

자산운용보고서

마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)(운용)

(운용기간 : 2022.02.24 ~ 2022.05.23)

○자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며 투자자가 가입한 상품의 특
정기간(3개월) 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
 - ▶ 자산현황
 - ▶ 펀드의 투자전략
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
7. 동일한[해당] 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현
황
 - ▶ 투자현황
8. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안
 - ▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황
 - ▶ 나. 주요 위험 관리 방안
 - ▶ 다. 자전거래 현황
 - ▶ 라. 주요 비상대응계획

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보

자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드명칭	투자위험등급	금융투자협회 펀드코드	고난도 펀드
마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)(운용), 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)A, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)AG, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)Ae, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C-P1, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C-P2, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C-Pe1, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C-Pe2, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C-W, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)CG, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)Ce	5등급	AX668 AX669 BP347 AX670 AX671 BU378 B8572 BU379 BU380 BB697 BP348 AX672	해당 없음
펀드의 종류	혼합채권형, 추가형, 종류형	최초설정일	2014.11.24
운용기간	2021.11.24 ~ 2022.02.23	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
투자소득의 과세	<p><집합투자기구> 집합투자기구 단계에서는 별도의 소득과세 부담이 없는 것이 원칙입니다.</p> <p><연금저축계좌 가입자에 대한 과세> 소득세법 시행령 제40조의2에 따른 연금저축계좌를 통해 동 투자신탁에 가입한 가입자의 경우 동 투자신탁의 수익증권을 환매하는 시점에 별도의 과세를 하지 않으며, 연금저축계좌에서 자금 인출시 발생하는 연금소득(연금수령시), 기타소득 또는 퇴직소득(연금외수령시)에 대한 과세는 투자설명서 제2부 14. 이익 배분 및 과세에 관한 사항을 참고하시기 바랍니다.</p>		
자산운용회사	마이다스에셋자산운용	펀드재산보관회사	신한은행
판매회사	IBK투자증권, 기업은행, 신한은행, 우리은행, 유안타증권, 키움증권, 하나은행, 한국투자증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	투자신탁재산의 90% 이하를 국채, 통화안정증권, 우량 회사채 등의 채권에 주로 투자하며, 듀레이션을 1년 내외 수준으로 하여 금리 상승 시 자본손실의 최소화를 추구합니다. 투자신탁재산의 30% 이하를 공모주에 주로 투자하며 실권주, 블록딜 등에도 선별적으로 투자할 수 있습니다.		

▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
단기국공채공모주1(채혼)(운용)	자산 총액(A)	90,598	87,716	-3.18
	부채총액(B)	522	110	-78.97
	순자산총액(C=A-B)	90,075	87,606	-2.74
	발행 수익증권 총 수(D)	78,987	77,128	-2.35
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,140.38	1,135.85	-0.40
종류(Class)별 기준가격 현황				
단기국공채공모주1(채혼)A	기준가격	1,102.52	1,096.24	-0.57
단기국공채공모주1(채혼)AG	기준가격	1,056.69	1,051.10	-0.53
단기국공채공모주1(채혼)Ae	기준가격	1,104.58	1,098.78	-0.53
단기국공채공모주1(채혼)C	기준가격	1,099.76	1,092.80	-0.63
단기국공채공모주1(채혼)C-P1	기준가격	1,053.05	1,046.94	-0.58
단기국공채공모주1(채혼)C-P2	기준가격	1,100.10	1,093.83	-0.57
단기국공채공모주1(채혼)C-Pe1	기준가격	1,052.22	1,046.62	-0.53
단기국공채공모주1(채혼)C-Pe2	기준가격	1,097.93	1,092.15	-0.53
단기국공채공모주1(채혼)C-W	기준가격	1,102.55	1,097.27	-0.48
단기국공채공모주1(채혼)CG	기준가격	1,054.11	1,047.91	-0.59
단기국공채공모주1(채혼)Ce	기준가격	1,103.04	1,096.89	-0.56

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.

▶ 펀드의 투자전략

투자전략

이 투자신탁은 투자신탁재산의 90% 이하를 국채, 통화안정증권, 우량 회사채 등의 채권에 주로 투자합니다. 또한 투자신탁재산의 30% 이하의 범위에서 공모주 등 국내 주식에 투자하여 운용할 계획입니다. 각 부문의 운용 전략은 다음과 같습니다.

