

# 자산운용보고서

마이다스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호 주식

(운용기간 : 2016년03월17일 ~ 2016년06월16일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 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
  - ▶ 재산현황
- 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 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용), 마이더스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)C, 마이더스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)Ce		4등급	AP548, AQ127, AQ128
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2014.03.17
운용기간	2016.03.17 ~ 2016.06.16	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이더스에셋자산운용	펀드재산보관회사	KEB하나은행
판매회사	KEB하나은행, KEB하나은행(구외환), NH농협은행, NH투자증권, 대구은행, 동부증권, 미래에셋대우, 부산은행, 삼성생명보험, 삼성증권, 신한은행, 우리은행, 키움증권, 펀드온라인코리아, 하나 금융투자, 한화투자증권, 현대증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	이 투자신탁은 서민과 젊은 세대의 목돈 마련 지원을 목적으로 합니다. 롱숏전략을 통하여 금리+α의 수익률을 추구하는 주식모펀드(마이더스거북이주식모)에 70% 이상을 투자하며, 나머지는 채권모펀드(마이더스증권채권모)에 주로 투자합니다. 주식모펀드는 헤지 펀드의 주 운용전략인 롱숏 전략을 비롯한 다양한 전략(이벤트드리븐, 차익거래)을 활용하여 주가지수의 등락에 관계없이 안정적인 운용성과를 추구하는 동시에 채권모펀드에서는 국공채 위주의 투자를 통해 안정적인 이자 수익을 추구합니다.		

## ▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
거북이70소장자1(주식)(운용)	자산 총액 (A)	8,873	9,491	6.96
	부채 총액 (B)	0	0	36290.26
	순자산총액 (C=A-B)	8,873	9,491	6.96
	발행 수익증권 총 수 (D)	8,389	9,098	8.45
	기준가격 <sup>주)</sup> (E=C/D×1000)	1,057.72	1,043.21	-0.26
종류(Class)별 기준가격 현황				
거북이70소장자1(주식)C	기준가격	997.64	994.48	-0.55
거북이70소장자1(주식)Ce	기준가격	1,001.98	995.36	-0.46

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

지난 분기, 해당 펀드는 1.30%의 수익률을 기록하였고 (클래스 A), 비교지수 대비 +0.77% 상회하였습니다. 서비스, KOSDAQ 과 같은 업종에서는 성과가 부진하였으나, 펀드내 편입비중이 높은 전기전자에서 우수한 성과를 기록하여 전체적으로 비교지수 대비 아웃퍼폼 하였습니다. 지난 6월말 기준, KOSPI는 -0.7% 하락한 1,970.35pt에 마감하였습니다. KOSPI는 월 초 발표된 미국 고용지표 부진으로 미 연준의 6월 금리 인상 확률이 낮아졌고, 한은의 깜짝 기준금리 인하 등으로 상승 출발했습니다. 그러나, 23일 예상치 못 했던 영국의 EU탈퇴, 즉 브렉시트가 결정되며, 시장의 단기 충격으로 작용했습니다. 이후, 정부의 추경 발표와 함께, 공매도 공시법 시행을 두고 숏커버가 유입되며, 지수는 1,970대를 마감하며 마무리 되었습니다. 월중 예상치 못 한 브렉시트가 발생했으나, 각국 중앙은행들의 유동성 투입 등을 통한 신속한 시장대처와 이에 대한 기대감에 지수는 다시 회복세에 놓일 것으로 예상됩니다.

## ▶ 투자환경 및 운용 계획

중기적인 측면에서는 여전히 구조적인 성장이 가능한 화장품 업종과 미디어, 일부 가능성 높은 바이오 등의 업종을 선호합니다. 전세계적인 성장을 둔화하고 그간, 한국 경제의 성장을 주도한 자동차, 전기전자 업종의 성장둔화로 인해 구조적인 성장세가 기대되는 업종 및 기업에 대한 선호 현상이 지속될 것으로 판단하기 때문입니다. 6월말 기준 주식의 지수 섹터지수는 81.18%수준이며, 개별 주식 섹터지수와 함께 펀드의 시장 노

