자산운용보고서

마이다스 뉴트렌드 30 증권 투자신탁(채권혼합)(운용)

(운용기간 : 2017.06.09 ~ 2017.09.08)

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

마이다스에셋자산운용

서울시영등포구여의도동23-3

(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
뉴트렌드30(채혼)(운용), 뉴트렌드30(채혼)A, 뉴트렌드30(채혼)C, 뉴트렌드30(채혼)C-P, 뉴트렌드30(채혼)Ce, 뉴트렌드30(채혼)S, 뉴트렌드30(채혼)S-P		4등급	B0147, B0148, B0149, B0153, B0150, B0155, B0156
펀드의 종류	혼합채권형, 추가형, 종류형	최초설정일	2015.03.09
운용기간	2017.06.09 ~ 2017.09.08	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이다스에셋자산운용	펀드재산보관회사	신한은행
판매회사	교보증권, 대신증권, 하나금융투자, 유안타증권, 현대차투자증권, 펀드온라인코리아, 미래에셋대우, 키움증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	이 투자신탁은 국내 채권을 주된 투자대상자산으로 하여 신탁재산의 90% 이하를 투자하고 국내 주식에 신탁재산의 30% 이하를 투자하여 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다. 국공채, 지방채, 특수채 등 우량채권에 투자하며 듀레이션을 최대한 중립적으로 유지하는 전략을 활용하여 금리변동 위험에 대비해 안정적인 채권이자수익을 추구합니다. 주식 전략에서는 '핵심 포트폴리오(Core Portfolio)'를 구성하여 적극적인 초과성과를 추구합니다.		

▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
뉴트렌드30(채혼)(운용)	자산 총액(A)	9,882	4,197	-57.53
	부채총액(B)	3,064	13	-99.57
	순자산총액(C=A-B)	6,818	4,184	-38.63
	발행 수익증권 총 수(D)	6,417	3,889	-39.39
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,062.47	1,075.78	1.25
종류(Class)별 기준가격 현황				
뉴트렌드30(채혼)A	기준가격	1,060.65	1,071.40	1.01
뉴트렌드30(채혼)C	기준가격	1,057.45	1,067.10	0.91
뉴트렌드30(채혼)Ce	기준가격	1,045.95	1,056.68	1.03
뉴트렌드30(채혼)C-P	기준가격	1,045.57	1,055.92	0.99
뉴트렌드30(채혼)S	기준가격	1,061.32	1,072.76	1.08
뉴트렌드30(채혼)S-P	기준가격	1,046.66	1,058.13	1.10

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

해당 분기 펀드는 Class A 기준 1.01%의 수익률을 기록하여 비교지수를 0.93% 초과하는 성과를 거두었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

9월 증시는 지정학적 불확실성 완화 속에 위험자산 선호심리가 회복되며 전월대비 약 1.32% 상승 전환하였습니다. 경기 회복세 및 실적 개선 전망 지속에 글로벌, 선진국, 신흥국 주식시장의 동반 상승의 주요인으로 작용하는 모습이었습니다. 글로벌, 선진국, 신흥국의 12개월 예상 EPS 전망치는 각각 전월말 대비 +1.8%, +1.4%, +3.5% 상향 조정되었으며, 한국은 지정학적 리스크 완화, IT 및 헬스케어 섹터 선전에 10월 연휴에 따른 차익 실현 심리에도 불구 2,400선 근접하는 등 강세를 나타냈습니다. 당초 우려와 달리 반도체를 중심으로 3분기 실적이 양호할 것이라는 기대감이 투자심리 회복에 기여한 모습이었습니다.
- 업종별로는 반도체 가격 강세와 2차전지 모멘텀이 강화된 IT가 큰 폭 상승했으며, 제약, 정유,게임 업종의 강세가 나타냈습니다. 반면 제품 가격 약세가 나타난 철강,규제이슈가 부각된 통신,유통,건설,유틸리티,은행 등이 약세를 나타내는 등 업종별 양극화가 뚜렷한 모습 이었습니다. .
10월 주식시장은 미국의 완만한 금리인상 모드 재확인 속 달러화 약세에 기반한 신흥국 중심의 우호적인 환경 기대되고 있습니다. 한국의 지정학적 리스크가 지속적으로 이어지고 있으나, 인플레이션 압력 둔화와 양호한 경제 지표가 지속되고 있어, 증시 모멘텀은 전월에 이어 개선세가 이어질 것으로 예상됩니다. 특히 연휴 이후 본격화되는 3분기 실적 시즌에서 반도체를 중심으로 한 양호한 실적이 예상되고 있는 점도 긍정적 요인으로 작용할 전망입니다.
KOSPI 3분기 영업이익은 전년동기 대비 43% 증가한 50.1조원으로 사상 최대치를 기록할 것으로 전망되고 있습니다. 순이익 기준으로도 2분기에는 일부 기업의 분할에 따른 중단영업처분이익이 반영되었다는 점을 감안한다면, 3분기 실적이 사상 최대일 것으로 전망되고 있습니다. 현재 KOSPI 3분기 순이익 전망치는 35.4조원이며 이는 전년동기 대비 48% 증가하는 수치입니다. 다만 기술주를 중심으로 한 밸류에이션 고평가 논란과 대북 리스크와 미국의 통상압력, 미 연준의 자산 축소 시작에 따른 시중 금리의 변동성 확대 가능성 등이 지수 전고점 수준 상승세를 제한하는 요인으로 작용할 가능성이 있는 것으로 판단됩니다.

