

MIDAS ASSET

마이다스에셋자산운용

자산운용보고서

마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)

운용기간 2016.01.02 ~ 2016.04.01

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 거북이 90 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 90 증권 자투자신탁 1호(주식)		AL420	
마이다스 거북이 90증권 자투자신탁 1호A(주식)		AL421	
마이다스 거북이 90증권 자투자신탁 1호Ae(주식)		AL426	
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C1(주식)		AL422	
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C2(주식)		AL423	
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C3(주식)		AL424	
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)		AL427	
마이다스 거북이90 증권 자투자신탁 1호C-W(주식)		AN413	
펀드의 종류	투자신탁/증권(주식형)/추가형/개방형/종류형/모자형	최초설정일	2013-10-02
운용기간	3개월(2016-01-02 ~ 2016-04-01)	존속기간	추가형
자산운용사	마이다스에셋자산운용		
펀드재산보관(신탁업자)	KEB하나은행(하나)	일반사무관리회사	SC은행 펀드서비스부
판매회사	KEB하나은행(하나) 삼성증권 한국씨티은행 삼성생명 한화투자증권 우리투자증권 KB투자증권 하나금융투자 한국투자증권 키움증권 대우증권 신한금융투자 대신증권 현대증권 KEB하나은행(외환) 교보증권 동부증권 신영증권 교보생명보험주식회사		
상품의 특징	본 상품은 주식형 펀드로서 주식형 모투자신탁(마이다스 거북이 증권 모투자신탁(주식))에 80%이상, 채권형 모투자신탁(마이다스 증권 모투자신탁(채권))에 20% 이하를 투자하고 있습니다. KOSPI19%+매경BP 종합채권지수 1~2년물 91%를 벤치마크로 하여 벤치마크대비 초과성적을 목표로 하고 있으며, 롱숏 전략, 이벤트 드리븐 등 다양한 절대수익 추구전략을 복합적으로 활용합니다. 투자 본 상품은 자산의 80%이상 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

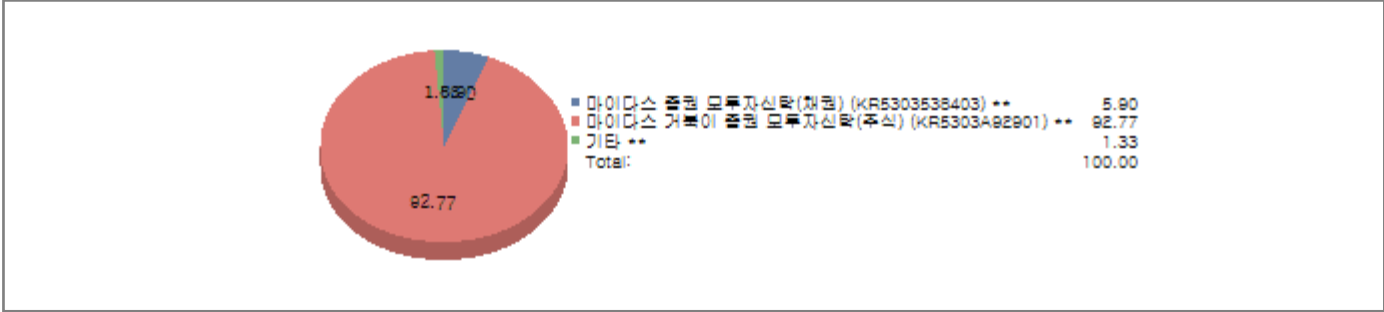
주된 투자대상

실제투자

모펀드	비중 (%)*
마이더스 증권 모투자신탁(채권) (KR5303538403) **	2.38
마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) (KR5303A92901) **	55.81

수익증권 매입

마이더스 거북이 90 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(%)***													
		65.44	-	33.42	-	-	-	-	-	-	1.14	-	-	-	-

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

▶ 재산현황

(단위 : 원, 좌/주, %)

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)	전기말	당기말	증감률
자산 총액	50,244,427,222	40,739,482,186	-18.92
부채 총액	34,384,726	4,175,510	-87.86
순자산총액	50,210,042,496	40,735,306,676	-18.87
기준가격	1,081.09	1,065.64	-1.43

(단위 : 원, 좌/주, %)

