

자산운용보고서

마이다스 커버드콜 증권 투자회사(주식)(운용)

(운용기간 : 2018.06.18 ~ 2018.09.17)

○ 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률이하자본시장법에 의거 자산운용회사가작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(개월) 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 커버드콜 증권 투자회사(주식)(운용), 마이더스 커버드콜 증권 투자회사(주식)A1, 마이더스 커버드콜 증권 투자회사(주식)C3, 마이더스 커버드콜 증권 투자회사(주식)C5, 마이더스 커버드콜 증권 투자회사(주식)S		3등급	34270, 71281, 28691, 28693, BL175
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형	최초설정일	2002.04.19
운용기간	2018.06.18 ~ 2018.09.17	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이더스에셋자산운용	펀드재산보관회사	국민은행
판매회사	KB증권, KEB하나은행, NH투자증권, 교보생명보험, 교보증권, 국민은행, 대신증권, 미래에셋대우, 발기자본금, 삼성증권, 스탠다드차타드은행, 신한금융투자, 신한은행, 펀드온라인코리아, 하나금융투자, 하이투자증권, 한국씨티은행, 한국투자증권, 한화투자증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	이 투자회사는 자산의 60% 이상을 주식에 주로 투자함으로써 자본이득과 배당소득을 얻는 것을 목적으로 합니다. 특히 주식을 보유하고 있는 상태에서 콜옵션을 매도하는 커버드콜 전략을 활용하여 추가하락 위험을 부분적으로 방어하면서 추가수익을 추구하여 그 수익을 회사의 주주에게 분배하는 것을 목적으로 합니다.		

▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
커버드콜MF(주식)(운용)	자산 총액(A)	8,422	8,073	-4.15
	부채총액(B)	78	28	-64.57
	순자산총액(C=A-B)	8,344	8,045	-3.58
	발행 수익증권 총 수(D)	8,618	8,580	-0.44
	기준가격 (E=C/Dx1000)	968.22	937.65	-3.16
종류(Class)별 기준가격 현황				
커버드콜MF(주식)A1	기준가격	965.14	931.75	-3.46
커버드콜MF(주식)C3	기준가격	948.90	918.92	-3.16
커버드콜MF(주식)C5	기준가격	904.25	871.86	-3.58
커버드콜MF(주식)S	기준가격	965.85	933.16	-3.38

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

펀드수익률은 A1 클래스 기준 -3.46%로 비교지수 대비 0.42%p 낮은 수준을 기록했습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

8월 국내 시장은 KOSPI는 +1.20%, KOSDAQ +5.34%로 반등세가 나타났습니다. 8월 초 미국 달러화 강세가 신흥국 투자심리를 전반적으로 위축시켰고, 2분기 실적시즌 이후 하반기 실적 불확실성 높아지며 KOSPI 지수는 2,240선까지 하락하였으나, 중순 이후 미-중 무역협상 재개에 따른 기대감 확대 및 달러 강세 압력 둔화에 위험자산 선호심리 개선되며 반등세가 진행되었습니다. 업종별로는 종이, 목재(+15.0%), 의약품(+11.3%), 섬유, 의복(+9.6%) 등이 강세를 나타낸 반면, 전기가스(-8.1%), 음식료품(-6.2%), 보험(-4.1%) 등이 약세를 나타냈습니다.

▶ 기간(누적) 수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
커버드콜MF(주식)(운용)	-3.16	-6.23	-5.47	-3.63
(비교지수 대비 성과)	(-0.12)	(-0.69)	(-0.41)	(-1.53)
종류(Class)별 현황				
커버드콜MF(주식)A1	-3.46	-6.82	-6.35	-4.82
(비교지수 대비 성과)	(-0.42)	(-1.28)	(-1.29)	(-2.72)
커버드콜MF(주식)C3	-3.16	-6.24	-5.47	-3.63
(비교지수 대비 성과)	(-0.12)	(-0.70)	(-0.41)	(-1.53)

커버드콜MF(주식)C5	-3.58	-7.06	-6.71	-5.30
(비교지수 대비 성과)	(-0.54)	(-1.52)	(-1.65)	(-3.20)
커버드콜MF(주식)S	-3.38	-6.68	-6.14	-4.53
(비교지수 대비 성과)	(-0.34)	(-1.14)	(-1.08)	(-2.43)
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률	-3.58	-7.06	-6.71	-5.30
(비교지수 대비 성과)	(-0.54)	(-1.52)	(-1.65)	(-3.20)
비교지수(벤치마크)	-3.04	-5.54	-5.06	-2.10