▶기간(누적) 수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
뉴트렌드30(채혼)(운용)	1.25	6.14	8.30	7.81
(비교지수 대비 성과)	(1.17)	(2.30)	(3.19)	(3.23)
종류(Class)별 현황				
뉴트렌드30(채혼)A	1.01	5.64	7.54	6.81
(비교지수 대비 성과)	(0.93)	(1.80)	(2.43)	(2.23)
뉴트렌드30(채혼)C	0.91	5.43	7.22	6.39
(비교지수 대비 성과)	(0.83)	(1.59)	(2.11)	(1.81)
뉴트렌드30(채혼)Ce	1.03	5.67	7.58	6.86
(비교지수 대비 성과)	(0.95)	(1.83)	(2.47)	(2.28)
뉴트렌드30(채혼)C-P	0.99	5.59	7.47	6.71
(비교지수 대비 성과)	(0.91)	(1.75)	(2.36)	(2.13)
뉴트렌드30(채혼)S	1.08	5.78	7.74	7.08
(비교지수 대비 성과)	(1.00)	(1.94)	(2.63)	(2.50)
뉴트렌드30(채혼)S-P	1.10	5.81	7.80	7.15
(비교지수 대비 성과)	(1.02)	(1.97)	(2.69)	(2.57)
비교지수(벤치마크)	0.08	3.84	5.11	4.58

주)비교지수(벤치마크): 국고채1~2년 X 73% + KOSPI X 27%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
뉴트렌드30(채혼)(운용)	7.81	8.87	-	-
(비교지수 대비 성과)	(3.23)	(-0.11)	-	-
종류(Class)별 현황				
뉴트렌드30(채혼)A	6.81	6.84	-	-
(비교지수 대비 성과)	(2.23)	(-2.14)	-	-
뉴트렌드30(채혼)C	6.39	5.99	-	-
(비교지수 대비 성과)	(1.81)	(-2.99)	-	-
뉴트렌드30(채혼)Ce	6.86	6.95	-	-
(비교지수 대비 성과)	(2.28)	(-2.03)	-	-
뉴트렌드30(채혼)C-P	6.71	6.63	-	-
(비교지수 대비 성과)	(2.13)	(-2.35)	-	-
뉴트렌드30(채혼)S	7.08	7.38	-	-
(비교지수 대비 성과)	(2.50)	(-1.60)	-	-
뉴트렌드30(채혼)S-P	7.15	7.53	-	-
(비교지수 대비 성과)	(2.57)	(-1.45)	-	-
비교지수(벤치마크)	4.58	8.98	0.00	0.00

주)비교지수(벤치마크): 국고채1~2년 X 73% + KOSPI X 27%

※ 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	295	31	0	0	0	0	0	0	0	3	3	332
당기	68	10	0	0	0	0	0	0	0	2	0	79

