

자산운용보고서

마이다스 퇴직연금 액티브 증권 자투자신탁 1호 주식

(운용기간 : 2016년03월22일 ~ 2016년06월21일)

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 퇴직연금 액티브 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용), 마이더스 퇴직연금 액티브 증권 자투자신탁1호(주식) C-1		2등급	A6886, 83599
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2012.03.22
운용기간	2016.03.22 ~ 2016.06.21	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이더스에셋자산운용	펀드재산보관회사	KEB하나은행
판매회사	신한금융투자	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	본 상품은 근로자퇴직급여보장법 관련법령에 의하여 수익자의 노후생활을 대비하기 위한 자금 마련을 목적으로 하는 투자신탁이며, 마이더스 퇴직연금 증권 모투자신탁(주식)에 신탁재산의 70%이상, 마이더스 퇴직연금 증권 모투자신탁(채권)에 신탁재산의 30%이하 투자하는 상품입니다. 마이더스 퇴직연금 증권 모투자신탁(주식)은 주식에 신탁재산의 90%이상 투자하며, 적극적인 종목 선정을 통하여 벤치마크대비 초과성과를 얻는 것을 목표로 하고 있습니다. 자산의 70%이상 주식에 투자되는 특성상 유가, 환율, 금리 등 다양한 거시변수와 투자된 기업의 고유위험이 수익률에 영향을 미치는 특성을 가지고 있습니다.		

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
퇴연액티브자1(주식)(운용)	자산 총액 (A)	1,095	1,018	-6.99
	부채 총액 (B)	0	0	0.00
	순자산총액 (C=A-B)	1,095	1,018	-6.99
	발행 수익증권 총 수 (D)	978	977	-0.10
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,119.20	1,042.01	0.69
종류(Class)별 기준가격 현황				
퇴연액티브자1(주식)C-1	기준가격	995.97	969.14	0.59

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, 펀드는 0.59%(Class C-1)의 수익률을 기록하여, 벤치마크 대비 0.95% 상회하였습니다. 펀드내 편입 비중이 높은 서비스, 화학 업종에서 부진한 성과를 기록하였으나, 전기전자 및 의약품 업종에서 우수한 성과를 기록하였습니다. 지난 6월말 기준, KOSPI는 0.66%, KOSDAQ은 3.34% 하락하였습니다. 월초 발표된 미국 고용지표 부진으로 기준금리 인상 확률이 낮아졌고 국내 기준금리 인하 등으로 KOSPI는 상승 출발했습니다. 그러나, 시장의 예상과 달리 영국의 'EU 탈퇴'가 결정되어, 이는 시장에 단기적 충격으로 작용했습니다. 국내증시는 3% 하락했으나 정부의 '추경편성안' 발표와 함께 공매도 공시법 시행을 앞두고 '숏 커버'가 유입되며 월말에 주가가 상승,1,970p대로 마감했습니다. 업종별로는 전기전자, 의약품, 제조업 등이 양호했으나 의료정밀, 기계, 보험, 서비스업 등은 약세를 보였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

주식편입비는 전월과 동일하게 97% 전후를 유지하였습니다. 벤치마크대비 주식 부문의 비중을 높게 유지하였으나, 펀드 수익률에는 미미한 영향을 끼쳤습니다. 기존의 소비재 중심의 포트폴리오 변동은 거의 없었으나, 브렉시트 결정이후 낙폭과대 경기 민감 대형주에 대한 비중을 확대하고 경기방어 업종의 비중을 축소하였습니다. 업종기준 대비 오버웨이트 업종은 제약, 화장품, 지주사, 서비스, 유틸리티등 내수관련 업종이며, 반면, 자동차, 전기전자, 철강, 보험, 조선, 유통업종은 언더웨이트한 상황입니다. 펀드 편입비중이 높은 서비스, 제약, 화장품, 지주회사등 내수업종의 추가 반등이 나타났던 반면 편입비중이 낮은 철강, 화학, 자동차, 조선등 경기관련 수출업종의 추가 하락으로 펀드수익률이 개선되었습니다. 또한 편입하였던 코스닥을 비롯한 중소형주의 추가수익률이 양호하여 펀드수익률에 긍정적인 영향을 끼쳤습니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
퇴연액티브자1(주식)(운용)	0.69	-1.40	-2.36	-9.00
(비교지수 대비 성과)	(1.05)	(-1.48)	(-3.28)	(-5.86)
종류(Class)별 현황				
퇴연액티브자1(주식)C-I	0.59	-1.60	-2.66	-9.37
(비교지수 대비 성과)	(0.95)	(-1.67)	(-3.58)	(-6.23)
비교지수(벤치마크)	-0.35	0.08	0.92	-3.14

