자산운용보고서

마이다스절대수익안정형증권투자회사[채권혼합]

(운용기간: 2009년09월16일~2009년12월15일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 집합투자업자가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

마이다스에셋자산운용(주)

(전화, 3787-3500)

목 차

- 1 집합투자기구의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 재산현황
- 2 운용경과 및 수익률현황
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 운용계획
 - ▶ 기간수익률
 - ▶ 연평균 수익률
 - ▶ 손익현황
- 3 자산현황
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 4 투자운용전문인력 현황
 - ▶ 책임운용전문인력
 - ▶ 해외 투자운용전문인력
- 5 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 6 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전율
 - ▶ 중개회사별 거래내역
- 7 이해관계인과의 거래 및 계열회사 발행증권 거래현황
 - ▶ 이해관계인과의 거래
 - ▶ 계열회사 발행증권 보유현황 및 비율
 - ▶ 계열회사 발행증권 거래내역
 - ▶ 계열회사 발행증권 대차거래 내역
- 8 의결권 공시대상 법인에 대한 의결권 행사여부 및 그 내용

1. 집합투자기구의 개요

▶ 기본정보 적용법률 : 자본시장법(간투법에서 전환)

위험등급: 3급

	집합투자기구 명칭	금융투자협회 펀드코드		
마이다스절대수익안정형	증권투자회사[채권혼합]	39386		
집합투자기구의 종류	혼합채권형(MF), 추가형, 일반형	최초설정일	2003.12.02	
운용기간	2009.09.16 ~ 2009.12.15	존속기간	추가형	
신탁업자	하나은행	일반사무관리회사	외환펀드서비스	
투자매매 · 중개업자	교보증권,대우증권,동부증권,신한금융투자,신한은행,하나대투	증권,한국씨티은행(판,한=	국투자증권	
상품의 특징	본 상품은 안정형 펀드로서 4개의 투자전략(포트폴리오 헤지; 래)을 복합적으로 사용하여 안정적인 수익률 달성을 목표로 합 20~30% 범위에서 편입하고 해당 자산만큼 선물을 매도하여 판 이상 초과수익 부분을 수익으로 추구하며, 채권의 경우 만기보; 축 및 채권발행기관에 대한 신용분석 등에 의한 적극적인 매매	니다. 주요전략인 포트폴리 번드는 주가변동방향과 관 유전략과 같은 소극적인 회	기오 헤지는 주식자산을 계없이 주식 포트폴리오의 지수 배권운용전략과 함께 이자율 예	

▶ **재산현황** (단위 : 백만원, 백만좌, %)

집합투자기구명칭	항목	전기말	당기말	증감률
	자산 총액 (A)	6,009	4,927	-18.00%
	부채 총액 (B)	464	17	-96.32%
절대수익안정형증권[채권혼합]	순자산총액 (C=A-B)	5,545	4,910	-11.44%
	발행 수익증권 총 수 (D)	5,177	4,869	-5.94%
	기준가격주) (E=C/D×1000)	1,071.11	1,008.50	0.85%

주) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환메)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령 시에 적용되는 가격으로 집합투자기 구의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드 수익률은3.75% 였습니다. 전략별로는 포트폴리오헷지 전략이 보유한 포트폴리오 성과가 지수대비 양호하여 이익을 올렸으며 선물 시스템 트레이딩과 옵션함성 전략의 경우 이번 분기 기여도는 미미한 수준이었습니다. Event Arbitrage의 경우 공모주 투자(SK C&C)에 성공하여 수익률에 플러스로 작용하였습니다. 동 기간 중 철강, 음식료, 의료정밀, 건설업증이 시장대비 초과성과를 기록하여 펀드수익률에 긍정적인 영향을 미쳤고 종이, 목재, 의약품 업종이 상대적으로 부진한 성과를 보였습니다. 종목별로는 CJ제일제당, POSCO, 오리온, 다음, LG화학등의 수익률이 양호하였고, LG디스플레이, LG전자, 동국제강, 한진중공업 등의 수익률이 부진하였습니다.

▶ 운용 계획

3분기까지 매우 양호한 실적을 보인 시장은 4분기 역시 최고수준의 실적을 보였습니다. 향후 주식시장은 그 동안의 단기주가상승에 대한 부담감으로 소폭의 등락이 진행될 것으로 예상되고 있으며 주요 거시경제 변수들이 시장에 영향을 미칠 것으로 판단하고 있습니다. 엔화 약세 및 달러화 강세, 양호한 소비지표, 회복하고 있는 고용지표, 출구전략 실행 가능성 등과 같은 거시경제 변수들이 주식시장에 영향을 미칠 것으로 전망되며, 주요 기업들의 4분기 실적이 양호할 것으로 예상되는 가운데 정부정책에 따른 수혜 및 피해 업종에 대한 적극적인 대응이 필요하다고 판단합니다. 전기전자, 자동차 등 경기 회복에 따른 소비증가에 대한 수혜를 받는 업종 중심으로 포트폴리오로 구성할 계획이며, 그 동안 큰 폭으로 상승하고, 미분양 관련 리스크가 있는 건설업종과 주가 상승 가능성이 적은 전기가스업, 제약업종은 포트폴리오에서 비중 축소할 계획입니다. 또한 개별종목 트레이딩과 선물시스템트레이딩 및 옵션합성전략에서 추가수익률 제고를 추구하도록 하겠습니다. 공모주 투자는 SK C&C, 한전기술, GKL 등에 투자 하여 대부분 수익을 올렸으며, 향후 투자대상 선정 시, 적정 공모가 여부와 실적호조 및 향후 성장성 등을 감안하여 선별 투자할 계획입니다.