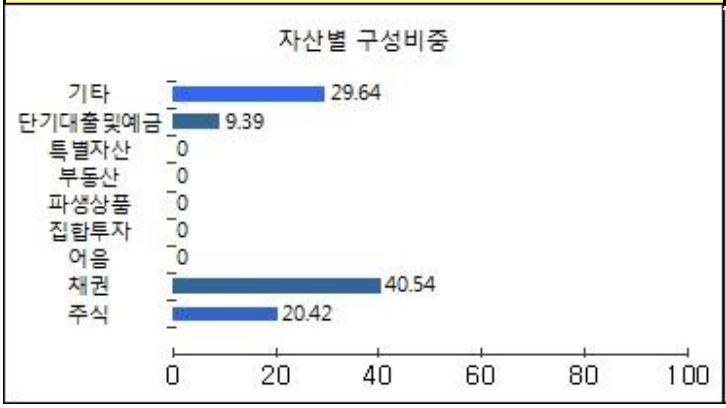
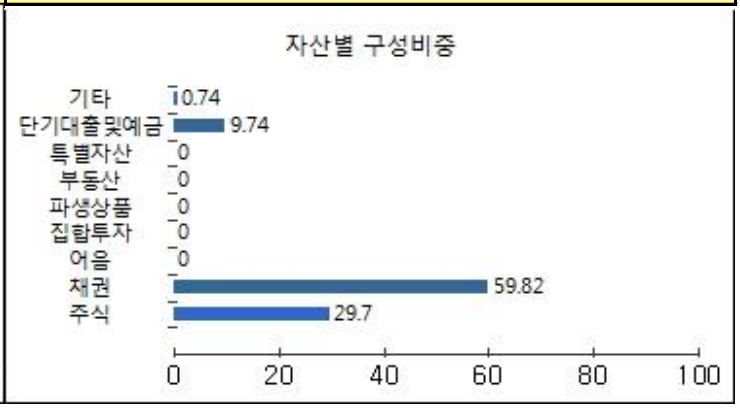
3. 자산현황

▶ 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)	1,247 (29.70)	2,511 (59.82)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	409 (9.74)	31 (0.74)	4,197 (100.00)
합계	1,247	2,511	0	0	0	0	0	0	0	409	31	4,197

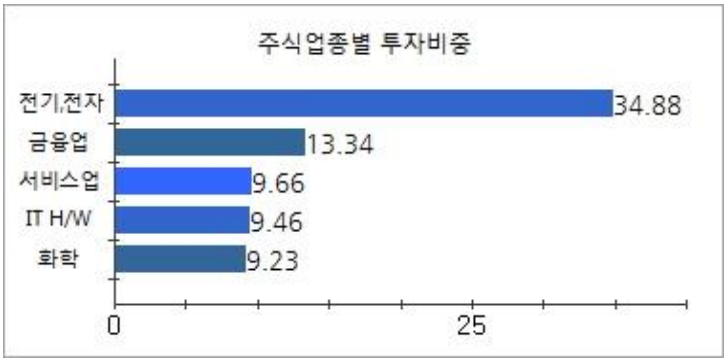
*(괄): 구성비중

전 기	당 기
	

▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기,전자	34.88	6	제조	5.70
2	금융업	13.34	7	철강및금속	2.73
3	서비스업	9.66	8	보험	2.64
4	IT H/W	9.46	9	IT S/W & SVC	2.15
5	화학	9.23	10	기타	10.21



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	채권	국고01750-2006(17-2)	59.82	6	주식	엔씨소프트	1.94
2	단기상품	REPO매수(20170908)	7.15	7	주식	LG화학	1.69
3	주식	삼성전자	5.85	8	주식	카카오	0.93
4	단기상품	은대	2.60	9	주식	KB금융	0.90
5	주식	SK하이닉스	2.42	10	주식	SK	0.75

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

(단위: 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	100	245	5.9	대한민국	KRW	전기,전자	
SK하이닉스	1,400	102	2.4	대한민국	KRW	전기,전자	
엔씨소프트	180	82	1.9	대한민국	KRW	서비스업	
LG화학	190	71	1.7	대한민국	KRW	화학	
카카오	300	39	0.9	대한민국	KRW	서비스업	
KB금융	730	38	0.9	대한민국	KRW	금융업	
SK	120	31	0.8	대한민국	KRW	금융업	

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
국고01750-2006(17-2)	2,500	2,511	대한민국	KRW	2017-06-10	2020-06-10		N/A	59.82

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
REPO매수	미래에셋대우(채권상품	2017-09-08	300	1.30		대한민국	KRW
예금	신한은행	2015-03-09	109	0.92		대한민국	KRW

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

▶ 기타

(단위: 백만원)