출도는 0~20% 이내로 유지하도록 하겠습니다. 6월말 기준 개별주식 SHORT 포지션 비중은 0.34%(모펀드기준)으로 지난달 2.83% 대비 대폭 축소했습니다. 이는 기존 숏포지션의 수익실현과 함께, 브렉시트 이후, 시장의 반등을 생각하였기 때문입니다. 시장과 주요 종목 들의 가격 변동을 지속적으로 모니터링 하여, 적절한 시점에 추가적인 공매도를 진행하도록 하겠습니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
거북이70소장자1(주식)(운용)	-0.26	1.03	0.34	-0.61
(비교지수 대비 성과)	(-0.81)	(-0.16)	(-1.08)	(-2.40)
종류(Class)별 현황				
거북이70소장자1(주식)C	-0.55	0.44	-0.53	-1.76
(비교지수 대비 성과)	(-1.10)	(-0.75)	(-1.96)	(-3.56)
거북이70소장자1(주식)Ce	-0.46	0.62	-0.27	-1.41
(비교지수 대비 성과)	(-1.02)	(-0.57)	(-1.69)	(-3.21)
비교지수(벤치마크)	0.55	1.19	1.42	1.80

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 7.0%, 매경BP국공채(1~2년) 93.0%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
거북이70소장자1(주식)(운용)	-0.61	4.18	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-2.40)	(-1.28)	-	-
종류(Class)별 현황				
거북이70소장자1(주식)C	-1.76	1.78	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-3.56)	(-3.68)	-	-
거북이70소장자1(주식)Ce	-1.41	2.50	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-3.21)	(-2.96)	-	-
비교지수(벤치마크)	1.80	5.46	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 7.0%, 매경BP국공채(1~2년) 93.0%

※ 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			
전 기	0	0	0	160	0	0	0	0	0	1	-160	1
당 기	0	0	0	-21	0	0	0	0	0	1	20	1

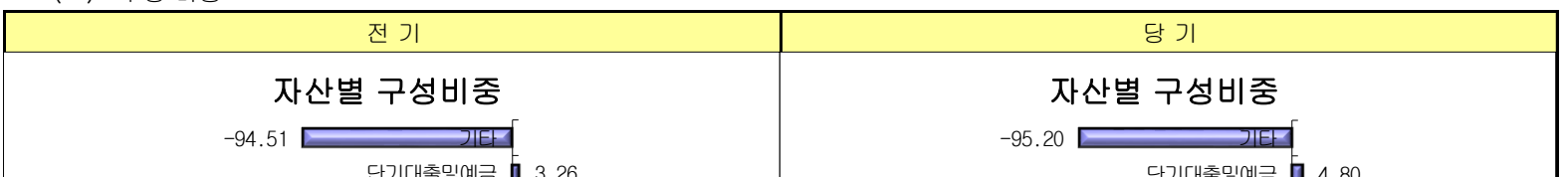
3. 자산현황

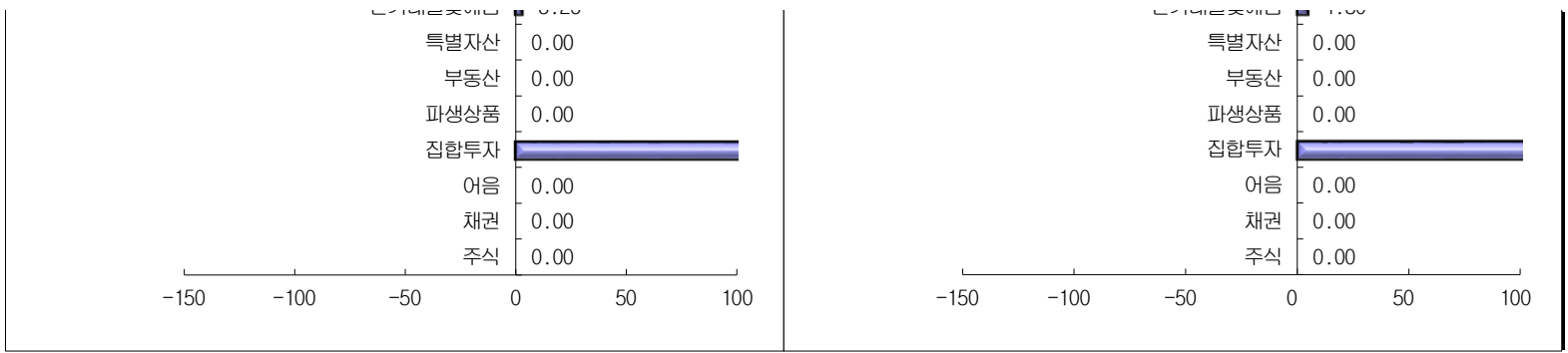
▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	0	0	0	18,071	0	0	0	0	0	455	-9,035	9,491
(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(190.40)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(4.80)	#####	(100.00)
합 계	0	0	0	18,071	0	0	0	0	0	455	-9,035	9,491