마이더스 증권 모투자신탁(채권)	전기말	당기말	증감률
자산 총액	102,978,458,032	101,183,469,327	-1.74
부채 총액	19,826,582	154,067,850	677.08
순자산총액	102,958,631,450	101,029,401,477	-1.87
기준가격	1,023.45	1,005.99	-1.71

(단위 : 원, 좌/주, %)

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)	전기말	당기말	증감률
자산 총액	79,466,494,379	65,209,306,526	-17.94
부채 총액	1,383,082,875	-2,496,385,808	-280.49
순자산총액	78,083,411,504	67,705,692,334	-13.29
기준가격	1,028.32	986.93	-4.03

(단위 : 원, %)

종류(Class)별 기준가격 현황	전기말	당기말	증감률
마이더스 거북이 90증권 자투자신탁 1호A(주식)	996.18	978.45	-1.78
마이더스 거북이 90증권 자투자신탁 1호Ae(주식)	997.07	980.22	-1.69
마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C1(주식)	991.17	971.62	-1.97
마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C2(주식)	994.86	975.97	-1.90
마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C3(주식)	995.98	978.06	-1.80
마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)	996.75	979.58	-1.72

주) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(판매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령 시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

※ 분배금내역

거북90증권자1A(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북90증권자1Ae(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북90증권자1C1(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북90증권자1C2(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북90증권자1C3(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북90증권자1Ce(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

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

거북90증권자1CW(주식)

(단위 : 백만원, 좌)

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

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

지난 분기 펀드의 수익률은 -1.78%(클래스 A 기준)로, 비교지수 대비 -2.45%p 저조한 성과를 기록하였습니다. 주식 롱 포지션(Long position)에서 편입비중 상위를 기록 중인 서비스업과 운수장비 업종의 성과가 부진하였을 뿐만 아니라, 주식 매도 포지션(Short position)에서도 지난 분기 KOSPI가 0.63% 상승함에 따른 손실을 기록함으로써 전체적으로 비교지수 대비 저조한 성과를 기록하였습니다. 종목별로는 뉴트리바이오택, 롯데케미칼, 포스코대우 등이 우수한 성과를 기록하였고, 삼성에스디에스, CJ프레시웨이, CJ 등의 성과는 부진하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

지난 4월, 유가 회복세와 미국 기준금리 동결발표로 인해 위험자산 선호심리 회복을 바탕으로 지수는 상승하였습니다. 업종별로는 비금속광물제품, 건설업, 전기전자, 화학 업종이 강세를 보인 반면, 통신, 음식료, 유통업 등은 약세를 보였습니다. 4월에는 기업들의 1분기 실적발표가 진행됨에 따라 개별 기업들의 실적이 주가에 큰 영향을 미칠 것으로 판단됩니다. 1분기 내 지속된 높은 환율수준으로 인해 수출-대형주의 실적도 견조할 것으로 예상되어, 지수는 큰 폭의 조정보다는 박스권 내에서의 움직임이 예상됩니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년	설정일
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)	-1.03	-1.43	-1.46	-4.03	-0.57	2.97	-	-	6.56
마이다스 증권 모투자신탁(채권)	0.14	0.66	0.99	1.64	2.11	6.11	8.96	17.88	53.52
마이다스 거북이 증권 모투자신탁(주식)	-1.12	-1.59	-1.64	-4.50	-0.78	2.73	12.66	-	30.64
마이다스 거북이 90증권 자투자신탁 1호A(주식)	-1.15	-1.78	-2.15	-5.05	-1.97	0.12	-	-	2.89
마이다스 거북이 90증권 자투자신탁 1호Ae(주식)	-1.12	-1.69	-1.98	-4.79	-1.62	0.84	-	-	2.72
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C1(주식)	-1.22	-1.97	-2.54	-5.61	-2.73	-1.42	-	-	0.91
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C2(주식)	-1.20	-1.90	-2.39	-5.39	-2.44	-	-	-	-2.40
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C3(주식)	-1.16	-1.80	-2.19	-	-	-	-	-	-2.19
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)	-1.13	-1.72	-2.04	-4.88	-1.75	0.58	-	-	1.98
마이다스 거북이90 증권 자투자신탁 1호C-W(주식)	-1.09	-1.60	-1.80	-4.53	-1.26	1.56	-	-	3.15
비교지수	0.37	0.67	0.88	0.96	1.72	5.68	-	-	7.15

