

자산운용보고서

마이다스 거북이 40 나눔 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)(운용)

(운용기간 : 2021.02.15 ~ 2021.05.14)

○자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며투자자가 가입한 상품의 특
정기간(3개월)동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다

마이다스에셋자산운용

서울시 종로구 경희궁길 20

(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
 - ▶ 환헤지를 위한 파생상품의 보유현황
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
4. 투자운용전문인력 현황
 - ▶ 투자운용인력(펀드매니저)
 - ▶ 해외 운용 수탁회사
5. 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
6. 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전율
 - ▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보

자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)(운용), 마이더스 거북이 증권 모투자신탁(주식), 마이더스 우량채권 증권 모투자신탁(채권), 마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호(채권혼합) Ae, 마이더스 거북이 40 나뉨 증권 자투자신탁 1호(채권혼합) C		5등급	AQ654 A9290 53840 AS489 AQ656
펀드의 종류	혼합채권형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2014.05.15
운용기간	2021.02.15 ~ 2021.05.14	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이더스에셋자산운용	펀드재산보관회사	하나은행
판매회사	국민은행	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	롱숏전략을 통하여 금리+α의 수익률을 추구하는 주식모펀드(마이더스 거북이 주식모)에 40% 이상 50 미만을 투자하며, 나머지는 채권모펀드(마이더스우량채권증권모)에 주로 투자합니다. 주식모펀드는 헤지 펀드의 주 운용전략인 롱숏 전략을 비롯한 다양한 전략(Event Driven, 차익거래)을 활용, 주가지수의 등락에 관계없이 안정적인 운용성과를 추구하며, 채권모펀드는 국공채와 우량채권 위주의 투자를 통한 안정적인 이자 수익을 추구합니다.		

▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
거북이40나뉨자1(채혼)(운용)	자산 총액(A)	4	4	-2.09
	부채총액(B)			0.00
	순자산총액(C=A-B)	4	4	-2.12
	발행 수익증권 총 수(D)	3	3	-0.17
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,145.90	1,123.56	-1.95
거북이40나뉨자1(채혼)(운용)	자산 총액(A)	4	4	-2.09
	부채총액(B)			0.00
	순자산총액(C=A-B)	4	4	-2.12
	발행 수익증권 총 수(D)	3	3	-0.17
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,145.90	1,123.56	-1.95
종류(Class)별 기준가격 현황				
거북이40나뉨자1(채혼)Ae	기준가격	1,102.12	1,078.93	-2.10
거북이40나뉨자1(채혼)C	기준가격	1,097.82	1,073.31	-2.23

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.

※ 분배금내역

(단위: 백만원, 백만좌)

구분	분배금지급일	분배금지급금액	분배후수탁고	기준가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
(운용)	2021. 5.17.	0	3	1123.56	1085.42	
C	2021. 5.17.	0		1073.31	1053.68	
Ae	2021. 5.17.	0	3	1078.93	1053.76	

주) 분배후수탁고는 재투자 0.186088 백만좌 포함입니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

펀드 수익률은 C 클래스 기준 -2.23%로 비교지수 대비 2.59%p 낮은 수준을 기록했습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

4월 KOSPI는 전월말 대비 2.82% 상승한 3,147.86pt로 마감하였습니다. 지수는 1) 월중 인플레이션 우려 완화에 따른 미 장기금리 안정화 및 2) 제조업 확장 가속화에 따른 외국인 순매수 유입을 바탕으로 월중 증가 기준 사상 최고치를 경신하였으나, 4월 FOMC 경계감과 5월 공매도 재개 우려, 사상 최고치 부담 등으로 인해 외국인 차익매물이 출회되며 지수는 상승폭 일부 반납하며 마감하였습니다. 업종별로는 섬유·의복(+19.9%), 철강금속(+16.8%), 운수항공(+9.1%) 업종 등이 KOSPI를 상회한 가운데, 의약품(-1.0%), 음식료품(-1.6%), 운수장비(-2.3%) 업종 등은 하락하였습니다.

시장은 4월 중순 이후로는 일부 기술적 부담이 완화된 가운데 경제지표 호조와 연준 및 글로벌 중앙은행의 완화적 스탠스를 재확인하며 상승 시도를 할 것으로 전망합니다. 5월초 공매도 재개는 단기적으로 국내 증시에 수급 부담을 줄 수 있을 것으로 판단되지만, 중장기 관점에서 그동안 매도로 일관되었던 외국인들의 투자확대로 이어질 것으로 보여 긍정적인 이벤트가 될 수 있을 것으로 판단합니다. 펀드는 모멘텀 축소 관점에서 일부 인터넷, 전기차, 화학 및 조선 업종 등을 차익실현하여 비중을 축소할 계획입니다. 반면, 백신 접종 확대 및 경제 회복에 대한 기대감에 따라 주가 상승이 기대되는 건설, 금융 및 자동차 업종 내 일부 종목에 대한 비중은 확대할 계획입니다.