▶ <mark>기간수익률</mark> (단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월	
절대수익안정형증권[채권혼합]	0.85	0.25	4.01	5.89	
비교지수(벤치마크)	0.74	6.39	15.92	15.47	

주) 비교지수(벤치마크) :

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

▶ **연평균 수익를** (단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년	
절대수익안정형증권[채권혼합]	5.89	3.94	4.08	5.78	
비교지수(벤치마크)	15.47	3.45	6.75	5.04	

주) 비교지수(벤치마크) :

 ▶ 손익현황
 (단위: 백만원)

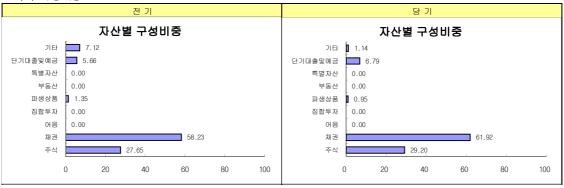
그브	증 권		파생	상품	부동산 특별		자산	단기대출	기타	손익합계		
구 군	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외	구중인	실물자산	기타	및 예금	기다	근막법계
전 기	290	16	0	0	-325	0	0	0	0	2	-17	-33
당 기	32	39	0	0	-21	0	0	0	0	2	-14	38

3. 자산현황

 ▶ 자산구성현황
 (단위: 백만원,%)

통화별		증 권			파생	상품	ㅂ도시	특별자산 부동산		단기대출및	기타	자산총액
구 분	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외	구동인	실물자산	기타	예금	기다	자신공학
KRW	1,439	3,051	0	0	47	0	0	0	0	335	56	4,927
(0.00)	(29.20)	(61.92)	(0.00)	(0.00)	(0.95)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(6.79)	(1.14)	(100.00)
합 계	1,439	3,051	0	0	47	0	0	0	0	335	56	4,927

* (): 구성 비중



▶ 투자대상 상위 10종목

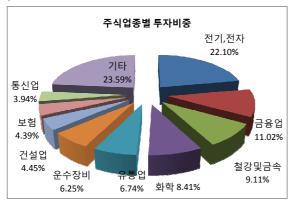
(단위 : %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	채권	통안0464-1110	61.92	6	주식	신한지주	1.01
2	단기상품	콜론(교보증권)	6.09	7	주식	현대차	0.99
3	주식	삼성전자	3.71	8	주식	하이닉스	0.99
4	주식	POSCO	2.06	9	주식	하나금융지주	0.98
5	주식	KB금융	1.23	10	단기상품	신한금융투자	0.95

▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

	종목명	비중		종목명	비중
1	전기,전자	22.10	6	운수장비	6.25
2	금융업	11.02	7	건설업	4.45
3	철강및금속	9.11	8	보험	4.39
4	화학	8.41	9	통신업	3.94
5	유통업	6.74	10	기타	23.59



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

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

■ 상위 5개 종목

단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	비고
삼성전자	235	182	12.69	
POSCO	170	101	7.04	
KB금융	971	60	4.21	
신한지주	1,068	49	3.46	
현대차	440	48	3.38	

▶ 채권

■ 상위 5개 종목

(단위:백만원,%)

종목명	액면가액	평가액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안0464-1110	3,000	3,050	2009-10-04	2011-10-04		N/A	100.00

▶ **장내파생상품** (단위:계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
KOSPI200선물1003	매도	12	1,309	46

주) 개별계약등의 위험평가액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	급해	급리	만기일
단기대출	교보증권	2009-12-15	300	2.05	2009-12-16

주) 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 책임운용전문인력

성명	성명 운용개시일		운용중인 다른 집합투자기구 현황		주요 경력 및 운용실적(최근5년)	협회등록번호	
		(연령)	집합투자기 운용 구의 수 규모				
박정환	2003-12-02	본부장	222	18,168억	국민투자신탁 한국투신운용 마이다스에셋 채권운용(2003년 9월 ~ 현재)	03-02002-0026	
		(44세)			마이다스퇴직연금증권모투자신탁(채권)		

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임 운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구 분	전기		당기		
	† こ	금액	비율	금액	비율	
	집합투자업자	6	0.11	6	0.11	
	투자매매 · 중개업자	8	0.14	7	0.13	
절대수익안정형증권[채권혼합]	신탁업자	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	1	0.01	1	0.01	
	보수합계	15	0.27	14	0.26	

^{*} 집합투자기구의 순자산총액 대비 비율

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

	구분	해당 집합투자기구			
	구군	총보수 · 비용비율	중개수수료 비율		
절대수익안정형증권[채권혼합]	전기	1.1867	0.1774		
글네ㅜㄱ같ㅎㅎㅎ전[세천본밥]	당기	1.1873	0.1415		

