

자산운용보고서

마이다스 퇴직연금 배당 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용)

(운용기간 : 2019.01.18 ~ 2019.04.17)

○ 자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 자본시장법)에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(6개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

마이다스에셋자산운용

서울시 종로구 경희궁길 20

(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 |
|---|---|----------|----------------------------------|
| 마이다스 퇴직연금 배당 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용) 마이다스 배당 증권 모투자신탁(주식) 마이다스 퇴직연금 배당 증권 자투자신탁 1호(주식)C 마이다스 퇴직연금 배당 증권 자투자신탁 1호(주식)Ce | | 3등급 | 71602 53841 BT423 BT424 |
| 펀드의 종류 | 주식형, 추가형, 종류형, 모자형 | 최초설정일 | 2007.07.18 |
| 운용기간 | 2019.01.18 ~ 2019.04.17 | 존속기간 | 추가형으로 별도의 존속기간이 없음 |
| 자산운용회사 | 마이다스에셋자산운용 | 펀드재산보관회사 | KEB하나은행 |
| 판매회사 | KB증권, NH투자증권, 대신증권, 미래에셋대우, 미래에셋생명, 삼성증권, 신영증권, 하나금융투자, 현대차투자증권 | 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스 |
| 상품의 특징 | 이 투자신탁은 수익자의 노후생활을 대비하기 위한 자금마련을 목적으로 하며, 퇴직연금 투자신탁 자산의 대부분을 모투자신탁인 마이다스 배당 증권 모투자신탁(주식)에 투자하여 모투자신탁이 투자하는 주식으로부터 자본이득과 배당소득을 얻는 것을 목적으로 합니다. | | |

▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

| 펀드명칭 | 항목 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|--------------------|-------------------|--------|----------|--------|
| 퇴연배당자1(주식)(운용) | 자산 총액(A) | 808 | 884 | 9.45 |
| | 부채총액(B) | 1 | 1 | -14.27 |
| | 순자산총액(C=A-B) | 807 | 884 | 9.47 |
| | 발행 수익증권 총 수(D) | 843 | 854 | 1.23 |
| | 기준가격 (E=C/Dx1000) | 957.21 | 1,035.16 | 8.14 |
| 퇴연배당자1(주식)(운용) | 자산 총액(A) | 808 | 884 | 9.45 |
| | 부채총액(B) | 1 | 1 | -14.27 |
| | 순자산총액(C=A-B) | 807 | 884 | 9.47 |
| | 발행 수익증권 총 수(D) | 843 | 854 | 1.23 |
| | 기준가격 (E=C/Dx1000) | 957.21 | 1,035.16 | 8.14 |
| 종류(Class)별 기준가격 현황 | | | | |
| 퇴연배당자1(주식)C | 기준가격 | 940.01 | 1,013.65 | 7.83 |
| 퇴연배당자1(주식)Ce | 기준가격 | 873.10 | 942.42 | 7.94 |

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 C클래스 기준 7.83%로 비교지수 대비 1.24%p 높은 성과를 기록하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

3월 KOSPI 지수는 전월 대비 2.49% 하락한 2,140.67pt로 마감하였습니다. MSCI신흥국지수내 중국A주 편입비중 확대에 따라 국내 증시 비중이 축소되어 국내 증시는 월초부터 하락하였습니다. 또한, 외국인 패시브 자금의 매도세가 증시를 압박하는 가운데 유럽중앙은행의 2019년 유로존 경기 전망 하향 조정으로 글로벌 경기둔화 우려가 확대된 점이 증시 하방 압력으로 작용하였습니다.

3월 미국 연방준비제도(Fed)가 FOMC에서 완화적인 통화정책 기조를 보임에 따라 달러화의 단기적 약세가 나타났고, 반도체 업종을 중심으로 외국인 매수세가 집중되며 수급이 개선되는 모습을 보였습니다. 그러나 FOMC 성명서에 드러난 미국 경기둔화 우려가 재차 부각되며 KOSPI는 하락 마감하였습니다.

