

자산운용보고서

마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호 주식

(운용기간 : 2016년03월31일 ~ 2016년06월30일)

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
마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용), 마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)A, 마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)Ae, 마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)C2, 마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)C3, 마이다스 거북이 70 증권 자투자신탁 1호(주식)Ce		4등급	AL006, AL007, AL009, AL196, AL197, AL010
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2013.10.01
운용기간	2016.03.31 ~ 2016.06.30	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이다스에셋자산운용	펀드재산보관회사	KEB하나은행
판매회사	KEB하나은행, 삼성생명보험, 삼성증권, 스탠다드차타드은행, 키움증권, 펀드온라인코리아, 한국씨티은행, 한국씨티은행(판매_한미(구))	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	본 상품은 혼합형 펀드로서 주식에 70%~80%, 채권등에 30% 이하를 투자하고 있습니다. KOSPI등락률7%+매경BP 종합채권지수 1~2년물 수익률 93%를 벤치마크로 하여 벤치마크대비 초과성적을 목표로 하고 있습니다. 따라서 수익자는 주식형 펀드와 비교하여 상대적으로 안정된 수익을 기대할 수 있는 상품입니다. 롱숏 전략 등 다양한 절대수익 추구 전략을 복합적으로 활용하여 투자위험을 축소하고, 국내 주식 매매차익에 대한 비과세로 주식투자부분에 대해 절세효과를 기대할 수 있습니다. 본 상품은 자산의 70%~80%까지 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
거북이70자1(주식)(운용)	자산 총액 (A)	4,793	4,051	-15.49
	부채 총액 (B)	2	2	0.00
	순자산총액 (C=A-B)	4,792	4,049	-15.50
	발행 수익증권 총 수 (D)	4,489	3,728	-16.95
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,067.34	1,086.06	1.75
종류(Class)별 기준가격 현황				
거북이70자1(주식)A	기준가격	979.55	993.45	1.42
거북이70자1(주식)Ae	기준가격	981.33	996.16	1.51
거북이70자1(주식)C2	기준가격	977.59	990.49	1.32
거북이70자1(주식)C3	기준가격	983.82	997.28	1.37
거북이70자1(주식)Ce	기준가격	980.54	994.85	1.46

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

전 분기 동안, 해당 펀드는 1.30%(ClassA)의 수익률을 기록하여 벤치마크 대비 0.77% 상회하였습니다. 서비스, KOSDAQ 과 같은 업종에서는 성과가 부진하였으나, 펀드내 편입비중이 높은 전기전자에서 우수한 성과를 기록하여 전체적으로 비교지수 대비 아웃퍼폼 하였습니다. 지난 6월기준, 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 둔화와 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 섯포지션은 81.18%수준이며, 개별 주식 섯포지션과 함께 펀드의 시장 노출도는 0~20% 이내로 유지하도록 하겠습니다. 6월말 기준 개별주식 SHORT 포지션 비중은 0.34%(모펀드기준)으로 지난달 2.83% 대비 대폭 축소했습니다. 이는 기존 섯포지션의 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
거북이70자1(주식)(운용)	1.63	0.27	0.35	-1.32
(비교지수 대비 성과)	(1.10)	(-1.01)	(-1.19)	(-3.10)
종류(Class)별 현황				
거북이70자1(주식)A	1.30	-0.40	-0.65	-2.63
(비교지수 대비 성과)	(0.77)	(-1.67)	(-2.19)	(-4.42)
거북이70자1(주식)Ae	1.39	-0.22	-0.38	-2.28
(비교지수 대비 성과)	(0.86)	(-1.49)	(-1.92)	(-4.06)
거북이70자1(주식)C2	1.20	-0.60	-0.95	-3.02
(비교지수 대비 성과)	(0.67)	(-1.87)	(-2.49)	(-4.81)
거북이70자1(주식)C3	1.25	-0.50	-	-
(비교지수 대비 성과)	(0.72)	(-1.77)	-	-
거북이70자1(주식)Ce	1.34	-0.31	-0.51	-2.45
(비교지수 대비 성과)	(0.81)	(-1.58)	(-2.05)	(-4.23)
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
거북이70자1(주식)C_통합	1.24	-0.55	-0.68	-2.40
(비교지수 대비 성과)	(0.71)	(-1.83)	(-2.22)	(-4.19)
비교지수(벤치마크)	0.53	1.27	1.54	1.78