채권 투자전략

- 이 투자신탁은 투자신탁재산의 대부분을 국채, 통안채, 공사채, 지방채 등의 국공채에 투자하며 우량 회사채에도 선별적으로 투자할 계획입니다.
- 듀레이션을 1년 내외 수준으로 하여 금리 상승시 자본손실 최소화를 추구합니다.

주식 투자전략

- 투자신탁재산의 30% 이하에서 공모주에 주로 투자하며, 실권주, 블록딜 등에도 선별적으로 투자할 수 있습니다.
- 철저한 가치평가 중심의 공모주 투자로 투자대상 종목을 선정하며, 펀드매니저의 기업탐방 및 대내외 리서치 기관을 활용한 철저한 기업분석에 따른 가치평가를 통해 투자수익을 추구합니다.

위험관리

이 투자신탁은 주식 및 채권에 투자하는 혼합채권 형 투자신탁으로 주식 및 채권 관련 파생상품의 가격변동에 의한 손실 위험에 노출됩니다. 개별 주식 및 채권, 파생상품의 가격 변동으로 인한 위험을 제한하기 위하여 동일 종목 투자한도 및 파생상품에 대한 투자한도를 두고 있습니다.

수익구조

이 투자신탁은 투자신탁재산의 대부분을 채권 및 주식에 투자하는 증권투자신탁으로서 주된 투자대상인 채권의 이자수익 및 가격 변동으로 인한 자본손익과 국내 주식의 가격변동에 따라 투자자의 이익 또는 손실이 결정됩니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

펀드 수익률은 A클래스 기준 -0.57%로 비교지수 대비 0.33%p 낮은 수준을 기록하였습니다.

12월에 진행된 1개의 수요예측에서 펀드는 총 1개 기업(래몽래인)의 수요예측에 참여하여 물량을 배정 받았습니다. 12월에는 전월과 당월에 수요예측을 통해 물량을 배정 받은 3개 종목(신한서부티엔디리츠, 케이티비네트워크, 래몽래인)이 상장하였습니다. 배정 받은 종목 중 2개의 종목은 상장 당일 매도를 완료하였으며, 래몽래인은 확약 조건으로 펀드에 보유하고 있습니다. 매도한 2개의 종목은 모두 공모가를 하회하며 펀드 성과에 부정적으로 기여하였습니다.

6개월 확약 조건으로 펀드 내 보유 중인 카카오뱅크는 전월말 대비 12월말 주가가 10.1% 하락한 59,000원으로 마감하여 펀드 성과에 부정적으로 작용하였습니다. 마찬가지로 펀드 내 6개월 확약 조건으로 보유 중인 일진하이솔루스는 전월말 대비 12월말 주가가 6.2% 하락한 54,500원으로 마감하여 펀드 성과에 부정적으로 작용했고, 3개월 확약 조건으로 펀드 내 보유 중인 엔켐도 전월말 대비 12월말 주가가 6.4% 하락한 99,700원으로 마감하여 펀드 성과에 부정적으로 작용하였습니다. 1개월 확약 조건으로 펀드 내 보유하였던 카카오페이는 확약 기간이 종료되어 12월 중 매도를 완료하였고 전월말 대비 주가가 약 8.3% 하락하였으며, 3개월 확약 조건으로 펀드 내 보유하였던 현대중공업도 확약 기간이 종료되어 12월 중 매도를 완료하였고 전월말 대비 주가가 약 14.0% 하락하여 펀드 성과에 부정적으로 작용하였습니다.

1월에 진행된 10개의 수요예측에서 펀드는 오토앤, 케이옥션, LG에너지솔루션, 이지트로닉스, 스코빅엔터테인먼트 총 5개 기업의 수요예측에 참여하여 물량을 배정 받았습니다. 1월에는 당월에 수요예측을 통해 물량을 배정 받은 3개 종목(오토앤, 케이옥션, LG에너지솔루션)이 상장하였습니다. 배정받은 종목 중 오토앤은 상장 당일 매도를 완료하였으며, 케이옥션과 LG에너지솔루션은 각각 3개월, 6개월 확약 조건으로 펀드에 보유하고 있습니다. 매도한 오토앤은 공모가를 상회하며 펀드 성과에 긍정적으로 기여하였습니다.