3월 미국 FOMC에서 자산축소 조기종료 및 금리 동결을 통한 완화적 입장은 확인되었고 이는달러화 약세 요인으로서 신흥국 통화의 상대적 강세 기대감은 외국인 매수 재개요인으로 판단됩니다. 중국 정부의 경기부양책 효과가 실물경제지표에 일부 반영되고 있다고 판단됩니다. 전반적인 위안화 강세 기대감은 유효하여 주식시장에 우호적으로 작용할 것으로 전망됩니다. 삼성전자와 SK하이닉스 등 반도체 기업들의 실적 부진은 지속될 수 있으나, 이는 주식시장에 상당 부분 반영돼 있기 때문에 주가 충격은 제한적일 것으로 예상됩니다.

▶ 기간(누적) 수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 12개월 |
|----------------|--------|---------|---------|---------|
| 퇴연배당자1(주식)(운용) | 8.14 | 3.13 | -2.51 | -9.19 |
| (비교지수 대비 성과) | (1.55) | (-0.49) | (-0.25) | (-0.72) |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 퇴연배당자1(주식)C | 7.83 | 2.53 | -3.38 | -10.29 |
| (비교지수 대비 성과) | (1.24) | (-1.09) | (-1.12) | (-1.82) |
| 퇴연배당자1(주식)Ce | 7.94 | 2.73 | -3.08 | -9.92 |
| (비교지수 대비 성과) | (1.35) | (-0.89) | (-0.82) | (-1.45) |
| 비교지수(벤치마크) | 6.59 | 3.62 | -2.26 | -8.47 |

주)비교지수(벤치마크): KOSPI X 100%

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

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|----------------|---------|--------|--------|---------|
| 퇴연배당자1(주식)(운용) | -9.19 | 9.77 | 19.33 | 26.44 |
| (비교지수 대비 성과) | (-0.72) | (5.10) | (7.86) | (13.70) |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 퇴연배당자1(주식)C | -10.29 | - | - | - |
| (비교지수 대비 성과) | (-1.82) | - | - | - |
| 퇴연배당자1(주식)Ce | -9.92 | - | - | - |
| (비교지수 대비 성과) | (-1.45) | - | - | - |
| 비교지수(벤치마크) | -8.47 | 4.67 | 11.47 | 12.74 |

주)비교지수(벤치마크): KOSPI X 100%

※ 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 | -40 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -40 |
| 당기 | 66 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 66 |

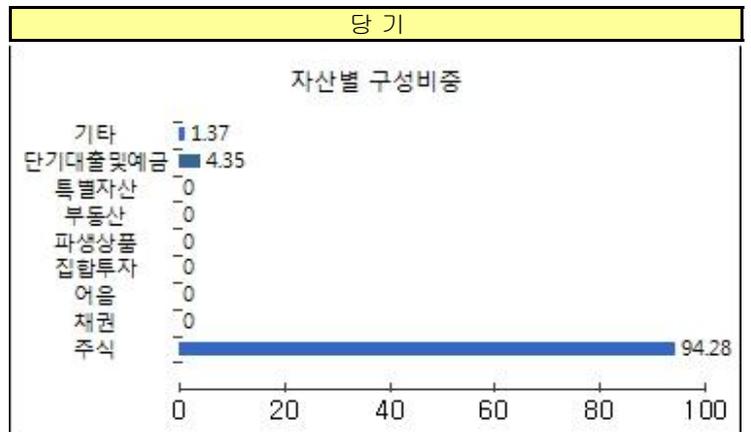
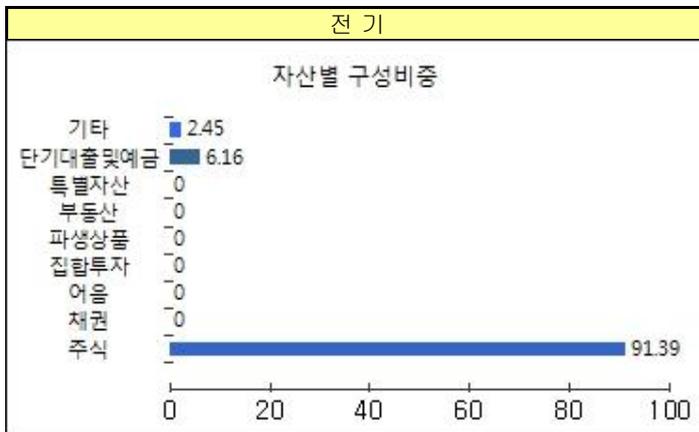
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

