

자산운용보고서

((마이더스 퇴직연금 배당 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합

(운용기간 : 2016년10월09일 ~ 2017년01월08일)

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

마이더스에셋자산운용

서울시 영등포구 여의대로 66 KTB증권빌딩 8층
(전화 02-3787-3500, <http://www.midasasset.com>)

목 차

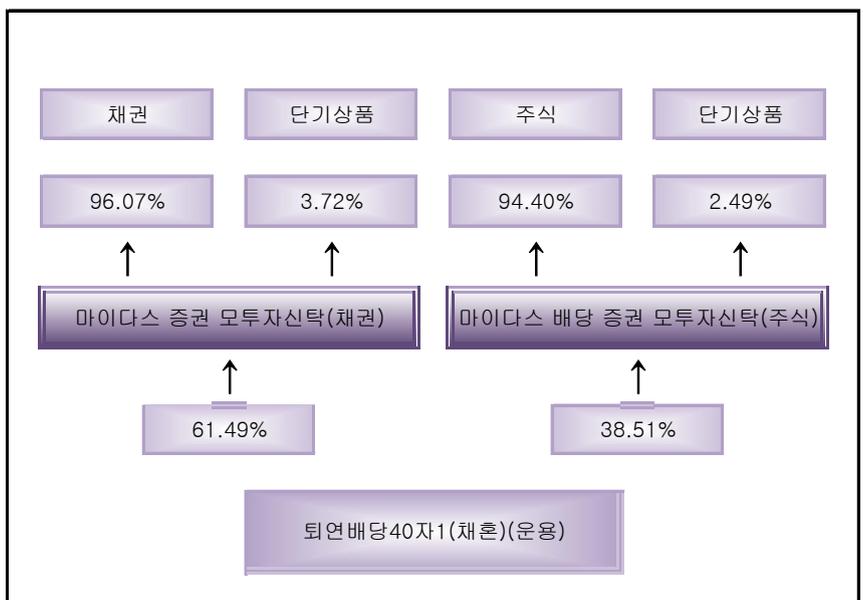
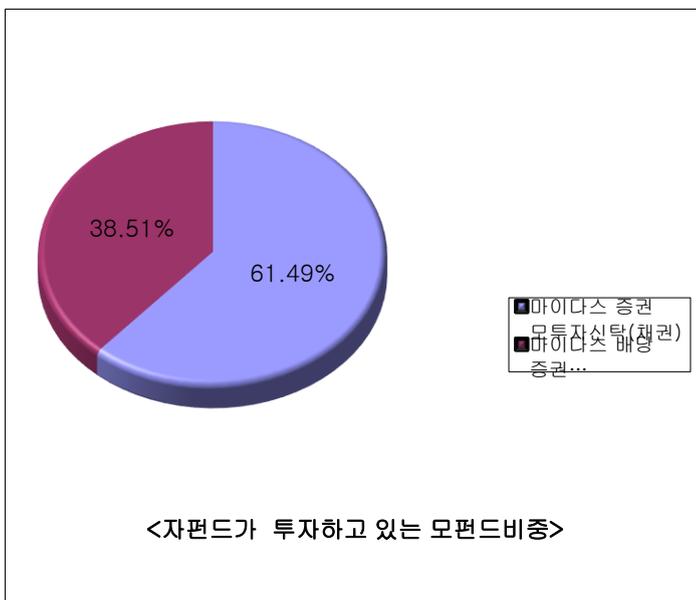
- 1 펀드의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 재산현황
- 2 운용경과 및 수익률현황
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 투자환경 및 운용계획
 - ▶ 기간(누적)수익률
 - ▶ 손익현황
- 3 자산현황
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 환헤지에 관한 사항
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 4 투자운용전문인력 현황
 - ▶ 투자운용인력
 - ▶ 운용전문인력 최근 변경 내역
- 5 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 6 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전율
 - ▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
마이더스 퇴직연금 배당 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)(운용), 마이더스 배당 증권 모투자신탁(주식), 마이더스 증권 모투자신탁(채권), 마이더스 퇴직연금 배당 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합) C		5등급	53842, 53841, 53840, A9518
펀드의 종류	혼합채권형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2006.01.09
운용기간	2016.10.09 ~ 2017.01.08	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이더스에셋자산운용	펀드재산보관회사	KEB하나은행
판매회사	HMC투자증권,KB증권(구 현대증권),KEB하나은행,NH투자증권,교보생명보험,국민은행,기업은행,농협(위탁판매),대구은행,대신증권,미래에셋대우,미래에셋생명,미래에셋증권,삼성생명보험,삼성증권,삼성화재해상보험,신영증권,신한금융투자,신한은행,우리은행,유안타증권,하나금융투자,한국투자증권,한화생명보험	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	본 상품은 근로자퇴직급여보장법 관련법령에 의하여 수익자의 노후생활을 대비하기 위한 자금 마련을 목적으로 하는 투자신탁이며, 마이더스증권모투자신탁(채권)에 신탁재산의 60%이상을, 마이더스 거북이주식모 투자신탁(주식)에 신탁재산의 40% 이하를 투자합니다. 마이더스 증권 모투자신탁(채권)은 채권에 신탁재산의 60% 이상을 투자하며, 국공채 및 우량회사채에 주로 투자하여 자본이득 및 이자소득을 추구합니다. 마이더스거북이주식모투자신탁(주식)은 주식에 신탁재산의 90%이상을 투자하며, 시가총액 상위 대형 우량주 중 배당수익률이 높은 주식에 주로 투자하여 배당수익을 얻으면서도 주가 상승시 수익률을 제고하는 것을 목표로 합니다.투자 주요 위험으로는 이 투자신탁이 투자하는 주식형 모투자신탁의 주가가격 변동위험과 채권형 모투자신탁의 주요위험인 금리변동 위험입니다.		