6개월 확약 조건으로 펀드 내 보유 중인 카카오뱅크는 전월말 대비 1월말 주가가 30.5% 하락한 41,000원으로 마감하여 펀드 성과에 부정적으로 작용하였습니다. 펀드 내 6개월 확약 조건으로 보유 중인 일진하이솔루스는 전월말 대비 1월말 주가가 27.5% 하락한 39,500원으로 마감하여 펀드 성과에 부정적으로 작용했고, 3개월 확약 조건으로 펀드 내 보유 중인 엔켐도 전월말 대비 12월말 주가가 4.3% 하락한 95,400원으로 마감하여 펀드 성과에 부정적으로 작용하였습니다. 각각 3개월, 6개월 확약 조건으로 당월 물량을 배정 받은 케이옥션과 LG에너지솔루션은 공모가 대비 1월말 주가가 약 66.8%, 50% 상승하며 펀드 성과에 긍정적으로 기여하였습니다. 15일 확약 조건으로 펀드 내 보유하였던 래몽래인은 확약 기간이 종료되어 1월 중 매도를 완료하였고 공모가 대비 주가가 약 25.3% 상승하여 펀드 성과에 긍정적으로 기여하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

3월 수요예측이 예정된 종목은 공구우먼, 세아메카닉스, 보로노이, 지투파워 총 4개 기업입니다. 펀드는 향후 수요예측 일정 등을 고려하여 종목별 이익 가시성과 공모가 등을 바탕으로 담당섹터 애널리스트와 함께 철저한 가치 평가를 진행한 후 참여 여부를 결정할 계획입니다. 또한, 이 중 높은 경쟁률이 예상되거나 장기적인 이익 가시성이 기대되는 기업에 대해서는 의무보유 확약을 걸어 적극적으로 참여할 예정입니다.

2022년 올해 IPO시장은 역사적 최고 수준을 보였던 지난해의 시장 흐름과 유사할 것으로 전망됩니다. 평년보다 많은 공모 규모(약 25.4조원), 공모 기업수(약 80개)를 예상하고 있으며, LG에너지솔루션을 시작으로 원스토어, 현대오일뱅크, 교보생명, 쏘카, SK셀더스, SSG닷컴, 마켓컬리, CJ올리브영, 오아시스, 카카오엔터테인먼트 등 규모가 큰 기업들이 상장을 추진하고 있어 올해도 사상 최대의 공모 규모를 기록할 것으로 전망하고 있습니다.

▶ 기간(누적) 수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	-0.40	-3.37	3.41	5.24
(비교지수 대비 성과)	(-0.16)	(-2.96)	(4.05)	(5.45)

종류(Class)별 현황

단기국공채공모주1(채훈)A	-0.57	-3.71	2.88	4.53
(비교지수 대비 성과)	(-0.33)	(-3.30)	(3.52)	(4.74)
단기국공채공모주1(채훈)AG	-0.53	-3.63	3.01	4.77
(비교지수 대비 성과)	(-0.29)	(-3.22)	(3.65)	(4.98)
단기국공채공모주1(채훈)Ae	-0.53	-3.62	3.02	4.72
(비교지수 대비 성과)	(-0.29)	(-3.21)	(3.66)	(4.93)
단기국공채공모주1(채훈)C	-0.63	-3.83	2.69	4.27
(비교지수 대비 성과)	(-0.39)	(-3.42)	(3.33)	(4.48)
단기국공채공모주1(채훈)C-P1	-0.58	-3.73	2.85	4.48
(비교지수 대비 성과)	(-0.34)	(-3.32)	(3.49)	(4.69)
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	-0.57	-3.71	2.88	4.53
(비교지수 대비 성과)	(-0.33)	(-3.30)	(3.52)	(4.74)
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe1	-0.53	-3.64	3.00	4.66
(비교지수 대비 성과)	(-0.29)	(-3.23)	(3.64)	(4.85)
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe2	-0.53	-3.62	3.02	4.71
(비교지수 대비 성과)	(-0.29)	(-3.21)	(3.66)	(4.92)
단기국공채공모주1(채훈)C-W	-0.48	-3.53	3.16	4.89
(비교지수 대비 성과)	(-0.24)	(-3.12)	(3.80)	(5.10)
단기국공채공모주1(채훈)CG	-0.59	-3.74	2.83	4.46
(비교지수 대비 성과)	(-0.35)	(-3.33)	(3.47)	(4.67)
단기국공채공모주1(채훈)Ce	-0.56	-3.68	2.92	4.57
(비교지수 대비 성과)	(-0.32)	(-3.27)	(3.56)	(4.78)
비교지수(벤치마크)	-0.24	-0.41	-0.64	-0.21