비교지수(Benchmark) = KOSPI 9% + 매경BP종합채권지수(국고채1~2년) 91%

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

▶ 연평균 수익률

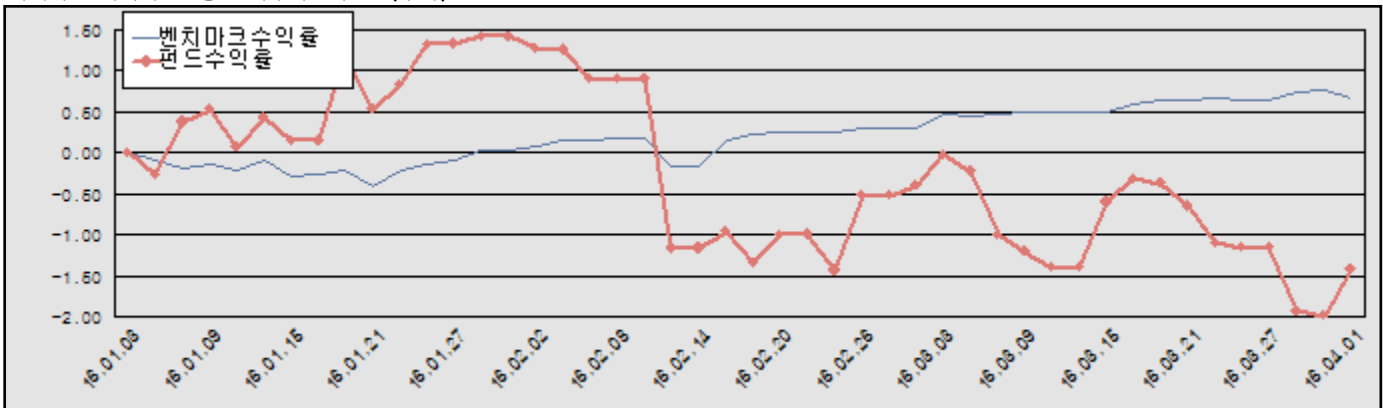
(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)	-0.57	1.48	-	-
마이다스 증권 모투자신탁(채권)	2.11	3.01	2.90	3.35
마이다스 거북이 증권 모투자신탁(주식)	-0.78	1.36	4.05	-
마이다스 거북이 90증권 자투자신탁 1호A(주식)	-1.97	0.06	-	-
마이다스 거북이 90증권 자투자신탁 1호Ae(주식)	-1.62	0.42	-	-
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C1(주식)	-2.73	-0.71	-	-
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C2(주식)	-2.44	-	-	-
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C3(주식)	-	-	-	-
마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)	-1.75	0.29	-	-
마이다스 거북이90 증권 자투자신탁 1호C-W(주식)	-1.26	0.78	-	-
비교지수	1.72	2.80	-	-

비교지수(Benchmark) = KOSPI 9% + 매경BP종합채권지수(국고채1~2년) 91%

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

마이다스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)



비교지수(Benchmark) = KOSPI 9% + 매경BP종합채권지수(국고채1~2년) 91%

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

▶ 손익현황

마이더스 거북이 90 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	-	-	2	-596	-	-	-	-	-	1	0	-593
전기손익	-	-	1	-75	-	-	-	-	-	1	0	-73

마이더스 증권 모두자신탁(채권)

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	-	668	14	-	-	-	-	-	-	0	-2	680
전기손익	-	318	19	-	-	-	-	-	-	6	-2	341

마이더스 거북이 증권 모두자신탁(주식)

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	-512	-	37	-144	-421	-	-	-	-	2	-63	-1,101
전기손익	-1,011	-	45	499	-470	-	-	-	-	8	761	-168

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

마이더스 거북이 90 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	-	-	-	40,194 (98.66)	-	-	-	-	-	446 (1.09)	100 (0.25)	40,739 (100.00)
합계	-	-	-	40,194 (98.66)	-	-	-	-	-	446 (1.09)	100 (0.25)	40,739 (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	-	98,657 (97.50)	-	-	-	-	-	-	-	2,526 (2.50)	-	101,183 (100.00)
합계	-	98,657 (97.50)	-	-	-	-	-	-	-	2,526 (2.50)	-	101,183 (100.00)