주)비교지수(벤치마크): KOSPI X 75% + CD91 X 25%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
커버드콜MF(주식)(운용)	-3.63	9.49	8.33	11.11
(비교지수 대비 성과)	(-1.53)	(-2.79)	(-5.53)	(-3.05)
종류(Class)별 현황				
커버드콜MF(주식)A1	-4.82	6.84	4.39	4.42
(비교지수 대비 성과)	(-2.72)	(-5.44)	(-9.47)	(-9.74)
커버드콜MF(주식)C3	-3.63	8.71	6.43	4.88
(비교지수 대비 성과)	(-1.53)	(-3.57)	(-7.43)	(-9.28)
커버드콜MF(주식)C5	-5.30	5.77	2.82	1.81
(비교지수 대비 성과)	(-3.20)	(-6.51)	(-11.04)	(-12.35)
커버드콜MF(주식)S	-4.53	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-2.43)	-	-	-
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률	5.77	5.77	2.83	1.89
(비교지수 대비 성과)	(-3.20)	(-6.51)	(-11.03)	(-12.11)
비교지수(벤치마크)	-2.10	12.28	13.86	14.16

주)비교지수(벤치마크): KOSPI X 75% + CD91 X 25%

※ 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	-374	0	0	0	95	0	0	0	0	3	-1	-278
당기	-274	0	0	0	10	0	0	0	0	3	-1	-262

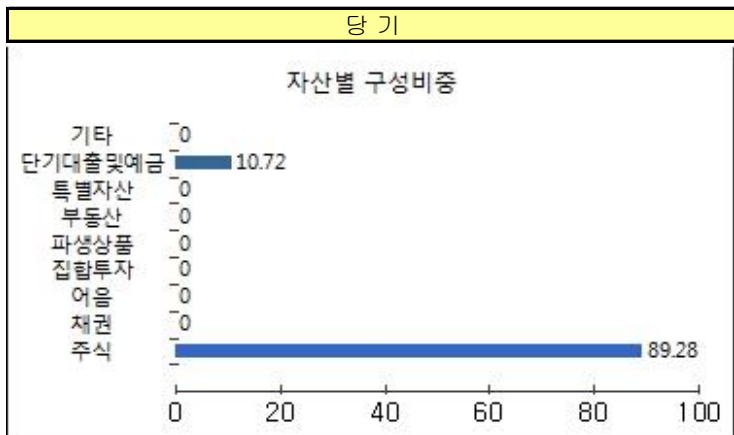
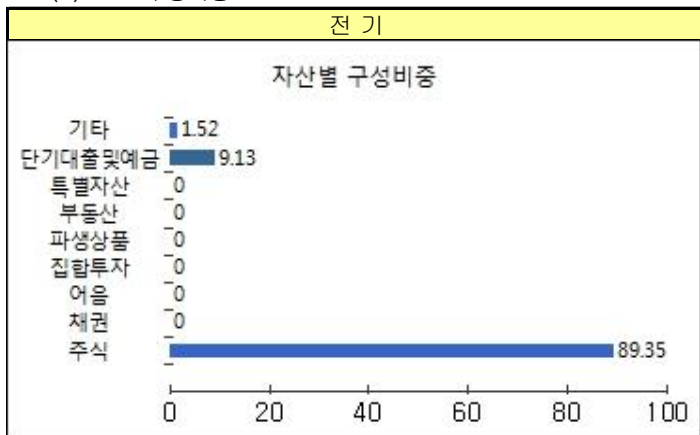
3. 자산현황

▶ 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)	7,207 (89.28)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	865 (10.72)	0 (0.00)	8,073 (100.00)
합계	7,207	0	0	0	0	0	0	0	0	865	0	8,073

* (단위): 구성비중



▶ **주식업종별 투자비중**

(단위 : %)

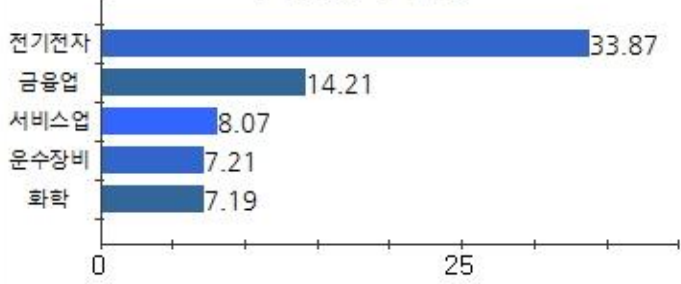
순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기전자	33.87	6	의약품	6.10
2	금융업	14.21	7	유통업	4.08
3	서비스업	8.07	8	통신업	3.91
4	운수장비	7.21	9	철강및금속	3.52
5	화학	7.19	10	기타	11.84

▶ **국가별 투자비중**

(단위 : %)