\* ( ) : 구성 비중





▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	집합투자증권	거북이(모펀드)(주식)	70.53	6	
2	집합투자증권	증권모(모펀드)(채권)	24.67	7	
3	단기상품	REPO매수(20160616)	4.21	8	
4	단기상품	은대	0.58	9	
5				10	

※모다 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

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
거북이(모펀드)(주식)	수익증권		6,720	6,694	대한민국	KRW	70.53
증권모(모펀드)(채권)	수익증권		2,316	2,341	대한민국	KRW	24.67

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	KEB하나은행	2014-03-17	55	0.92		대한민국	KRW
REPO매수	한국자금중개	2016-06-16	400	0.01		대한민국	KRW

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

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력

(단위: 개, 백만원)

성명	직위	출생년도	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
채경섭	주식 책임운영역	1974	9	약 2,290억	-	-	21090000941
김지상	주식 부책임운영역	1975	8	약 2,290억	-	-	21150000373
오종록	채권 책임운영역	1973	13	약 2,017억	-	-	21090000845
정승호	채권 부책임운영역	1975	13	약 2,539억	-	-	21100000746

▶ 운용전문인력 최근 변경 내역

운용역	직위	운용 기간
허필석	주식-책임운용역	2012.03.05-2016.06.09
채경섭	주식-책임운용역	2016.06.10-현재
채경섭	주식-부책임운용역	2015.01.12~2015.05.29
최종혁	주식-부책임운용역	2015.01.12~2015.05.29
채경섭	주식-부책임운용역	2015.06.01-2016.06.09
김지상	주식-부책임운용역	2016.06.10-현재
오종록	채권-책임운용역	2012.05.01-현재
정승호	채권-부책임운용역	2014.10.01-현재

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구 분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
거북이70소장자1(주식)(운용)	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	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	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
거북이70소장자1(주식)C	자산운용사	8	0.10	9	0.11	
	판매회사	14	0.17	15	0.18	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
	보수합계	23	0.29	25	0.29	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	11	0.14	9	0.10
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	11	0.14	9	0.10
		증권거래세	8	0.11	9	0.10
거북이70소장자1(주식)Ce	자산운용사	0	0.10	0	0.11	
	판매회사	0	0.09	0	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
	보수합계	1	0.20	1	0.20	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1	0.14	0	0.10
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	1	0.14	0	0.10
		증권거래세	0	0.11	0	0.10

\* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 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)
거북이70소장자1(주식)(운용)	전기	0	0	0
	당기	0	0.009	0.009
종류(Class)별 현황				
거북이70소장자1(주식)C	전기	1.1814	0.5177	1.6991
	당기	1.1775	0.4521	1.6296
거북이70소장자1(주식)Ce	전기	0.8257	0.5134	1.3391
	당기	0.823	0.4511	1.2741

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

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

**6. 투자자산매매내역**

▶ **매매주식규모 및 회전을**

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매회전율 <sup>주)</sup>	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	0	0	0.00	0.00

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

▶ **최근 3분기 매매회전을 추이**

(단위 : %)

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

**공지사항**

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 거북이 70 소득공제 장기 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용)의 자산운용회사인 '마이다스에셋자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 'KEB하나은행'의 확인을 받아 판매회사인 'KEB하나은행, KEB하나은행(구외환), NH농협은행, NH투자증권, 대구은행, 동부증권, 미래에셋대우, 부산은행, 삼성생명보험, 삼성증권, 신한은행, 우리은행, 키움증권, 펀드온라인코리아, 하나금융투자, 한화투자증권, 현대증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 하합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용  
금융투자협회

<http://www.midasasset.co>  
<http://dis.kofia.or.kr>

/ 02-3787-3500