

MIDAS ASSET

마이다스에셋자산운용

자산운용보고서

마이다스 2스타 주가연동 증권투자신탁 SL-2호(ELS-파생형)

운용기간 2015.11.26 ~ 2016.02.25

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-2호(ELS-파생형)의 자산운용사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드자산보관자(신탁업자)인 '한국씨티은행'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-2호(ELS-파생형)		AF785	
펀드의 종류	투자신탁/증권(파생형)/단위형/개방형	최초설정일	2013-02-18
운용기간	3개월(2015-11-26 ~ 2016-02-25)	존속기간	2016-02-26
자산운용사	마이다스에셋자산운용		
펀드자산보관(신탁업자)	한국씨티은행	일반사무관리회사	SC은행 펀드서비스부
판매회사	국민은행		
상품의 특징	* 2Star 조기상환형 : 3년간 매6개월마다 조기상환 기회(만기포함 총6번) - 동 펀드는 삼성전자 보통주와 LG화학 보통주의 가격변동에 연계하여 수익이 결정되는 증권투자신탁(ELS-파생형)입니다. - 매 중간평가일(매 6개월)에 각 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 90%(6개월), 90%(12개월), 85%(18개월), 85%(24개월), 80%(30개월), 70%(36개월) 이상이면 연8%수준의 수익과 원금을 지급하고 조기상환되고, 조기상환이 안되고 만기에 이르렀을 경우 만기상환조건에 따라 상환됨.		

- ☞ 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	8,236,560,003	7,701,922,293	-6.49
부채 총액	158,057,787	39,376	-99.98
순자산총액	8,078,502,216	7,701,882,917	-4.66
기준가격	1,219.32	1,255.56	2.97

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.

주) 위 당기말 기준가격은 결산부기준가격이며, 재투자기준가격은 펀드(1000.00)입니다.

※ 분배금내역

(단위 : 백만원, 좌)

분배금 기준일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
2016-02-17	88	6,134,221,891	1,269.57	1,255.06	
2016-02-25	0	6,134,221,891	1,255.56	1,000.00	

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

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

1) 조기상환 : 매6개월(중간평가일)마다 두 기초자산의 가격이 모두 최초기준가격의 90%(6개월), 90%(12개월), 85%(18개월), 85%(24개월), 80%(30개월)이상이면 연8%수준의 수익과 함께 조기상환

2) 조기상환되지 못하고 만기(36개월)에 이르렀을 경우

② 두 기초자산 모두 최초기준가격의 70%이상인 경우: 연 8%수준의 수익지급

③ 두 기초자산 중 하나라도 최초기준가격의 70%미만인 경우 : 만기시점에서 최초기준가격대비 하락률이 큰 기초자산의 하락률만큼 원금 손실

▶ 투자환경 및 운용계획

만기상환평가일인 2016년 2월 19, 22, 23일 종가의 평균은 1,182,000.00원, 302,166.67원으로써, 만기상환조건(최초기준가격의 70%: 1,069,600.00원, 208,366.20원 이상)을 충족함에 따라, 2016년 2월 26일 만기상환금을 지급하고 동 펀드는 해지되었음을 알려드립니다. 감사합니다.

▶ 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-2호(ELS-파생형)	0.26	4.16	47.83	15.00	36.94	31.46	26.95	-	27.01
비교지수	-	-	-	-	-	-	-	-	-

