

# 자산운용보고서

마이다스 4.0 차세대유망 목표전환형 증권 투자신탁(채권)운용

(운용기간 : 2018.01.28 ~ 2018.04.27)

○자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며투자자가 가입한 상품의 특  
정기간(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                |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|----------------------------|
| 마이더스 4.0 차세대유망 목표전환형 증권 투자신탁(채권)운용,<br>마이더스 4.0 차세대유망 목표전환형 증권 투자신탁(채권)A,<br>마이더스 4.0 차세대유망 목표전환형 증권 투자신탁(채권)C-I,<br>마이더스 4.0 차세대유망 목표전환형 증권 투자신탁(채권)C-P1 |                                                                                                                                   | 5등급      | BS593, BS594, BS596, BS597 |
| 펀드의 종류                                                                                                                                                    | 채권형, 단위형, 종류형                                                                                                                     | 최초설정일    | 2017.07.28                 |
| 운용기간                                                                                                                                                      | 2018.01.28 ~ 2018.04.27                                                                                                           | 존속기간     | 2018.07.28                 |
| 자산운용회사                                                                                                                                                    | 마이더스에셋자산운용                                                                                                                        | 펀드재산보관회사 | KEB하나은행                    |
| 판매회사                                                                                                                                                      | NH농협은행, 기업은행, 대구은행, 대신증권, 신한은행, 유안타증권, 키움증권, 하나금융투자, 한국투자증권, 현대차투자증권                                                              | 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스                    |
| 상품의 특징                                                                                                                                                    | 이 투자신탁은 최초설정일부터 운용전환일 전까지 주로 국내주식에 투자하여 수익을 추구하는 것을 목적으로 하고, 목표기준가격에 도달한 후 주식을 전부 매도하여 운용전환일 이후에는 국내채권에 주로 투자하여 안정적인 이자수익을 추구합니다. |          |                            |

## ▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

| 펀드명칭                      | 항목                | 전기말      | 당기말      | 증감률    |
|---------------------------|-------------------|----------|----------|--------|
| 4.0차세대유망목전(채권)(운용)        | 자산 총액(A)          | 625      | 503      | -19.57 |
|                           | 부채총액(B)           |          |          | -0.48  |
|                           | 순자산총액(C=A-B)      | 625      | 503      | -19.57 |
|                           | 발행 수익증권 총 수(D)    | 591      | 474      | -19.89 |
|                           | 기준가격 (E=C/Dx1000) | 1,056.70 | 1,060.89 | 0.40   |
| <b>종류(Class)별 기준가격 현황</b> |                   |          |          |        |
| 4.0차세대유망목전(채권)A           | 기준가격              | 1,054.34 | 1,058.05 | 0.35   |
| 4.0차세대유망목전(채권)C-I         | 기준가격              | 1,055.13 | 1,058.90 | 0.36   |
| 4.0차세대유망목전(채권)C-P1        | 기준가격              | 1,054.21 | 1,057.96 | 0.36   |

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

펀드 수익률은 A클래스 기준 0.35%를 달성하였습니다.

## ▶ 투자환경 및 운용 계획

18년 4월 국내 채권시장은 기준금리 만장일치 동결로 중기 이하 금리(국고2년 2.126%, -1.1bp)는 소폭 하락하였습니다. 그러나 물가 상승 우려 등으로 미국 장기 금리가 급등함에 따라 국내 장기 금리(국고10년 2.717%, +7.9bp) 역시 동반 상승하며 수익률 곡선은 가팔라졌습니다(국고3-10년 스프레드:50.0bps, +8.2bp). 연내 기준금리 인상 스탠스로 중기 이하 금리 하단은 제한적일 것으로 보입니다. 3월 광공업생산은 전월비 -2.5%로 부진한 가운데, 4월 수출 역시 전년비 -1.5% 기록하는 등 국내 경기 여건은 부진한 것으로 판단함에 따라 기준 금리 인상 속도는 점진적일 것으로 전망합니다. 연준 금리 인상 경계감 등이 금리 상방 요인으로 작용하겠으나, 이미 시장 금리가 긴축 가능성을 상당 부분 선반영하고 있음에 따라 장기 금리의 추가 급등 가능성 역시 제한적인 것으로 판단합니다.