주) 총보수.비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 집합투자기구에서 부담하는 '보수'와 기타비용 총액을 순자산 연평잔액(보수.비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수.비용수준을 나타냄. 또한 모자형의 경우상위 집합투자기구에서 발생한 비용을 하위 집합투자기구가 차지하는 비율대로 안분하여, 합산(합성 총보수.비용비율)하여 보여 중

[※]성과보수가 있는 펀드 및 투자일임계약 운용규모 : 없음

[※] 성과보수내역 : 없음

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위:백만원,%)

OH	수	OH	매도 매매회전율주)		전율 _{주)}
수량	급액	수량 금액		해당기간	연환산
6,320	273	49,000	826	54.85	220.00

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

▶ 중개회사별 거래내역

알림) 비관계회사는 상위 1개사만을 명시합니다.

■ 주식

■ 주식									(단위 : 백	만원, %)	
		09-09-16 ~ 09-10-15			09-10-16	09-10-16 ~ 09-11-15			09-11-16 ~ 09-12-15		
구분 회사명	거래금액	수=	수수료 거래금액		수수료		거래금액	수=	표		
	4/10	(비중)	금액 (비중)	수수 료율	(비중)	금액 (비중)	수수 료율	(비중)	금액 (비중)	수수 료율	
비관계회사	우리투자증권	0	0	0.00	15	0	0.10	174	0	0.10	
미선계외자	구니구시증건	(0.00)	(0.00)	0.00	(1.78)	(1.78)	0.10	(100.00)	#####	0.10	

^{*} 주식의 총 거래금액 및 수수료에 대한 중개회사별 비중

(단위 : 백만원, %) ■ 그밖의 증권

		(10월)09-09-16 ~ 09-10-15			(11월)09-10-16 ~ 09-11-15			(12월)09-11-16 ~ 09-12-15		
구분	회사명	거래금액 (비중)	수수료		거래금액	수수료		거래금액	수수료	
, ,	4//10		금액 (비중)	수수 료율	(비중)	금액 (비중)	수수 료율	(비중)	금액 (비중)	수수 료율
비관계회사	NH투자증권	3,512 (26.67)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	3,054 (54.58)	0 (0.00)	0.00

^{*} 그밖의 증권 거래금액 및 수수료에 대한 중개회사별 비중

■ 파생상품 (단위 : 백만원, %)

		09-09-16 ~ 09-10-15		09-10-16 ~ 09-11-15			09-11-16 ~ 09-12-15			
구분	회사명	거래금액 수수료		수료	거래금액	수수료		거래금액	수수료	
1 2	4/10	(비중)	금액 (비중)	수수 료율	(비중)	금액 (비중)	수수 료율	(비중)	금액 (비중)	수수 료율
비관계회사	신한금융투자	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	323 (37.55)	0 (37.55)	0.01	2,546 (95.25)	0 (77.31)	0.01

^{*} 파생상품의 총 거래금액 및 수수료에 대한 중개회사별 비중

7. 이해관계인과의 거래 및 계열회사 발행증권 거래 현황

관계

▶ 이해관계인과의 거래

성명(상호)

(단위: 백만원, %) 거래종류 자산의 종류 거래금액 비고

해당없음

거래일자

▶ 계열회사 발행증권 보유현황 및 비율

♦ 해당집합투자기구 단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	보유금액(평가금액)	보유비율
	해당없음		

♦ 전체집합투자기구 단위 : 주, 백만원, %)

자산의 종류	보유수량	보유금액(평가금액)	보유비율
	해당없음		

▶ 계열회사 발행증권 거래 내역

거래구분	자산의 종류	종목명	매매방법 (거래상대방)	거래수량	거래금액	거래일자
•			해당없음	•	•	

▶ 계열회사 발행증권 대차거래 내역

종목명	구분	거래상대방	거래금액	거래조건	거래일시
	•	해당없음			•

8. 의결권 공시대상 법인에 대한 의결권 행사여부 및 그 내용

회사명	주주총회일 보유주식수	의안	의결권	면 행사내용(즉	불행사의 경우 그 사유			
전시 Q	구 등 의 교	エガナゴナ	Ü T	찬성	반대	불행사	호하시크 경추 <u>그</u> 시/휴	
계열회사								
<거래소>								
			해당없음					

<코스닥>	
	해당없음
<해외시장>	
	해당없음
비계열회사	
<거래소>	
	해당없음
<코스닥>	
	해당없음
<해외시장>	
	해당없음

※ 중립적 의결권 행사 종목

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스절대수익안정형증권투자회사[채권혼합]의 집합투자업자인 '마이다스에셋자산운용(주)'이 작성하여 신 탁업자인 '하나은행'의 확인을 받아 투자매매.중개업자인 '교보증권,대우증권,동부증권,신한금융투자,신한은행,하나대투증권,한국씨티은행(판, 한국투자증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 집합투자기구의 신탁업자 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용(주) http://www.midasasset.co

금융투자협회 <u>http://dis.fundservice.ne</u>