

자산운용보고서

마이다스 2스타 주가연동 증권투자신탁 SL-3호 ELS-파생형

(운영기간 : 2016년06월03일 ~ 2016년06월12일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(1개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다

마이다스에셋자산운용

서울시 영등포구 여의대로 66 KTB증권빌딩 8층
(전화 02-3787-3500, <http://www.midasasset.com>)

목 차

- 1 펀드의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 자산현황
- 2 운용경과 및 수익률현황
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 투자환경 및 운용계획
 - ▶ 기간(누적)수익률
 - ▶ 손익현황
- 3 자산현황
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 환헤지에 관한 사항
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 4 투자운용전문인력 현황
 - ▶ 투자운용인력
 - ▶ 운용전문인력 최근 변경 내역
- 5 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 6 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전율
 - ▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보

자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
마이더스 2스타 추가연동 증권투자신탁 SL-3호(ELS-파생형)		1등급	A1887
펀드의 종류	주식파생형, 단위형, 일반형	최초설정일	2013.06.03
운용기간	2016.06.03 ~ 2016.06.12	존속기간	2016.06.13
자산운용회사	마이더스에셋자산운용	펀드재산보관회사	국민은행
판매회사	국민은행	일반사무관리회사	하나펀드서비스
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 상환됨.		

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
2스타추가연동SL-3(ELS-파생형)	자산 총액 (A)	297	321	8.12
	부채 총액 (B)	0	0	-35.28
	순자산총액 (C=A-B)	297	321	8.13
	발행 수익증권 총 수 (D)	1,121	1,121	0.00
	기준가격(%) (E=C/D×1000)	264.85	286.37	8.13

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

※ 분배금 내역

(단위 : 백만원, 백만좌)

구분	분배금지급일	분배금지급금액	분배후수탁고	기준가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
2스타추가연동SL-3(ELS-파생형)	20160613	0	1,121	286.37	286.37	

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

③ 두 기초자산 모두 최초기준가격의 70%이상인 경우 : 연 7.3%수준의 수익지급

④ 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.

▶ 투자환경 및 운용 계획

<만기상환 내역>

- 최초기준가격: 삼성중공업 35,716원 / LG디스플레이 31,366원

- 최초기준가격의 70%: 삼성중공업 25,001.20원 / LG디스플레이 21,956.20원

- 최종기준가격: 삼성중공업: 10,060.00원 / LG디스플레이: 24,466.67원(2016년 6월 3,7,8일 증가의 산술평균)

- 동 펀드의 기초자산 중 LG디스플레이 보통주는 수익상환조건인 최초기준가격의 70% 이상을 충족하였으나, 삼성중공업 보통주는 최초기준가격의 약 28.17%로써 수익상환조건을 충족하지 못하였습니다. 따라서 삼성중공업 보통주의 최초기준가격 대비 하락률(약 71.83%)만큼의 원금손실이 발생하였습니다.

- 상환금지급일: 2016년 06월 13일

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
2스타주가연동SL-3(ELS-파생형)	-16.69	-1.17	-19.39	-44.19
(비교지수 대비 성과)	(-16.69)	(-1.17)	(-19.39)	(-44.19)
비교지수(벤치마크)	-	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
2스타주가연동SL-3(ELS-파생형)	-44.19	-65.31	-71.38	-
(비교지수 대비 성과)	(-44.19)	(-65.31)	(-71.38)	-
비교지수(벤치마크)	-	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

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

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	0	0	0	0	0	-45	0	0	0	0	0	-45
당기	0	0	0	0	0	24	0	0	0	0	0	24

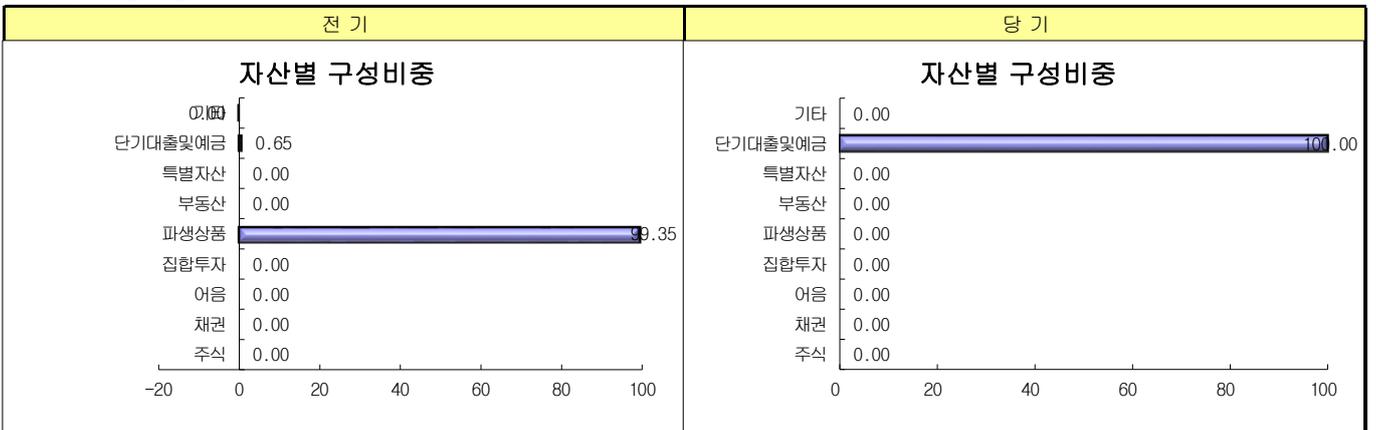
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	0	0	0	0	0	0	0	0	0	321	0	321
(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(100.00)	(0.00)	(100.00)
합계	0	0	0	0	0	0	0	0	0	321	0	321

* () : 구성 비중



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	구분	종목명	비중	구분	구분	종목명	비중
1	단기상품	은대	100.00	6			0.00
2				7			
3				8			
4				9			
5				10			

※보다 상세한 투자대상자산 내용은 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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	국민은행	2013-06-03	321	0.92		대한민국	KRW

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력

(단위: 개, 억원)

성명	직위	출생년도	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
박정환	책임운용역	1964	35	약 935억	-	-	2109000201

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
2스타주가연동SL-3(ELS-파생형)	자산운용사	0	0.00	0	0.00	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	0	0.00	
	기타비용**	0	0.01	0	0.00	
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0.00	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
	증권거래세	0	0.00	0	0.00	

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외한 것입니다.

※ 성과보수내역 :

※ 발행분담금내역 :

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

		총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
2스타주가연동SL-3(ELS-파생형)	전기	0.0252	0	0.0252
	당기	0.0252	0	0.0252

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매회전율(주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	0	0	0.00	0.00

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가격의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가격으로 나눈 비율

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

0.00	0.00	0.00
------	------	------

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 2스타 추가연동 증권투자신탁 SL-3호(ELS-파생형)의 자산운용회사인 '마이다스에셋자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '국민은행'의 확인을 받아 판매회사인 '국민은행'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드 재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용 <http://www.midasasset.com> / 02-3787-3500
금융투자협회 <http://dis.kofia.or.kr>

고객님이 가입하신 펀드는 펀드의 운용규모가 법적 기준 소규모상태(50억원 미만)에 해당하여 운용시 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란할 수 있습니다. 또한 법적단서에 의거하여 향후 불가피하게 임의해지를 통해 정리될 수 있음을 알려드립니다. (자본시장과 금융투자업에 관한 법률 제 192조 제1항, 동법 시행령 제 233조 제3호 및 제4호)