## ▶ 기간(누적) 수익률

(단위 : %)

| 구분                 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 12개월 |
|--------------------|--------|--------|--------|---------|
| 4.0차세대유망목전(채권)(운용) | 0.40   | 0.73   | 6.09   | -       |
| (비교지수 대비 성과)       | -      | -      | -      | -       |

| 종류(Class)별 현황      |      |      |      |      |
|--------------------|------|------|------|------|
| 4.0차세대유망목전(채권)A    | 0.35 | 0.64 | 5.81 | -    |
| (비교지수 대비 성과)       | -    | -    | -    | -    |
| 4.0차세대유망목전(채권)C-I  | 0.36 | 0.65 | 5.89 | -    |
| (비교지수 대비 성과)       | -    | -    | -    | -    |
| 4.0차세대유망목전(채권)C-P1 | 0.36 | 0.64 | 5.80 | -    |
| (비교지수 대비 성과)       | -    | -    | -    | -    |
| 비교지수(벤치마크)         | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

주)비교지수(벤치마크): BM없음

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

| 구분                 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|--------------------|-------|-------|-------|-------|
| 4.0차세대유망목전(채권)(운용) | -     | -     | -     | -     |
| (비교지수 대비 성과)       | -     | -     | -     | -     |
| 종류(Class)별 현황      |       |       |       |       |
| 4.0차세대유망목전(채권)A    | -     | -     | -     | -     |
| (비교지수 대비 성과)       | -     | -     | -     | -     |
| 4.0차세대유망목전(채권)C-I  | -     | -     | -     | -     |
| (비교지수 대비 성과)       | -     | -     | -     | -     |
| 4.0차세대유망목전(채권)C-P1 | -     | -     | -     | -     |
| (비교지수 대비 성과)       | -     | -     | -     | -     |
| 비교지수(벤치마크)         | 0.00  | 0.00  | 0.00  | 0.00  |

주)비교지수(벤치마크): BM없음

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

### ▶ 손익현황

(단위: 백만원)

| 구분 | 증권 |    |    |      | 파생상품 |    | 부동산 | 특별자산 |    | 단기대출 및<br>예금 | 기타 | 손익합계 |
|----|----|----|----|------|------|----|-----|------|----|--------------|----|------|
|    | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내   | 장외 |     | 실물자산 | 기타 |              |    |      |
| 전기 | 0  | 3  | 0  | 0    | 0    | 0  | 0   | 0    | 1  | 0            | 3  |      |
| 당기 | 0  | 2  | 0  | 0    | 0    | 0  | 0   | 0    | 0  | 0            | 2  |      |

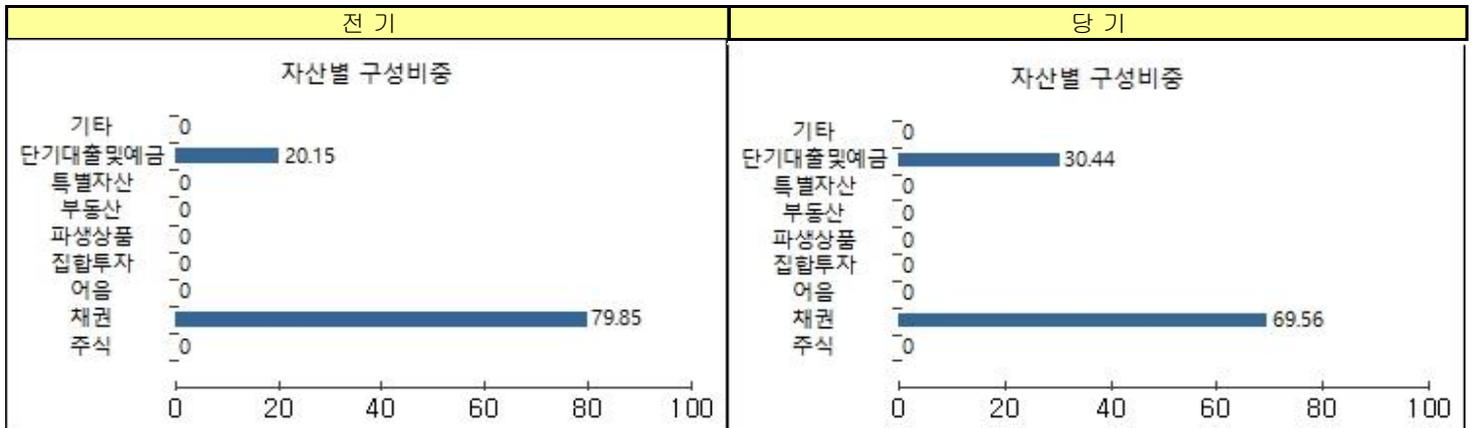
## 3. 자산현황

### ▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

| 통화별<br>구분 | 증권     |         |        |        | 파생상품   |        | 부동산    | 특별자산   |         | 단기대출<br>및 예금 | 기타       | 자산총액 |
|-----------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|--------------|----------|------|
|           | 주식     | 채권      | 어음     | 집합투자   | 장내     | 장외     |        | 실물자산   | 기타      |              |          |      |
| KRW       | 0      | 350     | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      | 153     | 0            | 503      |      |
| (1.00)    | (0.00) | (69.56) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (30.44) | (0.00)       | (100.00) |      |
| 합계        | 0      | 350     | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      | 153     | 0            | 503      |      |

