - | 10,268 (12.92) | 3,697 (4.65) | 80,642 (101.45) |

※ ()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.

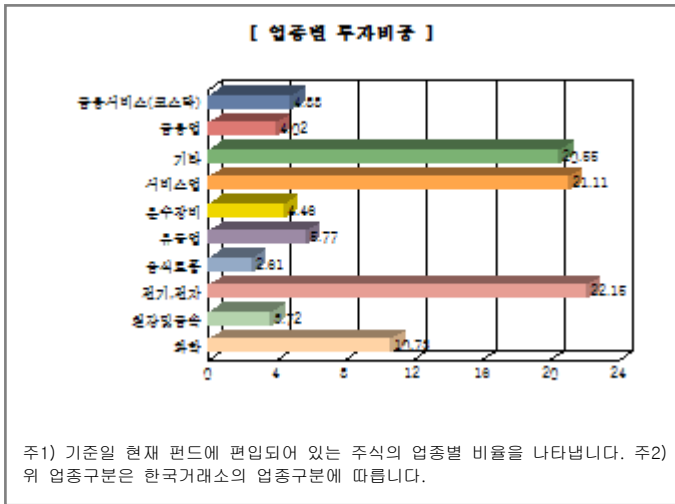
▶ 업종별, 국가별 투자비중

| 종 목 | 비 중(%) | 종 목 | 비 중(%) |
|--------|--------|--------|--------|
| 삼성전자 | 19.50 | 아모레퍼시픽 | 3.94 |
| SK | 3.82 | CJ CGV | 3.15 |
| 엔씨소프트 | 2.50 | 삼성물산 | 2.44 |
| 아모레G | 2.35 | LG생활건강 | 2.16 |
| CJ제일제당 | 2.09 | NAVER | 2.09 |

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

| 종 목 | 비 중(%) | 종 목 | 비 중(%) |
|------------|--------|-------|--------|
| 전기, 전자 | 22.15 | 서비스업 | 21.11 |
| 화학 | 10.73 | 유통업 | 5.77 |
| 금융서비스(코스닥) | 4.88 | 운수장비 | 4.46 |
| 금융업 | 4.02 | 철강및금속 | 3.72 |
| 음식료품 | 2.61 | 기타 | 20.55 |

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중



▶ 투자대상 상위 10종목

| 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 종목명 | 비중 | | |
|----|--------|-----------------|-------|-----|---------|-------------------|-------|
| 1 | 주식 | 삼성전자 | 15.48 | 2 | 단기대출및예금 | REPO매수 (15123048) | 12.71 |
| 3 | 집합투자증권 | KODEX 코스닥150 레버 | 3.95 | 4 | 주식 | 아모레퍼시픽 | 3.13 |
| 5 | 주식 | SK | 3.04 | 6 | 주식 | CJ CGV | 2.50 |
| 7 | 주식 | 엔씨소프트 | 1.98 | 8 | 주식 | 삼성물산 | 1.94 |
| 9 | 주식 | 아모레G | 1.86 | 10 | 주식 | LG생활건강 | 1.72 |

※ 비중 : 펀드내 순자산 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

| 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 종목명 | 비중 | | |
|----|-----|--------------------|-------|-----|---------|--------------------|-------|
| 1 | 채권 | 국고02750-1706(14-3) | 29.35 | 2 | 채권 | 국고03500-1703(12-1) | 27.80 |
| 3 | 채권 | 통안0171-1704-02 | 19.33 | 4 | 채권 | 국고02000-2003(15-1) | 9.76 |
| 5 | 채권 | 산금15신이106-1126-3 | 5.79 | 6 | 단기대출및예금 | REPO매수 (15123009) | 5.38 |
| 7 | 채권 | 대구도시공사보상1411 | 1.40 | 8 | 채권 | 국고03500-1609(11-5) | 0.69 |
| 9 | 채권 | 국민주택1종13-11 | 0.31 | 10 | 단기대출및예금 | 예금 | 0.10 |

※ 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 | 9,766 | 12,305,160,000 | 19.50 |
| 아모레퍼시픽 | 6,000 | 2,487,000,000 | 3.94 |
| SK | 10,030 | 2,412,215,000 | 3.82 |
| CJ CGV | 15,767 | 1,986,642,000 | 3.15 |
| 엔씨소프트 | 7,400 | 1,576,200,000 | 2.50 |