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
거북이70자1(주식)(운용)	-1.32	3.95	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-3.10)	(-1.56)	-	-
종류(Class)별 현황				
거북이70자1(주식)A	-2.63	1.21	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-4.42)	(-4.30)	-	-
거북이70자1(주식)Ae	-2.28	1.95	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-4.06)	(-3.56)	-	-
거북이70자1(주식)C2	-3.02	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-4.81)	-	-	-
거북이70자1(주식)C3	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
거북이70자1(주식)Ce	-2.45	1.60	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-4.23)	(-3.91)	-	-
CDSC 적용펀드 통합 수익률				

거북이70자1(주식)C_통합	-2.40	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-4.19)	-	-	-
비교지수(벤치마크)	1.78	5.51	-	-

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			
전기	0	0	0	-72	0	0	0	0	0	0	72	0
당기	0	0	0	75	0	0	0	0	0	0	-75	0

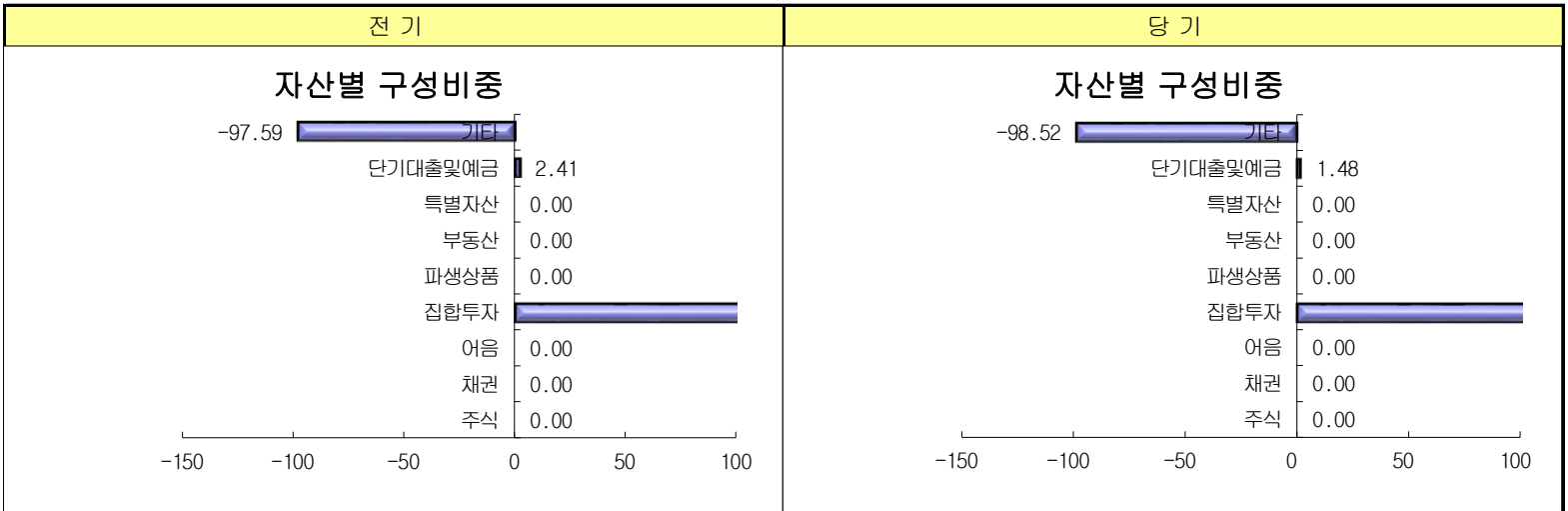
3. 자산현황

▶ 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	7,981	0	0	0	0	0	60	-3,991	4,051
(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(197.03)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(1.48)	#####	(100.00)
합계	0	0	0	7,981	0	0	0	0	0	60	-3,991	4,051