| 통화별 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|-----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------------|--------|----------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| KRW | 834 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 38 | 12 | 884 |
| (1.00) | (94.28) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (4.35) | (1.37) | (100.00) |
| 합계 | 834 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 38 | 12 | 884 |

* (단위): 구성비중

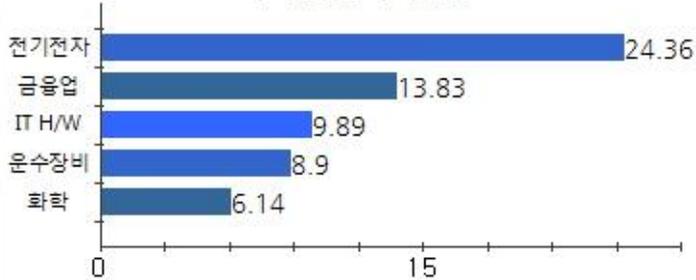


▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

| 순위 | 업종명 | 비중 | 순위 | 업종명 | 비중 |
|----|--------|-------|----|------|-------|
| 1 | 전기전자 | 24.36 | 6 | 유통업 | 5.20 |
| 2 | 금융업 | 13.83 | 7 | 제조 | 4.25 |
| 3 | IT H/W | 9.89 | 8 | 서비스업 | 3.40 |
| 4 | 운수장비 | 8.90 | 9 | 보험 | 3.15 |
| 5 | 화학 | 6.14 | 10 | 기타 | 20.88 |

주식업종별 투자비중



▶ 국가별 투자비중

(단위 : %)

| 순위 | 국가명 | 비중 | 순위 | 국가명 | 비중 |
|----|------|-----|----|-----|----|
| 1 | 대한민국 | 100 | | | |

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

| 순위 | 구분 | 종목명 | 비중 | 순위 | 구분 | 종목명 | 비중 |
|----|------|----------|-------|----|----|--------|------|
| 1 | 주식 | 삼성전자우 | 14.35 | 6 | 주식 | SK하이닉스 | 3.22 |
| 2 | 주식 | 현대차2우B | 5.51 | 7 | 주식 | 테스나 | 2.74 |
| 3 | 주식 | 신세계인터내셔널 | 4.08 | 8 | 주식 | SK | 2.63 |
| 4 | 단기상품 | 은대 | 3.80 | 9 | 주식 | 하나금융지주 | 2.60 |
| 5 | 주식 | 삼성전자 | 3.66 | 10 | 주식 | POSCO | 2.56 |

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

(단위: 주, 백만원, %)

| 종목명 | 보유수량 | 평가금액 | 비중 | 발행국가 | 통화 | 업종 | 비고 |
|----------|-------|------|------|------|-----|--------|----|
| 삼성전자우 | 3,344 | 127 | 14.4 | 대한민국 | KRW | 전기전자 | |
| 현대차2우B | 582 | 49 | 5.5 | 대한민국 | KRW | 운수장비 | |
| 신세계인터내셔널 | 113 | 36 | 4.1 | 대한민국 | KRW | 유통업 | |
| 삼성전자 | 688 | 32 | 3.7 | 대한민국 | KRW | 전기전자 | |
| SK하이닉스 | 355 | 28 | 3.2 | 대한민국 | KRW | 전기전자 | |
| 테스나 | 625 | 24 | 2.7 | 대한민국 | KRW | IT H/W | |
| SK | 86 | 23 | 2.6 | 대한민국 | KRW | 금융업 | |
| 하나금융지주 | 598 | 23 | 2.6 | 대한민국 | KRW | 금융업 | |
| POSCO | 83 | 23 | 2.6 | 대한민국 | KRW | 철강및금속 | |