* 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 ※※ |
|------------|---------|-------------|------|-------|
| 대신밸런스제2호스팩 | 265,168 | 530,336,000 | 0.84 | 2.50 |
| SK1호스팩 | 152,141 | 308,846,230 | 0.49 | 2.77 |
| 엔에이치스팩9호 | 119,735 | 238,871,325 | 0.38 | 1.32 |
| 하나금융7호스팩 | 106,726 | 216,120,150 | 0.34 | 1.33 |
| 동부제4호스팩 | 77,085 | 202,733,550 | 0.32 | 1.45 |
| 케이티비스팩2호 | 88,565 | 178,015,650 | 0.28 | 1.61 |
| 대우SB1스팩1호 | 84,950 | 174,147,500 | 0.28 | 2.40 |
| 동부스팩3호 | 49,229 | 98,704,145 | 0.16 | 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 |
|--------------------|----------------|----------------|------------|------------|---------|------|-------|
| 국고02750-1706(14-3) | 30,000,000,000 | 30,519,900,000 | 2014-06-10 | 2017-06-10 | 대한민국 정부 | | 31.05 |
| 국고03500-1703(12-1) | 28,000,000,000 | 28,915,936,000 | 2012-03-10 | 2017-03-10 | 대한민국 정부 | | 29.42 |
| 통안0171-1704-02 | 20,000,000,000 | 20,101,640,000 | 2015-04-02 | 2017-04-02 | 대한민국 정부 | | 20.45 |
| 국고02000-2003(15-1) | 10,000,000,000 | 10,147,000,000 | 2015-03-10 | 2020-03-10 | 대한민국 정부 | | 10.32 |
| 산금15신이106-1126-3 | 6,000,000,000 | 6,021,690,000 | 2015-11-26 | 2017-05-26 | | AAA | 6.13 |

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

▶ 어음

해당사항 없음

▶ 집합투자증권

■ 상위 5개 종목

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)

(단위 : 원)

| 종목 | 종류 | 자산운용사 | 설정원본 | 순자산금액 | 취득일 | 비중 |
|-------------|------|------------|---------------|---------------|------------|------|
| 마이더스거북이주식모 | 수익증권 | 마이더스에셋자산운용 | 3,747,463,677 | 3,746,768,037 | 2013-10-01 | 4.80 |
| 마이더스증권모(채권) | 수익증권 | 마이더스에셋자산운용 | 1,461,889,396 | 1,466,230,660 | 2013-10-01 | 1.42 |

* 비중 : 자펀드가 해당 모펀드에서 차지하는 비중

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 원)

| 종목 | 종류 | 자산운용사 | 설정원본 | 순자산금액 | 취득일 | 비중 |
|----|----|-------|------|-------|-----|----|
|----|----|-------|------|-------|-----|----|

※ 비중 : 보유한 전체 집합투자증권 중 해당 수익증권이 차지하는 비중

▶ 장내파생상품

마이다스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 계약, 원)

| 종목명 | 매수/매도 | 계약수 | 미결제약정금액 | 위탁증거금 |
|-----------------|-------|-----|----------------|-----------|
| 코스피200 F 201603 | 매도 | 320 | 38,472,000,000 | |
| 코스피200 F 201603 | 매도 | 117 | 14,066,325,000 | |
| 합계 | | 437 | 52,538,325,000 | 1,144,605 |

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

마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|----|-------------|----------|------------|------|-----|----|
| 예금 | KEB하나은행(하나) | | 13,992,484 | 1.15 | | |

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이다스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|-------------------|-------------|------------|----------------|------|------------|----|
| REPO매수 (15123048) | 동양투자신탁 | 2015-12-30 | 10,100,426,136 | 1.54 | 2015-12-31 | |
| 예금 | KEB하나은행(하나) | | 167,344,711 | 1.15 | | |

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이다스 증권 모투자신탁(채권)

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|-------------------|-------------|------------|---------------|------|------------|----|
| REPO매수 (15123009) | 삼성증권 | 2015-12-30 | 5,600,233,205 | 1.52 | 2015-12-31 | |
| 예금 | KEB하나은행(하나) | | 106,605,427 | 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 | 8 | 5,637 | 서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이다스에셋자산운용 총괄대표 | 2109000325 |

| | | | | | | |
|-----|------------|--------|----|--------|--|------------|
| 오종록 | 2013-10-09 | 책임운영역 | 12 | 5,266 | 서울대학교 경제학과, 교보투신, 한누리투자증권, 이트레이드증권, 알리안 츠생명보험 자산운용, 現 마이다스에셋자산운용 채권운용파트장 | 2109000845 |
| 채경섭 | 2015-05-29 | 부책임운영역 | 9 | 82,109 | BASF Company.Ltd., 신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이다스에셋자산운용 주식운용파트 팀장 | 2109000941 |
| 정승호 | 2014-10-01 | 부책임운영역 | 12 | 81,664 | 뉴욕주립대학교(알바니) 대학원 회계학석사, CFA, AICPA, CMA/CFM, 딜로이트안진회계법인 리서치, GS자산운용 채권운용팀, 現 마이다스에셋자산운용 채권운용파트 부장 | 2110000746 |