주)비교지수(벤치마크): 국공채 1년-1년6개월 X 90% + KOSPI X 5% + CALL X 5%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	5.24	8.98	11.75	17.07
(비교지수 대비 성과)	(5.45)	(5.87)	(6.56)	(7.75)
종류(Class)별 현황				
단기국공채공모주1(채훈)A	4.53	7.50	9.48	13.13
(비교지수 대비 성과)	(4.74)	(4.39)	(4.29)	(3.81)
단기국공채공모주1(채훈)AG	4.77	7.60	-	-
(비교지수 대비 성과)	(4.98)	(5.06)	-	-
단기국공채공모주1(채훈)Ae	4.72	7.89	10.08	14.16
(비교지수 대비 성과)	(4.93)	(4.78)	(4.89)	(4.84)
단기국공채공모주1(채훈)C	4.27	6.96	8.67	11.73
(비교지수 대비 성과)	(4.48)	(3.85)	(3.48)	(2.41)
단기국공채공모주1(채훈)C-P1	4.48	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(4.69)	-	-	-
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	4.53	7.50	9.49	13.13
(비교지수 대비 성과)	(4.74)	(4.39)	(4.30)	(3.81)
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe1	4.66	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(4.85)	-	-	-
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe2	4.71	7.87	10.06	-
(비교지수 대비 성과)	(4.92)	(4.76)	(4.87)	-
단기국공채공모주1(채훈)C-W	4.89	8.26	10.64	15.13
(비교지수 대비 성과)	(5.10)	(5.15)	(5.45)	(5.81)
단기국공채공모주1(채훈)CG	4.46	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(4.67)	-	-	-
단기국공채공모주1(채훈)Ce	4.57	7.60	9.64	13.41
(비교지수 대비 성과)	(4.78)	(4.49)	(4.45)	(4.09)
비교지수(벤치마크)	-0.21	3.11	5.19	9.32

주)비교지수(벤치마크): 국공채 1년-1년6개월 X 90% + KOSPI X 5% + CALL X 5%

※ 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	-2,510	-425	0	4	0	0	0	0	0	41	-3	-2,893
당기	-571	140	0	7	0	0	0	0	0	85	-4	-343

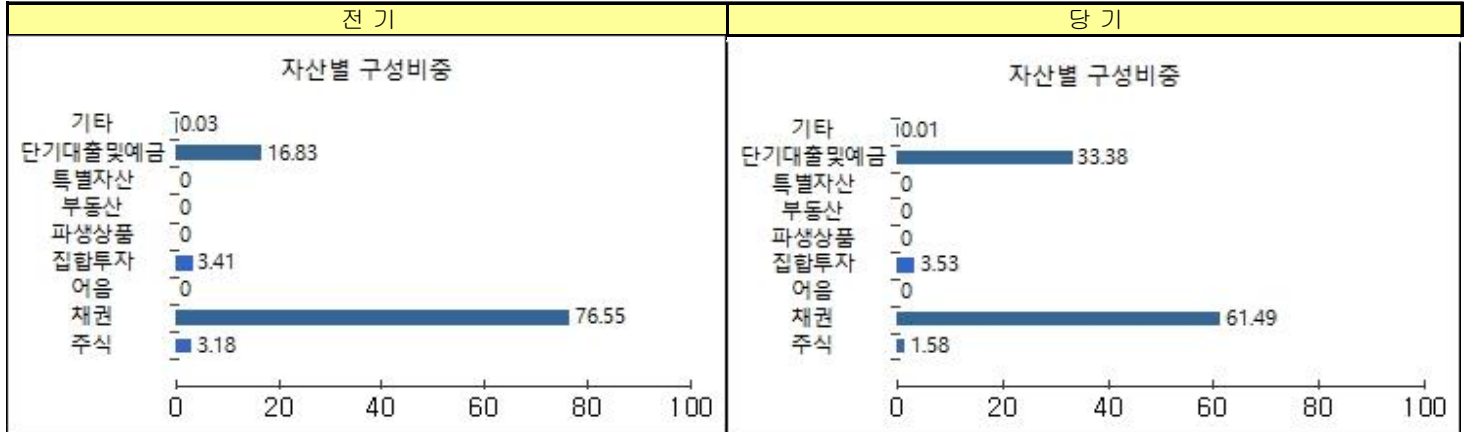
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	1,388	53,936	0	3,097	0	0	0	0	0	29,283	12	87,716
(1.00)	(1.58)	(61.49)	(0.00)	(3.53)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(33.38)	(0.01)	(100.00)
합계	1,388	53,936	0	3,097	0	0	0	0	0	29,283	12	87,716