▶ 펀드 구성



※ 자펀드 자산현황을 100으로 가정하였을때 각 모펀드의 집합투자증권을 얼마만큼 투자하고 있는지를 보여줍니다.

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
퇴연배당40자1(채혼)(운용)	자산 총액 (A)	119,508	121,737	1.87
	부채 총액 (B)	106	74	-30.66
	순자산총액 (C=A-B)	119,402	121,663	1.89
	발행 수익증권 총 수 (D)	103,077	103,734	0.64
	기준가격(주) (E=C/D×1000)	1,158.37	1,172.84	1.25
종류(Class)별 기준가격 현황				
퇴연배당40자1(채혼)C	기준가격	995.91	1,006.34	1.05

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.

전기	329	125	0	0	4	0	0	0	0	15	-2	471
당기	1,414	78	0	0	-25	0	0	0	0	14	-2	1,478

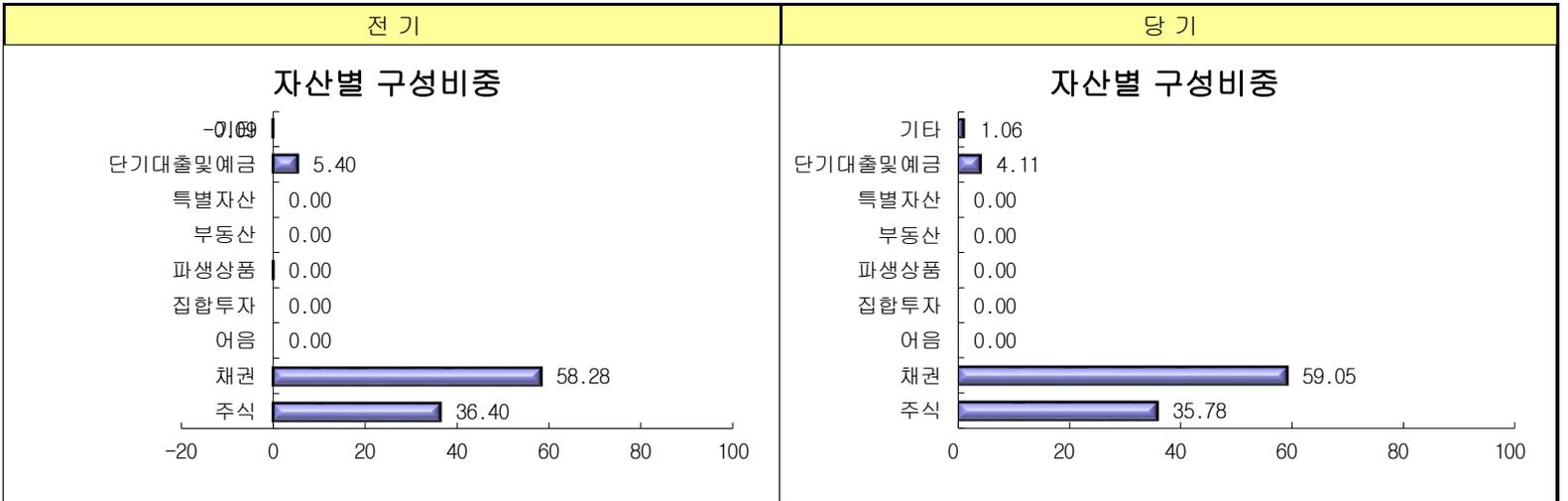
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	43,552	71,888	0	0	0	0	0	0	0	5,007	1,290	121,737
(0.00)	(35.78)	(59.05)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(4.11)	(1.06)	(100.00)