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운영전문인력이며, '책임운영전문인력'이란 운영전문인력 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 |
|-------------------------|--------|
| 2013-10-01 ~ 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

마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)

(단위 : 백만원,%)

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

마이다스 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 | 1 | 0.00 | 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** | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | 98 | 0.11 | 41 | 0.05 |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | 100 | 0.11 | 54 | 0.06 |
| | 합계 | 198 | 0.21 | 95 | 0.11 |
| 증권거래세 | 209 | 0.23 | 93 | 0.11 | |

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호A(주식)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | 7 | 0.15 | 6 | 0.15 | |
| 판매회사 | 8 | 0.18 | 7 | 0.17 | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| 보수 합계 | 16 | 0.34 | 13 | 0.33 | |
| 기타비용** | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | - | - | - | - |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | - |
| | 합계 | - | - | - | - |
| 증권거래세 | - | - | - | - | |

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호Ae(주식)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | 0 | 0.15 | 0 | 0.15 | |
| 판매회사 | 0 | 0.09 | 0 | 0.09 | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 보수 합계 | 0 | 0.25 | 0 | 0.24 | |
| 기타비용** | - | - | - | - | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | - | - | - | - |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | - |
| | 합계 | - | - | - | - |
| 증권거래세 | - | - | - | - | |

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호C2(주식)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | 2 | 0.15 | 2 | 0.15 | |
| 판매회사 | 4 | 0.28 | 3 | 0.27 | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| 보수 합계 | 6 | 0.44 | 5 | 0.43 | |
| 기타비용** | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 매매 중개 수수료 | 단순매매/중개수수료 | - | - | - | - |
| | 조사분석업무 등 서비스수수료 | - | - | - | - |
| | 합계 | - | - | - | - |
| 증권거래세 | - | - | - | - | |

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호C3(주식)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | - | - | 0 | 0.09 | |
| 판매회사 | - | - | 0 | 0.13 | |
| 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 70 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|-----------------|-----------------|--------|----|--------|----|
| | 금액 | 비율(%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | 0 | 0.15 | 1 | 0.15 | |
| 판매회사 | 0 | 0.13 | 0 | 0.12 | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| 보수 합계 | 1 | 0.29 | 1 | 0.28 | |
| 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 거북이 70 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 | - | 0.62 |
| 당기 | - | - | 0.00 | 0.32 |

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 | 0.85 | 0.00 | 0.85 |
| 당기 | 0.00 | 0.45 | 0.00 | 0.45 |

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호A(주식)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | 1.34 | - | 1.33 | 0.63 |
| 당기 | 1.34 | - | 1.34 | 0.32 |

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호Ae(주식)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | 0.98 | - | 0.95 | 0.59 |
| 당기 | 0.98 | - | 0.98 | 0.32 |

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호C2(주식)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | 1.74 | - | 1.72 | 0.61 |
| 당기 | 1.74 | - | 1.74 | 0.32 |

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호C3(주식)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | - | - | - | - |
| 당기 | 1.54 | - | 1.54 | 0.29 |

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)

(단위 : 연환산, %)

| 구분 | 해당 펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|----|----------|-------------|-------------|-------------|
| | 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 | 합성 총보수,비용비율 | 매매,중개수수료 비율 |
| 전기 | 1.14 | - | 1.11 | 0.52 |
| 당기 | 1.14 | - | 1.14 | 0.32 |

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 모투자신탁(주식)

(단위 : 주,원,%)

| 매수 | | 매도 | | 매매회전율 | |
|---------|----------------|---------|----------------|-------|--------|
| 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 3개월 | 연환산 |
| 676,443 | 34,181,520,665 | 558,449 | 31,044,749,180 | 44.98 | 180.43 |

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 주,원,%)

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

마이더스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)

(단위 : 주,원,%)

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

* 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 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 : %)

| 2015-10-01 ~ 2015-12-30 | 2015-07-01 ~ 2015-09-30 | 2015-04-01 ~ 2015-06-30 |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 44.98 | 102.09 | 122.27 |