* () : 구성 비중



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	집합투자증권	거북이(모펀드)(주식)	71.08	6			0.00
2	집합투자증권	증권모(모펀드)(채권)	27.44	7			0.00
3	단기상품	은대	1.48	8			0.00
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
거북이(모펀드)(주식)	수익증권		2,876	2,879	대한민국	KRW	71.08
증권모(모펀드)(채권)	수익증권		1,098	1,111	대한민국	KRW	27.44

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	2013-10-01	60	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	
채경섭	주식 책임운용역	1974	9	약 2,347억	-	-	21090000941
김지상	주식 부책임운용역	1975	8	약 2,347억	-	-	21150000373
오종록	채권 책임운용역	1973	13	약 2,074억	-	-	21090000845
정승호	채권 부책임운용역	1975	13	약 2,595억	-	-	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, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
거북이70자1(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	
거북이70자1(주식)A	자산운용사	5	0.15	5	0.15	
	판매회사	6	0.17	6	0.18	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
	보수합계	12	0.33	10	0.33	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매. 중개수수료	5	0.13	3	0.10
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	5	0.13	3	0.10
	증권거래세	3	0.10	3	0.11	
거북이70자1(주식)Ae	자산운용사	0	0.15	0	0.14	
	판매회사	0	0.09	0	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.24	0	0.24	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매. 중개수수료	0	0.13	0	0.10
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.13	0	0.10
	증권거래세	0	0.10	0	0.11	
거북이70자1(주식)C2	자산운용사	2	0.15	0	0.15	
	판매회사	3	0.27	1	0.28	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
	보수합계	5	0.43	1	0.44	
	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	1	0.10	0	0.11	
거북이70자1(주식)C3	자산운용사	0	0.15	1	0.14	
	판매회사	0	0.22	2	0.23	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
	보수합계	0	0.38	3	0.38	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매. 중개수수료	0	0.13	1	0.10
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00

	합계	0	0.13	1	0.10	
	증권거래세	0	0.09	1	0.11	
거북이70자1(주식)Ce	자산운용사	1	0.15	0	0.15	
	판매회사	0	0.12	0	0.13	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
	보수합계	1	0.28	1	0.29	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	1	0.13	0	0.11
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	1	0.13	0	0.11
		증권거래세	0	0.10	0	0.11

* 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)
거북이70자1(주식)(운용)	전기	0	0	0
	당기	-0.0518	0	-0.0518
종류(Class)별 현황				
거북이70자1(주식)A	전기	1.3609	0.5548	1.9157
	당기	1.3453	0.457	1.8023
거북이70자1(주식)Ae	전기	0.9824	0.4871	1.4695
	당기	0.9772	0.4417	1.4189
거북이70자1(주식)C2	전기	1.7571	0.5269	2.284
	당기	1.7524	0.4622	2.2146
거북이70자1(주식)C3	전기	1.5415	0.4773	2.0188
	당기	1.5257	0.413	1.9387
거북이70자1(주식)Ce	전기	1.147	0.4535	1.6005
	당기	1.1482	0.427	1.5752

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

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평잔액(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 주식금액의 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 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용)의 자산운용회사인 '마이다스에셋자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 'KEB하나은행'의 확인을 받아 판매회사인 'KEB하나은행, 삼성생명보험, 삼성증권, 스탠다드차타드은행, 키움증권, 펀드온라인코리아, 한국씨티은행, 한국씨티은행(판매_한미(구))'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용
금융투자협회

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

/ 02-3787-3500

고객님이 가입하신 펀드는 펀드의 운용규모가 법적 기준 소규모상태(50억원 미만)에 해당하여 운용 시 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)