합계	43,552	71,888	0	0	0	0	0	0	0	5,007	1,290	121,737

* () : 구성 비중

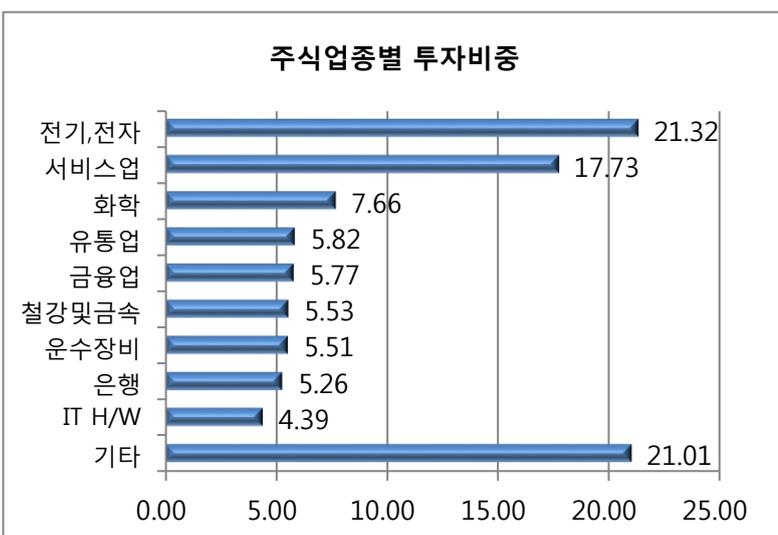


주) 위의 결과는 해당 자펀드의 실제 자산보유 내역을 투자자에게 보여주기 위해, 모펀드의 자산구성 내역을 해당 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율을 가중치로 적용하여 안분한 결과입니다. 실제 수익증권 기준으로 작성한 결과와 비교하여 상이한 결과가 발생할 수 있습니다.

▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기,전자	21.32	6	철강및금속	5.53
2	서비스업	17.73	7	운수장비	5.51
3	화학	7.66	8	은행	5.26
4	유통업	5.82	9	IT H/W	4.39
5	금융업	5.77	10	기타	21.01



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	채권	국고01750-1812(15-7)	19.69	6	채권	통안0125-1808-02	6.52
2	채권	국고02000-2009(15-4)	7.96	7	주식	삼성전자	4.19

3	채권	한국철도공사127	6.77	8	단기상품	REPO매수(20170106)	2.29
4	채권	예보상환기금채2013-3	6.69	9	파생상품	10년국채 F 201703	2.05
5	채권	산금16신이0106-1013-2	6.55	10	채권	현대제철115-2	2.05