순위	국가명	비중	순위	국가명	비중
1	대한민국	100.00			

주식업종별 투자비중



▶ **투자대상 상위 10종목**

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	주식	삼성전자	21.81	6	주식	SK텔레콤	2.62
2	단기	REPO매수(20180917)	9.91	7	주식	NAVER	2.27
3	주식	SK하이닉스	4.60	8	주식	SK	2.26
4	주식	KB금융	2.82	9	주식	현대차	2.24
5	주식	셀트리온	2.81	10	주식	삼성물산	2.24

▼ **각 자산별 보유종목 내역**

▶ **주식** (단위: 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	39,000	1,761	21.8	대한민국	KRW	전기전자	
SK하이닉스	4,810	371	4.6	대한민국	KRW	전기전자	
KB금융	4,511	227	2.8	대한민국	KRW	금융업	
셀트리온	750	227	2.8	대한민국	KRW	의약품	
SK텔레콤	760	212	2.6	대한민국	KRW	통신업	
NAVER	252	183	2.3	대한민국	KRW	서비스업	
SK	647	182	2.3	대한민국	KRW	금융업	
현대차	1,407	181	2.2	대한민국	KRW	운수장비	
삼성물산	1,439	181	2.2	대한민국	KRW	유통업	

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

▶ **단기대출 및 예금**

(단위: 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
REPO매수	미래에셋자산운용 (우정사업본부)	2018-09-17	800	1.64		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	
송형섭 ^{주)}	팀장	45	1	8,621	1	30,000	2109000914

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
2015.07.23 ~ 현재	송형섭
2017.03.08 ~ 2018.05.28	채경섭
2015.07.23 ~ 2015.11.01	김민겸

▶ 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)}	
커버드콜MF(주식)(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)}	1	0.01	1	0.01	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	1	0.01	1	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	1	0.01	1	0.01
		합계	2	0.02	2	0.02
	증권거래세	3	0.03	2	0.03	
커버드콜MF(주식)A1	자산운용사	14	0.16	13	0.16	
	판매회사	11	0.12	10	0.12	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	1	0.01	1	0.01	
	일반사무관리회사	1	0.02	1	0.02	
	보수합계	27	0.31	24	0.31	
	기타비용 ^{주2)}	1	0.01	1	0.02	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	1	0.01	1	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	1	0.01	1	0.01
		합계	2	0.02	2	0.02
	증권거래세	3	0.03	2	0.03	
커버드콜MF(주식)C3	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	0.01	0	0.01	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.01	0	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.01	0	0.01
		합계	0	0.02	0	0.02
	증권거래세	0	0.03	0	0.03	

커버드콜MF(주식)C5	자산운용사		0	0.16	0	0.16	
	판매회사		0	0.25	0	0.25	
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사		0	0.02	0	0.02	
	보수합계		1	0.44	1	0.44	
	기타비용 ^{주2)}		0	0.01	0	0.02	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료		0	0.01	0	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료		0	0.01	0	0.01
		합계		0	0.02	0	0.02
	증권거래세		0	0.03	0	0.03	
커버드콜MF(주식)S	자산운용사		0	0.16	0	0.16	
	판매회사		0	0.05	0	0.05	
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사		0	0.01	0	0.01	
	보수합계		0	0.24	0	0.23	
	기타비용 ^{주2)}		0	0.01	0	0.01	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료		0	0.01	0	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료		0	0.02	0	0.01
		합계		0	0.03	0	0.02
	증권거래세		0	0.05	0	0.03	

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 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) ^{주1)}	매매·중개수수료비율(B) ^{주2)}	합계(A+B)
커버드콜MF(주식)(운용)	전기	0.0442	0.2071	0.2513
	당기	0.0484	0.1457	0.1941
커버드콜MF(주식)A1	전기	1.2824	0.2071	1.4895
	당기	1.2863	0.1459	1.4322
커버드콜MF(주식)C3	전기	0.1931	0.2446	0.4377
	당기	0.0513	0.1404	0.1917
커버드콜MF(주식)C5	전기	1.7895	0.2257	2.0152
	당기	1.7926	0.1399	1.9325
커버드콜MF(주식)S	전기	0.9821	0.174	1.1561
	당기	0.9833	0.1664	1.1497

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위: 백만원, %)

커버드콜MF(주식)(운용)

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
6,679	801	14,806	828	11.48	45.54

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: %)

커버드콜MF(주식)(운용)

2017-12-18 ~ 2018-03-17	2018-03-18 ~ 2018-06-17	2018-06-18 ~ 2018-09-17
52.55	9.62	11.48

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 커버드콜 증권 투자회사(주식)(운용)의 자산운용회사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 국민은행의 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/>

02-3787-3500

<http://dis.kofia.or.kr>