비교지수(Benchmark) = 없음

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

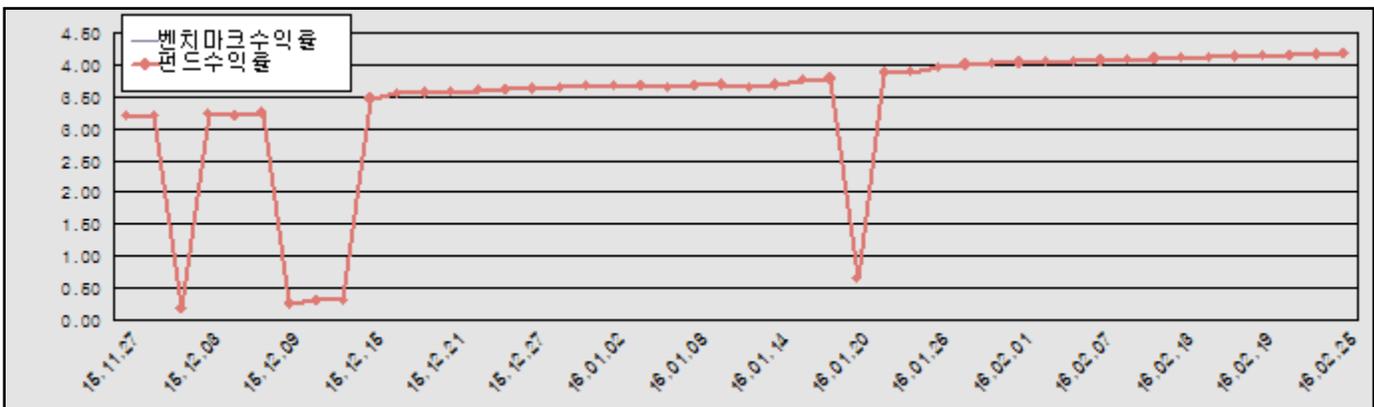
▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이더스 2스타 주가연동 증권투자신탁 SL-2호(ELS-파생형)	36.94	14.66	8.28	-
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	-	-	-	-	-	1,833	-	-	-	0	25	1,858
전기손익	-	-	-	-	-	2,836	-	-	-	0	51	2,887

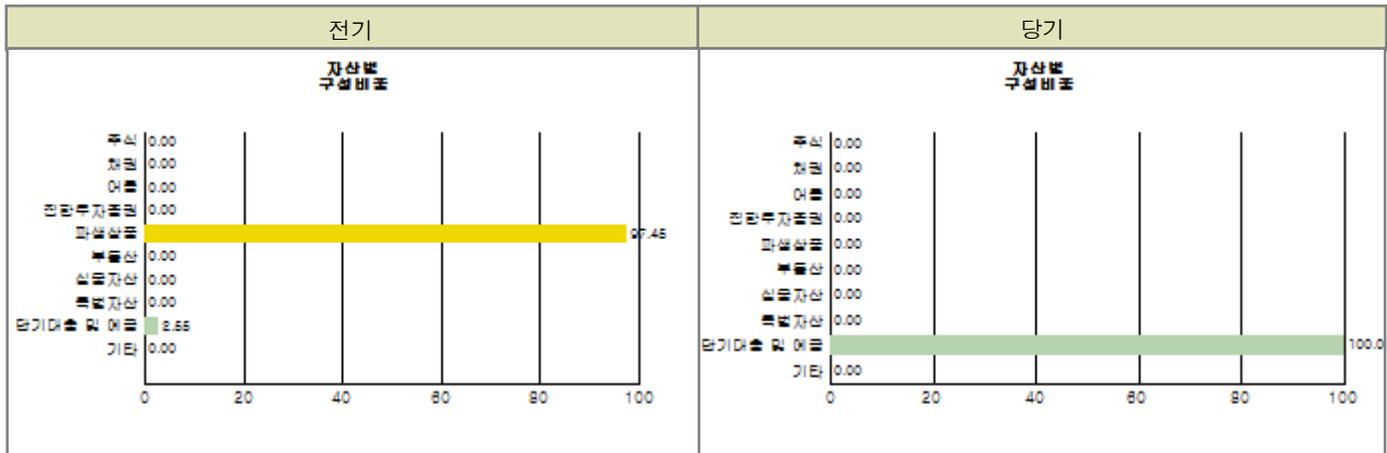
3. 자산현황

▶ 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	7,702 (100.00)	-	7,702 (100.00)
합계	-	-	-	-	-	-	-	-	-	7,702 (100.00)	-	7,702 (100.00)

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



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	단기대출및예금	예금			100.00

※ 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

해당사항 없음

▶ 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	한국씨티은행		7,701,922,293	1.15		

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ 기타

해당사항 없음

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 운용전문인력

(단위 : 개, 백만원)

성명	운용개시일	직위	운용종인 다른 퍼드 현황		주요 경력 및 운용내역(최근5년)	협회등록번호
			펀드 수	운용 규모		
박정환		운용역	50	214,909	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	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	0	0.00	-	-
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	-
	합계	0	0.00	-	-
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	0.01	0.00	0.01	0.00
당기	0.01	-	0.01	-

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 회전을율

(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 매매회전을율 추이

해당사항 없음