※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

▶ 주식

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	2,816	5,097	4.19	대한민국	KRW	전기,전자	

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
국고01750-1812(15-7)	23,865	23,969	대한민국	KRW	2015-12-10	2018-12-10		N/A	19.69
국고02000-2009(15-4)	9,546	9,691	대한민국	KRW	2015-09-10	2020-09-10		N/A	7.96
한국철도공사127	7,955	8,240	대한민국	KRW	2014-04-16	2018-10-16		AAA	6.77
예보상환기금채2013-3	7,955	8,143	대한민국	KRW	2013-03-19	2018-03-19		N/A	6.69
산금16신이0106-1013-2	7,955	7,975	대한민국	KRW	2016-10-31	2018-04-30		AAA	6.55
통안0125-1808-02	7,955	7,934	대한민국	KRW	2016-08-02	2018-08-02		N/A	6.52
현대제철115-2	2,387	2,491	대한민국	KRW	2014-03-31	2019-03-31		AA0	2.05

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

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
10년국채 F 201703	매도	19	2,501	

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
REPO매수	한국자금융재	2017-01-06	2,916	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	
오종록	채권 책임운용역	1973	13	약 740억	-	-	2109000845
홍성철	주식 책임운용역	1980	4	약 1,312억	-	-	2109001266
김예리	주식 부책임운용역	1982	9	약 1,312억	-	-	2109001471

▶ 운용전문인력 최근 변경 내역

--	--	--

운용역	직위	운용 기간
허필석	책임운용역	2007.07.18 ~ 2013.06.30
오남훈	책임운용역	2013.07.01 ~ 2016.09.22
홍성철	책임운용역	2016.09.23 ~ 현재
오남훈	부책임운용역	2012.05.02 ~ 2013.06.30
김예리	부책임운용역	2013.07.01 ~ 현재

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
퇴연배당40자1(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**	1	0.00	1	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
퇴연배당40자1(채훈)C	자산운용사	69	0.06	69	0.06	
	판매회사	161	0.13	160	0.13	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	6	0.01	6	0.01	
	일반사무관리회사	5	0.00	4	0.00	
	보수합계	241	0.20	239	0.20	
	기타비용**	3	0.00	3	0.00	
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	61	0.05	52	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	61	0.05	52	0.04
		증권거래세	84	0.07	73	0.06

* 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, %)

	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	중개수수료 비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
퇴연배당40자1(채훈)(운용)	전기	0.0043	0.001	0.0043	0.001
	당기	0.0027	0.0004	0.0027	0.0004
종류(Class)별 현황					
퇴연배당40자1(채훈)C	전기	0.8046	0	0.8112	0.1499
	당기	0.8047	0	0.8113	0.1508

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.

주3) 모자형의 경우 모펀드에서 발생한 비용을 자펀드가 차지하는 비율대로 안분하여 합산한 수치입니다.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위 : 백만원, %)

배당(모펀드)(주식)

매수		매도		매매회전율주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
926,128	24,729	745,000	25,384	56.15	222.77

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

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

배당(모펀드)(주식)

16년04월09일 ~16년07월08일	16년07월09일 ~16년10월08일	16년10월09일 ~17년01월08일
24.38	64.65	56.15

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 퇴직연금 배당 40 증권 자투자신탁 1호(채권혼합)(운용)의 자산운용회사인 '마이다스에셋자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 'KEB하나은행'의 확인을 받아 판매회사인 'HMC투자증권,KB증권(구 현대증권),KEB하나은행,NH투자증권,교보생명보험,국민은행,기업은행,농협(위탁판매),대구은행,대신증권,미래에셋대우,미래에셋생명,미래에셋증권,삼성생명보험,삼성증권,삼성화재해상보험,신영증권,신한금융투자,신한은행,우리은행,유안타증권,하나금융투자,한국투자증권,한화생명보험'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기가에 하합니다

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용 <http://www.midasasset.co> / 02-3787-3500
 금융투자협회 <http://dis.fundservice.net>