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 |
|----|---------|------------|----|------|-----|------|-----|
| 예금 | KEB하나은행 | 2007-07-18 | 34 | 1.38 | | 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 | |
| 홍성철 ^{주)} | 팀장 | 40 | 10 | 99,949 | 1 | 55,627 | 2113000811 |
| 김예리 | 차장 | 38 | 0 | | 0 | | 2109001471 |

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 |
|-----------------------|--------|
| 2016.09.23 ~ 현재 | 홍성철 |
| 2013.07.01 ~ 현재 | 김예리 |
| 2013.07.01~2016.09.22 | 오남훈 |

▶ 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)} | |
| 퇴연배당자1(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)} | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 1 | 0.09 | 1 | 0.08 |
| | | 합계 | 1 | 0.10 | 1 | 0.09 |
| | 증권거래세 | 1 | 0.13 | 1 | 0.12 | |
| 퇴연배당자1(주식)C | 자산운용사 | 1 | 0.09 | 1 | 0.09 | |
| | 판매회사 | 1 | 0.21 | 1 | 0.20 | |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 | |
| | 일반사무관리회사 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| | 보수합계 | 2 | 0.30 | 2 | 0.30 | |
| | 기타비용 ^{주2)} | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 1 | 0.09 | 1 | 0.08 |
| | | 합계 | 1 | 0.10 | 1 | 0.09 |
| | 증권거래세 | 1 | 0.13 | 1 | 0.12 | |
| 퇴연배당자1(주식)Ce | 자산운용사 | 0 | 0.09 | 0 | 0.09 | |
| | 판매회사 | 0 | 0.10 | 0 | 0.10 | |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| | 일반사무관리회사 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| | 보수합계 | 0 | 0.20 | 0 | 0.20 | |
| | 기타비용 ^{주2)} | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0 | 0.09 | 0 | 0.08 |
| | | 합계 | 0 | 0.10 | 0 | 0.09 |
| | 증권거래세 | 0 | 0.13 | 0 | 0.12 | |

* 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) ^{주1)} | 매매·중개수수료비율(B) ^{주2)} | 합계(A+B) |
|----------------|----|----------------------------|------------------------------|---------|
| 퇴연배당자1(주식)(운용) | 전기 | 0.0016 | 0.341 | 0.3426 |
| | 당기 | 0.0016 | 0.365 | 0.3666 |
| 퇴연배당자1(주식)C | 전기 | 1.2036 | 0.3411 | 1.5447 |
| | 당기 | 1.2038 | 0.3653 | 1.5691 |
| 퇴연배당자1(주식)Ce | 전기 | 0.7933 | 0.3439 | 1.1372 |
| | 당기 | 0.7934 | 0.3669 | 1.1603 |

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 회전을

(단위: 백만원, %)

| 매수 | | 매도 | | 매매회전율 ^{주)} | |
|---------|--------|---------|--------|---------------------|--------|
| 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 해당기간 | 연환산 |
| 822,330 | 22,112 | 609,397 | 20,695 | 42.53 | 172.47 |

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: %)

| 2018-07-18 ~ 2018-10-17 | 2018-10-18 ~ 2019-01-17 | 2019-01-18 ~ 2019-04-17 |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 44.33 | 45.47 | 42.53 |

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 퇴직연금 배당 증권 자투자신탁 1호(주식)(운용)의 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/>

02-3787-3500

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