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 100.0%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
퇴연액티브자1(주식)(운용)	-9.00	0.69	9.86	-
(비교지수 대비 성과)	(-5.86)	(-0.05)	(1.09)	-
종류(Class)별 현황				
퇴연액티브자1(주식)C-I	-9.37	-0.12	8.55	-
(비교지수 대비 성과)	(-6.23)	(-0.86)	(-0.23)	-
비교지수(벤치마크)	-3.14	0.74	8.77	-

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 100.0%

※ 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			
전기	0	0	0	65	0	0	0	0	0	0	-65	0
당기	0	0	0	7	0	0	0	0	0	0	-7	0

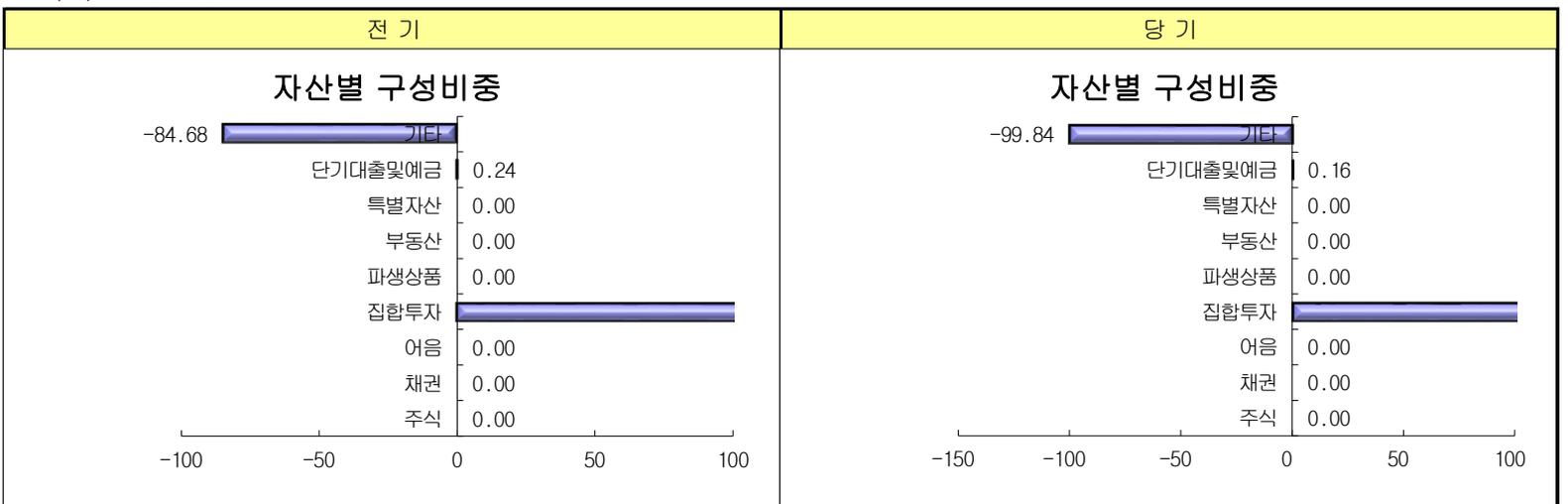
3. 자산현황

▶ 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	2,033	0	0	0	0	0	2	-1,017	1,018
(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(199.68)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.16)	#####	(100.00)
합계	0	0	0	2,033	0	0	0	0	0	2	-1,017	1,018

* () : 구성 비중



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	집합투자증권 퇴직연금(모펀드)(주식)	99.84	6		0.00
2	단기상품 은대	0.16	7		0.00
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

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
퇴직연금(모펀드)(주식)	수익증권		1,101	1,017	대한민국	KRW	99.84

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	2012-03-22	2	0.92		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	
송형섭	책임운용역	1974	2	약 85억	-	-	2109000914

▶ 운용전문인력 최근 변경 내역

운용역	직위	운용 기간
허필석	책임운용역	2012.03.22 ~ 2012.04.30
송형섭	책임운용역	2012.05.02 ~ 현재

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
퇴연액티브자1(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·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	
퇴연액티브자1(주식)C-I	자산운용사	1	0.08	1	0.08	
	판매회사	0	0.01	0	0.01	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	1	0.10	1	0.10	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	1	0.07	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	1	0.07	0	0.03
	증권거래세	1	0.11	0	0.04	

* 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)
퇴연액티브자1(주식)(운용)	전기	0	0	0
	당기	0	0	0
종류(Class)별 현황				
퇴연액티브자1(주식)C-I	전기	0.4078	0.2084	0.6162
	당기	0.4067	0.1836	0.5903

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(주)	
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 퇴직연금 액티브 증권 자투자신탁 1호 (주식)(운용)의 자산운용회사인 '마이다스에셋자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 'KEB하나은행'의 확인을 받아 판매회사인 '신한금융투자'를 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용
금융투자협회

<http://www.midasasset.co>

/ 02-3787-3500

<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 제192조 제1항, 동법 시행령 제233조 제3호 및 제4호)