▶ 기간(누적) 수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
거북이40나눔자1(채훈)(운용)	-1.95	4.29	3.03	8.58
(비교지수 대비 성과)	(-2.31)	(2.69)	(1.11)	(5.20)
종류(Class)별 현황				
거북이40나눔자1(채훈)Ae	-2.10	3.97	2.54	7.89
(비교지수 대비 성과)	(-2.46)	(2.37)	(0.62)	(4.51)
거북이40나눔자1(채훈)C	-2.23	3.69	2.12	7.33
(비교지수 대비 성과)	(-2.59)	(2.09)	(0.20)	(3.95)
비교지수(벤치마크)	0.36	1.60	1.92	3.38

주)비교지수(벤치마크): KOSPI X 4% + 매경BP 종합채권지수 국고채 1-2Y X 36% + [KIS 중단기지수(1-2Y) X 55% + KIS 중기지수(2-3Y) X 40% + CALL X 5%] X 60%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
거북이40나눔자1(채훈)(운용)	8.58	11.53	9.14	14.64
(비교지수 대비 성과)	(5.20)	(5.65)	(1.19)	(2.73)
종류(Class)별 현황				
거북이40나눔자1(채훈)Ae	7.89	10.12	7.06	11.00
(비교지수 대비 성과)	(4.51)	(4.24)	(-0.89)	(-0.91)
거북이40나눔자1(채훈)C	7.33	9.07	5.58	8.15
(비교지수 대비 성과)	(3.95)	(3.19)	(-2.37)	(-3.76)
비교지수(벤치마크)	3.38	5.88	7.95	11.91

주)비교지수(벤치마크): KOSPI X 4% + 매경BP 종합채권지수 국고채 1-2Y X 36% + [KIS 중단기지수(1-2Y) X 55% + KIS 중기지수(2-3Y) X 40% + CALL X 5%] X 60%

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

▶ 손익현황

(단위: 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
당기	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0

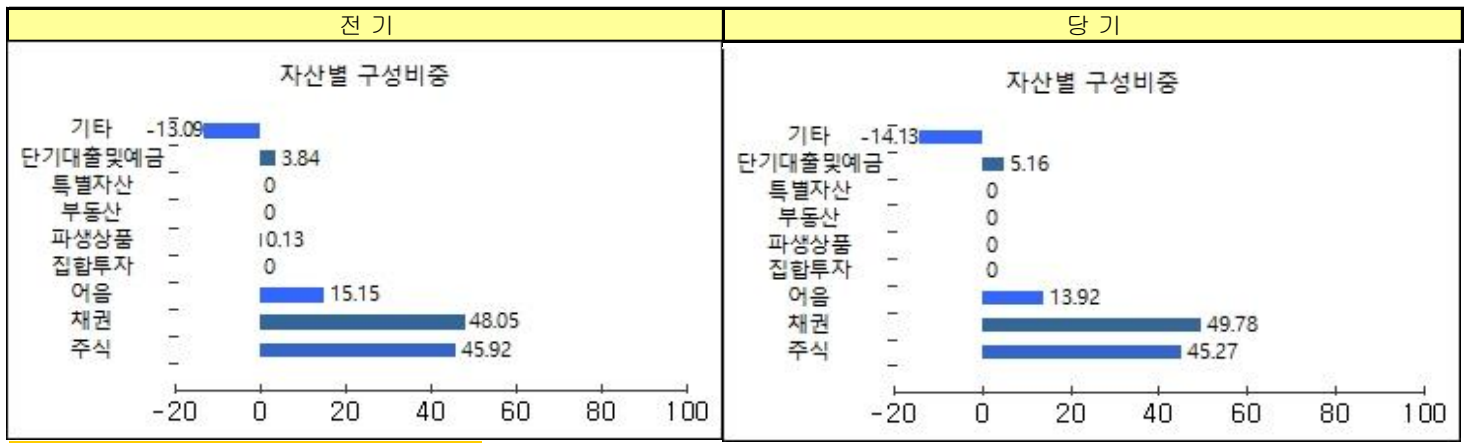
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW (1.00)	2 (45.27)	2 (49.78)	1 (13.92)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (5.16)	-1 (-14.13)	4 (100.00)
합계	2	2	1	0	0	0	0	0	0	0	-1	4

* (단위): 구성비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기전자	29.71	6	서비스업	6.36
2	IT H/W	13.12	7	의약품	3.86
3	제조	9.50	8	사업서비스	3.40
4	화학	8.01	9	금융업	3.11
5	운수장비	6.55	10	기타	16.38

▶ 국가별 투자비중

(단위 : %)