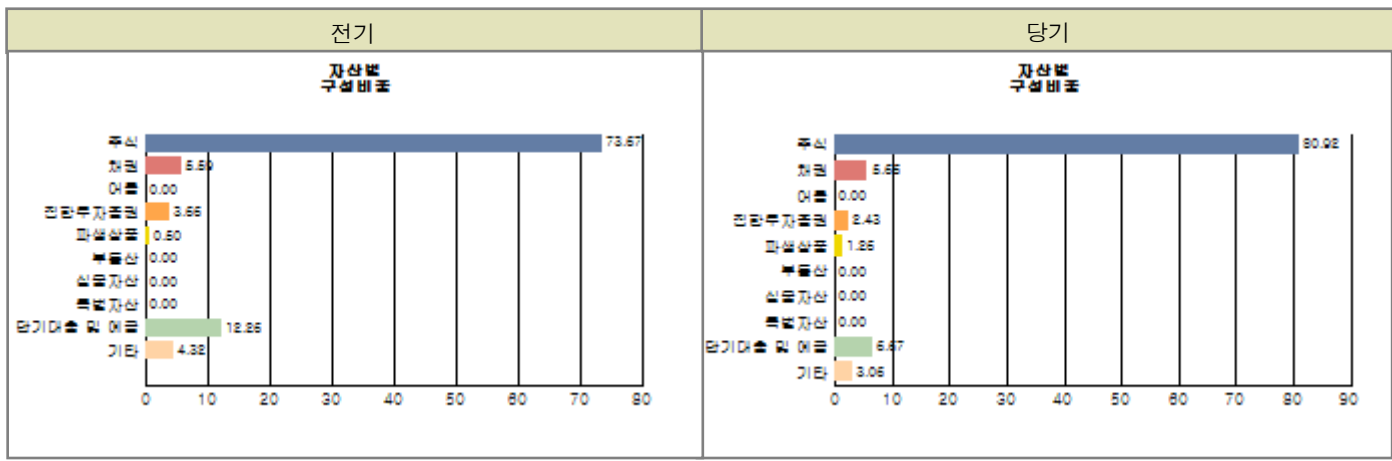
* ()내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.

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	60,111 (92.18)	-	-	1,802 (2.76)	937 (1.43)	-	-	-	-	4,851 (7.42)	2,270 (3.48)	69,971 (107.27)
합계	60,111 (92.18)	-	-	1,802 (2.76)	937 (1.43)	-	-	-	-	4,851 (7.42)	2,270 (3.48)	69,971 (107.27)

* ()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 모투자신탁(주식) 주식투자 상위 10종목

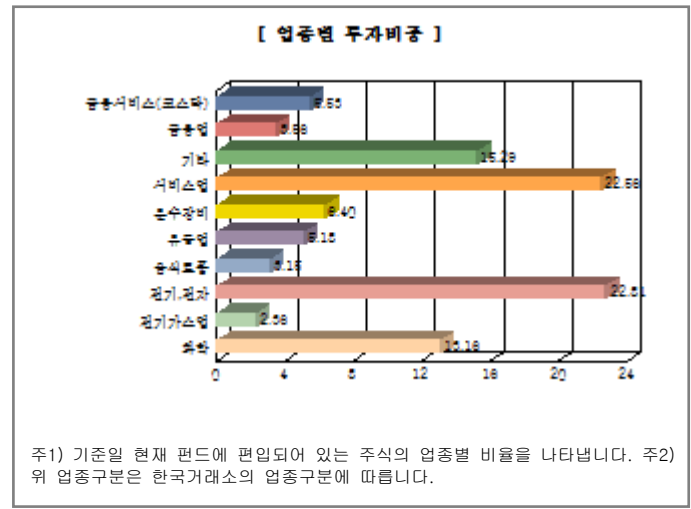
종 목	비 중 (%)	종 목	비 중 (%)
삼성전자	18.04	SK	4.92
아모레퍼시픽	4.84	아모레G	4.32
LG생활건강	4.20	NAVER	3.89
CJ CGV	3.36	효성	3.30
삼성물산	2.37	한국전력	2.36