\* (단위): 구성비중



### ▶ 국가별 투자비중

(단위: %)

| 순위 | 국가명  | 비중     | 순위 | 국가명 | 비중 |
|----|------|--------|----|-----|----|
| 1  | 대한민국 | 100.00 |    |     |    |
|    |      |        |    |     |    |
|    |      |        |    |     |    |
|    |      |        |    |     |    |

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

| 순위 | 구분 | 종목명            | 비중    | 순위 | 구분 | 종목명 | 비중 |
|----|----|----------------|-------|----|----|-----|----|
| 1  | 채권 | 통안0133-1810-02 | 69.56 |    |    |     |    |
| 2  | 단기 | 은대             | 30.44 |    |    |     |    |
|    |    |                |       |    |    |     |    |
|    |    |                |       |    |    |     |    |

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 채권 (단위: 백만원, %)

| 종목명            | 액면가액 | 평가액 | 발행국가 | 통화  | 발행일        | 상환일        | 보증기관 | 신용등급 | 비중    |
|----------------|------|-----|------|-----|------------|------------|------|------|-------|
| 통안0133-1810-02 | 350  | 350 | 대한민국 | KRW | 2016-10-02 | 2018-10-02 |      | N/A  | 69.56 |

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 | 2017-07-28 | 153 | 1.15 |     | 대한민국 | KRW |

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      |            |
| 오남훈 <sup>주)</sup> | 본부장 | 41 | 10         | 67,836  | 1                       | 1,216,621 | 2109001266 |
| 정승호               | 부장  | 3  | 1          | 690,647 | 0                       |           | 211000746  |
| 문종규               | 과장  | 35 | 1          | 20,000  | 0                       |           | 2113000596 |

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            |
|-----------------|-------------------|
| 2017.07.28 ~ 현재 | 정승호<br>오남훈<br>문종규 |
| 2017.07.28 ~ 현재 |                   |
| 2017.07.28 ~ 현재 |                   |

▶ 해외운용수탁회사

| 회사명 | 소재 | 국가명 | 비고 |
|-----|----|-----|----|
|     |    |     |    |

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급 현황

(단위: 백만원, %)

|                    | 구분                  | 전기                  |                   | 당기   |                   |      |
|--------------------|---------------------|---------------------|-------------------|------|-------------------|------|
|                    |                     | 금액                  | 비율 <sup>주1)</sup> | 금액   | 비율 <sup>주1)</sup> |      |
| 4.0차세대유망목적(채권)(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 <sup>주2)</sup> | 0                   | 0.00              | 0    | 0.00              |      |
|                    | 매매<br>중개<br>수수료     | 단순매매, 중개수수료         | 0                 | 0.00 | 0                 | 0.00 |
|                    |                     | 조사분석업무 등<br>서비스 수수료 | 0                 | 0.00 | 0                 | 0.00 |
|                    |                     | 합계                  | 0                 | 0.00 | 0                 | 0.00 |
|                    |                     | 증권거래세               | 0                 | 0.00 | 0                 | 0.00 |