종류	평가금액	비고
국내단기상품	300	

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	
이하윤 주)	팀장	38	4	183,563	0		2110000009
정승호	부장	1	1	690,647	0		211000746

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
2015.03.09 ~ 현재	이하윤
2015.03.09 ~ 현재	정승호
2017.06.21 ~ 2017.06.23	강경식
2016.08.25 ~ 2016.08.29	강경식

▶ 해외운용수탁회사

회사명	소재	국가명	비고

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급 현황

(단위: 백만원, %)

	구분		전기		당기	
			금액	비율 주1)	금액	비율 주1)
뉴트렌드30(채혼)(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	5	0.07	4	0.07
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	5	0.07	4	0.07
	증권거래세		9	0.13	7	0.13
	자산운용사		1	0.10	1	0.10
	판매회사		1	0.13	1	0.13
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.01	0	0.01

뉴트렌드30(채혼)A	보수합계		1	0.24	1	0.24
	기타비용 주2)		0	0.00	0	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.07	0	0.07
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.07	0	0.07
	증권거래세		1	0.12	1	0.13
뉴트렌드30(채혼)C	자산운용사		6	0.10	4	0.10
	판매회사		13	0.23	10	0.23
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.01	0	0.01
	보수합계		20	0.34	14	0.34
	기타비용 주2)		0	0.00	0	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	4	0.07	3	0.07
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	4	0.07	3	0.07
	증권거래세		7	0.13	5	0.13
뉴트렌드30(채혼)Ce	자산운용사		0	0.10	1	0.10
	판매회사		0	0.11	1	0.11
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.00	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.01
	보수합계		0	0.22	1	0.22
	기타비용 주2)		0	0.00	0	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.07	0	0.07
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.07	0	0.07
	증권거래세		0	0.09	1	0.13
뉴트렌드30(채혼)C-P	자산운용사		0	0.10	0	0.10
	판매회사		0	0.15	0	0.15
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.00	0	0.00
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		0	0.26	0	0.26
	기타비용 주2)		0	0.00	0	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.07	0	0.07
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.07	0	0.07
	증권거래세		0	0.12	0	0.13
뉴트렌드30(채혼)S	자산운용사		0	0.10	0	0.10
	판매회사		0	0.06	0	0.06
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.01	0	0.01
	보수합계		1	0.17	0	0.17
	기타비용 주2)		0	0.00	0	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.07	0	0.07
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.07	0	0.07
	증권거래세		0	0.12	0	0.11
뉴트렌드30(채혼)S-P	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	0.07	0	0.07
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.07	0	0.07
	증권거래세		0	0.12	0	0.13

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율을 나타냅니다.
** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예탁 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)
뉴트렌드30(채혼)(운용)	전기	0.0034	0.22	0.2234
	당기	0.0035	0.243	0.2465
뉴트렌드30(채혼)A	전기	0.9455	0.2225	1.168
	당기	0.9454	0.2493	1.1947
뉴트렌드30(채혼)C	전기	1.3459	0.2199	1.5658
	당기	1.3459	0.2419	1.5878
뉴트렌드30(채혼)Ce	전기	0.8928	0.2228	1.1156
	당기	0.8946	0.2697	1.1643
뉴트렌드30(채혼)C-P	전기	1.0418	0.2273	1.2691
	당기	1.042	0.2535	1.2955
뉴트렌드30(채혼)S	전기	0.6949	0.2264	0.9213
	당기	0.6949	0.2435	0.9384
뉴트렌드30(채혼)S-P	전기	0.6224	0.2165	0.8389
	당기	0.6222	0.2406	0.8628

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.
주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위: 백만원, %)

뉴트렌드30(채혼)(운용)

매수		매도		매매회전율 주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
55,110	1,575	69,112	2,428	146.51	581.26

주) 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 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: %)

뉴트렌드30(채혼)(운용)

2016-12-09 ~ 2017-03-08	2017-03-09 ~ 2017-06-08	2017-06-09 ~ 2017-09-08
94.15	146.83	146.51

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 뉴트렌드 30 증권 투자신탁(채권혼합)(운용)의 자산운용회사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 신한은행의 확인을 받아 한국예탁결제원을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용(주) http://www.midasasset.com/ 02-3787-3500
금융투자협회 http://dis.kofia.or.kr

고객님이 가입하신 펀드는 펀드의 운용규모의 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 제 192조 제1항, 동법 시행령 제 223조 제3호 및 제4호)