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식) 업종별 투자비중

종 목	비 중 (%)	종 목	비 중 (%)
전기, 전자	22.81	서비스업	22.56
화학	13.16	운수장비	6.40
금융서비스(코스닥)	5.53	유통업	5.18
금융업	3.56	음식료품	3.15
전기가스업	2.36	기타	15.29

※ 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	2	단기대출및예금	REPO매수(16040139)
3	주식	SK	4	주식	아모레퍼시픽
5	주식	아모레G	6	주식	LG생활건강
7	주식	NAVER	8	주식	CJ CGV
9	주식	효성	10	집합투자증권	KODEX 코스닥150 레버

※ 비중 : 펀드내 순자산 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	채권	국고02750-1706(14-3)	2	채권	통안0149-1802-02
3	채권	국고01625-1806(15-3)	4	채권	국고02000-1712(14-6)
5	채권	통안0171-1704-02	6	채권	산금15신이106-1126-3
7	채권	국고0300-1612(13-7)	8	단기대출및예금	REPO매수(16040146)
9	채권	한국장학재단14-17	10	채권	예보특별채권2012-1

※ 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	8,477	10,842,083,000	18.04
SK	13,255	2,955,865,000	4.92
아모레퍼시픽	7,461	2,909,790,000	4.84
아모레G	17,730	2,597,445,000	4.32
LG생활건강	2,600	2,524,600,000	4.20

※ 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	522,380,960	0.87	2.50
SK1호스팩	152,141	300,478,475	0.50	2.77
엔에이치스팩9호	119,735	236,476,625	0.39	1.32
하나금융7호스팩	106,726	216,120,150	0.36	1.33
케이티비스팩2호	88,565	177,572,825	0.30	1.61
대우SBI스팩1호	84,950	169,900,000	0.28	2.40
하이에이아이1호스팩	80,584	161,168,000	0.27	1.63

※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	30,707,190,000	2014-06-10	2017-06-10	대한민국 정부		31.13
통안0149-1802-02	20,000,000,000	20,058,620,000	2016-02-02	2018-02-02	대한민국 정부		20.33
국고01625-1806(15-3)	10,500,000,000	10,590,867,000	2015-06-10	2018-06-10	대한민국 정부		10.74

국고02000-1712(14-6)	10,000,000,000	10,150,710,000	2014-12-10	2017-12-10	대한민국 정부		10.29
통안0171-1704-02	10,000,000,000	10,023,780,000	2015-04-02	2017-04-02	대한민국 정부		10.16

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

▶ **어음**

해당사항 없음

▶ **집합투자증권**

■ **상위 5개 종목**

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)

(단위 : 원)

종 목	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	취득일	비 중
마이더스거북이주식모	수익증권	마이더스에셋자산운용	39,383,279,504	37,788,533,589	2013-10-04	55.81
마이더스증권모(채권)	수익증권	마이더스에셋자산운용	2,437,847,451	2,405,235,872	2013-10-04	2.38

※ 비중 : 자펀드가 해당 모펀드에서 차지하는 비중

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 원)

종 목	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	취득일	비 중
KODEX 코스닥150 레버		마이더스에셋자산운용	1,806,194,500	1,802,027,000	2015-12-24	100.00

※ 비중 : 보유한 전체 집합투자증권 중 해당 수익증권이 차지하는 비중

▶ **장내파생상품**

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : 계약, 원)

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
코스피200 F 201606	매도	487	59,060,925,000	
코스피200 F 201606	매수	50	6,063,750,000	
합계		537	65,124,675,000	96,250,000

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 90 증권 자투자신탁 1호(주식)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
REPO매수(16040144)	동양투자신탁	2016-04-01	300,013,315	1.62	2016-04-04	
예금	KEB하나은행(하나)		145,698,930	1.15		

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
REPO매수(16040139)	동양투자신탁	2016-04-01	3,600,159,781	1.62	2016-04-04	
콜 3일물 1.33	NH농협은행	2016-04-01	500,019,019	1.33	2016-04-04	
예금	KEB하나은행(하나)		140,841,792	1.15		
REPO매수(16040156)	KTBank자산운용	2016-04-01	110,004,882	1.62	2016-04-04	

REPO매수 (16040117)	KTB자산운용	2016-04-01	80,003,551	1.62	2016-04-04	
-------------------	---------	------------	------------	------	------------	--

※ 상위 5개 종목만 기재함.