순위	국가명	비중	순위	국가명	비중
1	대한민국	100			



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	기타	REPO매도(20210514)	11.10	6	채권	인천국제공항공사130	2.96
2	주식	삼성전자	9.05	7	채권	쌍용씨앤이315	2.96
3	채권	한국전력939	3.01	8	채권	HDC현대EP1	2.95
4	채권	국고01875-2403(19-1)	2.99	9	채권	엠캐피탈274-1	2.95
5	채권	한국철도공사142	2.96	10	채권	하나금융지주47-1	2.93

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

(단위: 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	4		9.1	대한민국	KRW	전기전자	

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재 또는 발행주식 총수의 1% 초과 종목

▶ 채권

(단위: 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
한국전력939			대한민국	KRW	2018-04-19	2023-04-19		AAA	3.01
국고01875-2403(19-1)			대한민국	KRW	2019-03-10	2024-03-10		N/A	2.99
한국철도공사142			대한민국	KRW	2016-04-11	2023-04-11		AAA	2.96
인천국제공항공사130			대한민국	KRW	2016-04-21	2023-04-21		AAA	2.96
쌍용씨앤이315			대한민국	KRW	2020-09-25	2023-09-25		A-	2.96
HDC현대EP1			대한민국	KRW	2021-03-11	2024-03-11		A-	2.95
엠캐피탈274-1			대한민국	KRW	2021-02-05	2023-02-03		A-	2.95
하나금융지주47-1			대한민국	KRW	2020-05-11	2023-05-11		AAA	2.93

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

▶ 기타

(단위: 백만원)

종류	평가금액	비고
REPO매도	0	

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

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위: 개, 백만원)

성명	직위	나이	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
기민수 ^{주)}	본부장	42	15	313,104	0		2110000525
홍성철 ^{주)}	본부장	42	18	215,569	1	21,840	2113000811
김민수	차장	40	2	87,281	0		2111000836
양석원	과장	37	0		2	51,395	2114000826

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임투자운용인력이며, '책임투자운용인력'이란 투자운용인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함.

※ 펀드의 투자운용인력 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고하실 수 있습니다. (인터넷 주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 현회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이 할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2019.06.14 ~ 현재	홍성철
2020.01.17 ~ 현재	기민수
2018.03.16 ~ 현재	김민수
2020.09.01 ~ 현재	양석원
2017.11.24 ~ 2020.01.16	박정환
2014.05.15 ~ 2019.06.13	김지상
2014.05.15 ~ 2018.05.28	채경섭
2014.05.15 ~ 2018.03.15	정승호

▶ 해외운용수탁회사

회사명	소재	국가명	비고
			해당사항 없음

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급 현황

(단위: 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율 ^{주1)}	금액	비율 ^{주1)}	
거북이40나눔자1(채훈)(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 ^{주2)}	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.03	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.05
		합계	0	0.08	0	0.08
		증권거래세	0	0.09	0	0.08
거북이40나눔자1(채훈)Ae	자산운용사	0	0.10	0	0.10	
	판매회사	0	0.05	0	0.05	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.16	0	0.16	
	기타비용 ^{주2)}	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.03	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.05
		합계	0	0.08	0	0.08
		증권거래세	0	0.09	0	0.08

거북이40나눔자1(채혼)C	자산운용사	0	0.10	0	0.10	
	판매회사	0	0.20	0	0.19	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.30	0	0.29	
	기타비용 ^{주2)}	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.03	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.05
		합계	0	0.08	0	0.08
	증권거래세	0	0.09	0	0.08	

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

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

※ 성과보수내역 : 해당 없음

※ 발행분담금내역 : 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위: 연환산, %)

	구분	총보수·비용비율(A) ^{주1)}	매매·중개수수료비율(B) ^{주2)}	합계(A+B)
거북이40나눔자1(채혼)(운용)	전기	0.0045	0.2627	0.2672
	당기	0.0044	0.2798	0.2842
거북이40나눔자1(채혼)Ae	전기	0.6475	0.263	0.9105
	당기	0.6455	0.2799	0.9254
거북이40나눔자1(채혼)C	전기	1.1539	0.2629	1.4168
	당기	1.1729	0.2805	1.4534

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
354,711	11,668	300,167	12,164	71.39	292.78

주) 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율입니다. 매매회전율이 높을경우 매매거래수수료(0.1% 내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이

(단위: %)

2020-08-15 ~ 2020-11-14	2020-11-15 ~ 2021-02-14	2021-02-15 ~ 2021-05-14
59.42	82.47	71.39

7. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

▶ 고유재산 투자에 관한 사항

(단위: 원, %)

펀드명	투자금액	수익률	비고
해당사항 없음			

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 거북이 40 나눔 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)(운용)의 자산운용회사인 마이다스에셋자산 운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 하나은행의 확인을 받아 한국예탁결제원을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용(주)
금융투자협회

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

02-3787-3500