|                    |                 |                     |      |      |      |      |
|--------------------|-----------------|---------------------|------|------|------|------|
| 4.0차세대유망목전(채권)A    | 자산운용사           | 0                   | 0.03 | 0    | 0.02 |      |
|                    | 판매회사            | 0                   | 0.01 | 0    | 0.01 |      |
|                    | 펀드재산보관회사(신탁업자)  | 0                   | 0.01 | 0    | 0.01 |      |
|                    | 일반사무관리회사        | 0                   | 0.01 | 0    | 0.00 |      |
|                    | 보수합계            | 0                   | 0.05 | 0    | 0.04 |      |
|                    | 기타비용(주2)        |                     | 0    | 0.00 | 0    | 0.00 |
|                    | 매매<br>중개<br>수수료 | 단순매매, 중개수수료         | 0    | 0.00 | 0    | 0.00 |
|                    |                 | 조사분석업무 등<br>서비스 수수료 | 0    | 0.00 | 0    | 0.00 |
|                    |                 | 합계                  | 0    | 0.00 | 0    | 0.00 |
|                    | 증권거래세           | 0                   | 0.00 | 0    | 0.00 |      |
| 4.0차세대유망목전(채권)C-I  | 자산운용사           | 0                   | 0.03 | 0    | 0.02 |      |
|                    | 판매회사            | 0                   | 0.00 | 0    | 0.00 |      |
|                    | 펀드재산보관회사(신탁업자)  | 0                   | 0.01 | 0    | 0.01 |      |
|                    | 일반사무관리회사        | 0                   | 0.01 | 0    | 0.00 |      |
|                    | 보수합계            | 0                   | 0.04 | 0    | 0.04 |      |
|                    | 기타비용(주2)        |                     | 0    | 0.00 | 0    | 0.00 |
|                    | 매매<br>중개<br>수수료 | 단순매매, 중개수수료         | 0    | 0.00 | 0    | 0.00 |
|                    |                 | 조사분석업무 등<br>서비스 수수료 | 0    | 0.00 | 0    | 0.00 |
|                    |                 | 합계                  | 0    | 0.00 | 0    | 0.00 |
|                    | 증권거래세           | 0                   | 0.00 | 0    | 0.00 |      |
| 4.0차세대유망목전(채권)C-P1 | 자산운용사           | 0                   | 0.02 | 0    | 0.02 |      |
|                    | 판매회사            | 0                   | 0.01 | 0    | 0.01 |      |
|                    | 펀드재산보관회사(신탁업자)  | 0                   | 0.01 | 0    | 0.01 |      |
|                    | 일반사무관리회사        | 0                   | 0.00 | 0    | 0.00 |      |
|                    | 보수합계            | 0                   | 0.04 | 0    | 0.04 |      |
|                    | 기타비용(주2)        |                     | 0    | 0.00 | 0    | 0.00 |
|                    | 매매<br>중개<br>수수료 | 단순매매, 중개수수료         | 0    | 0.00 | 0    | 0.00 |
|                    |                 | 조사분석업무 등<br>서비스 수수료 | 0    | 0.00 | 0    | 0.00 |
|                    |                 | 합계                  | 0    | 0.00 | 0    | 0.00 |
|                    | 증권거래세           | 0                   | 0.00 | 0    | 0.00 |      |

\* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율을 나타냅니다.

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

※ 성과보수내역 : 해당 없음

※ 발행분담금내역 : 해당 없음

## ▶ 총보수, 비용비율

(단위: 연환산,%)

|                    | 구분 | 총보수·비용비율(A) <sup>주1)</sup> | 매매·중개수수료비율(B) <sup>주2)</sup> | 합계(A+B) |
|--------------------|----|----------------------------|------------------------------|---------|
| 4.0차세대유망목전(채권)(운용) | 전기 | 0.0044                     | 2.2429                       | 2.2473  |
|                    | 당기 | 0.0044                     | 2.1918                       | 2.1962  |
| 4.0차세대유망목전(채권)A    | 전기 | 0.994                      | 2.2458                       | 3.2398  |
|                    | 당기 | 0.9818                     | 2.2121                       | 3.1939  |
| 4.0차세대유망목전(채권)C-I  | 전기 | 0.3021                     | 0.8216                       | 1.1237  |
|                    | 당기 | 0.256                      | 0.5489                       | 0.8049  |
| 4.0차세대유망목전(채권)C-P1 | 전기 | 0.9516                     | 1.7821                       | 2.7337  |
|                    | 당기 | 0.9278                     | 1.7281                       | 2.6559  |

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, %)

4.0차세대유망목전(채권)(운용)

| 매수 |    | 매도 |    | 매매회전율 <sup>주)</sup> |      |
|----|----|----|----|---------------------|------|
| 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 해당기간                | 연환산  |
| 0  | 0  | 0  | 0  | 0.00                | 0.00 |

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.

4.0차세대유망목전(채권)(운용)

| 2017-07-28 ~ 2017-10-27 | 2017-10-28 ~ 2018-01-27 | 2018-01-28 ~ 2018-04-27 |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 429.84                  | 0.00                    | 0.00                    |

## 공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 4.0 차세대유망 목표전환형 증권 투자신탁(채권)운용의 자산운용회사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 KEB하나은행의 확인을 받아 한국예탁결제원을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용(주)  
금융투자협회

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

02-3787-3500

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)