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
REPO매수 (16040146)	키움투자자산운용	2016-04-01	2,500,110,959	1.62	2016-04-04	
예금	KEB하나은행(하나)		26,283,908	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	7	5,319	서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이더스에셋자산운용 총괄대표	2109000325
오종록	2013-10-09	책임운용역	12	5,371	서울대학교 경제학과, 교보투신, 한누리투자증권, 이트레이드증권, 알리안츠생명보험 자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 채권운용파트장	2109000845
채경섭	2015-05-29	부책임운용역	8	119,190	BASF Company.Ltd., 신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 주식운용파트 팀장	2109000941
정승호	2014-10-01	부책임운용역	12	119,190	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
2013-10-02 ~ 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 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(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	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 중개 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 중개 수수료	단순매매/중개수수료	40	0.05	69	0.09
	조사분석업무 등 서비스수수료	53	0.06	73	0.10
	합계	94	0.11	142	0.19
증권거래세	90	0.11	117	0.16	

마이더스 거북이 90증권 자투자신탁 1호A(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	55	0.16	47	0.16	
판매회사	60	0.18	52	0.18	
펀드재산보관(신탁업자)	2	0.01	1	0.00	
일반사무관리회사	2	0.01	1	0.00	
보수 합계	118	0.36	102	0.35	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	-
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	-
	합계	-	-	-	-
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이 90증권 자투자신탁 1호Ae(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	1	0.16	1	0.16	
판매회사	1	0.09	1	0.09	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
보수 합계	2	0.26	2	0.26	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	-
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	-
	합계	-	-	-	-
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	1	0.16	1	0.16	
판매회사	2	0.38	2	0.37	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
보수 합계	3	0.55	2	0.55	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	-
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	-
	합계	-	-	-	-
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C2(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	22	0.16	10	0.16	
판매회사	40	0.30	19	0.30	
펀드재산보관(신탁업자)	1	0.01	0	0.00	
일반사무관리회사	1	0.01	0	0.00	
보수 합계	63	0.48	30	0.47	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	-
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	-
	합계	-	-	-	-
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C3(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	4	0.16	12	0.16	
판매회사	6	0.20	15	0.20	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
보수 합계	10	0.38	28	0.37	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	-
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	-
	합계	-	-	-	-
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	2	0.16	2	0.16	
판매회사	2	0.12	1	0.12	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
보수 합계	4	0.30	3	0.29	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매 중개 수수료	단순매매/중개수수료	-	-	-	
	조사분석업무 등 서비스수수료	-	-	-	
	합계	-	-	-	
증권거래세	-	-	-	-	

마이더스 거북이90 증권 자투자신탁 1호C-W(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	1	0.16	1	0.16	
판매회사	-	-	-	-	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
보수 합계	1	0.17	1	0.17	
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 90 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	0.00	0.41
당기	0.00	0.00	0.01	0.72

마이더스 증권 모두자신탁(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 모두자신탁(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.00	0.45	0.00	0.45
당기	0.00	0.77	0.00	0.77

마이더스 거북이 90증권 자투자신탁 1호A(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.41	-	1.42	0.41
당기	1.41	-	1.42	0.72

마이더스 거북이 90증권 자투자신탁 1호Ae(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.05	-	1.06	0.41
당기	1.05	-	1.06	0.72

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.19	-	2.20	0.41
당기	2.19	-	2.20	0.70

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C2(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.89	-	1.90	0.42
당기	1.89	-	1.90	0.69

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호C3(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.49	-	1.50	0.37
당기	1.49	-	1.50	0.75

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호Ce(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.18	-	1.19	0.41
당기	1.18	-	1.19	0.70

마이더스 거북이90 증권 자투자신탁 1호C-W(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.69	-	0.70	0.41
당기	0.69	-	0.70	0.72

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 회전율

마이더스 증권 모투자신탁(채권)

(단위 : 주, 원, %)

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

마이더스 거북이 90 증권 자투자신탁 1호(주식)

(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
438,367	31,936,939,895	923,348	35,340,664,055	55.98	224.53

※ 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 매매회전을 추이

마이다스 거북이 증권 모투자신탁(주식)

(단위 : %)

2016-01-02 ~ 2016-04-01	2015-10-02 ~ 2016-01-01	2015-07-02 ~ 2015-10-01
55.98	43.43	102.07