* (단위): 구성비중



▶ 주식업종별 투자비중

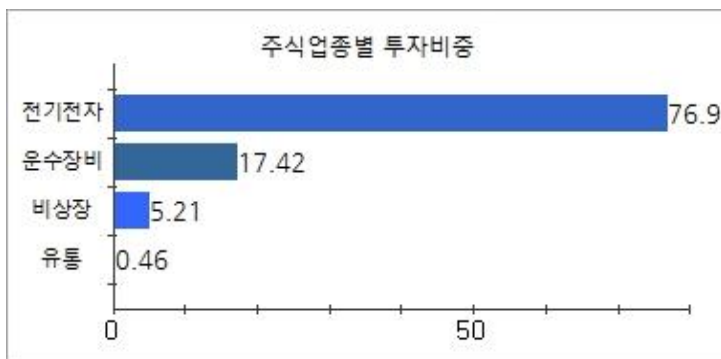
(단위: %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기전자	76.91			
2	운수장비	17.42			
3	비상장	5.21			
4	유통	0.46			

▶ 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	채권	산금22신이0106-0214-1	11.42	6	채권	수산금융채권(경제)44-1001표48-30호	11.04
2	단기상품	REPO매수(20220223)	11.40	7	단기상품	REPO매수(20220223)	6.95
3	채권	통안01560-2310-02	11.35	8	단기상품	REPO매수(20220223)	6.61
4	채권	하나은행44-08012.5갑-30	11.27	9	집합투자증권	KODEX 단기채권	3.53
5	채권	국고00875-2312(20-8)	11.19	10	단기상품	REPO매수(20220223)	3.42

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 채권

(단위: 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
산금22신이0106-0214-1	10,000	10,014	대한민국	KRW	2022-02-14	2023-08-14		AAA	11.42
통안01560-2310-02	10,000	9,954	대한민국	KRW	2021-10-02	2023-10-02		N/A	11.35
하나은행44-08012.5갑-30	10,000	9,890	대한민국	KRW	2021-08-30	2024-02-29		AAA	11.27
국고00875-2312(20-8)	10,000	9,812	대한민국	KRW	2020-12-10	2023-12-10		N/A	11.19
수신금융채권(경제)44-10이표48-30호	10,000	9,680	대한민국	KRW	2020-10-30	2024-10-30		AAA	11.04

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

▶ 집합투자증권

(단위: 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
KODEX 단기채권	수익증권	삼성자산운용	3,090	3,097	대한민국	KRW	3.53

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	흥국자산운용(판매)	2022-02-23	10,000	1.30	2022-02-24	대한민국	KRW
REPO매수	브이아이자산운용	2022-02-23	6,100	1.27	2022-02-24	대한민국	KRW
REPO매수	대신자산운용(우정사업본부)	2022-02-23	5,800	1.27	2022-02-24	대한민국	KRW
REPO매수	흥국자산운용(판매)	2022-02-23	3,000	1.27	2022-02-24	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	
김예리 ^{주)}	부장	41	11	376,092	1	52,142	2109001471
김민수 ^{주)}	부장	41	1	79,943	0		2111000836
박미나	과장	35	0		0		2119001058

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
2018.03.16 ~ 현재	김민수 김예리 박미나 송형섭 김지상
2021.07.16 ~ 현재	
2021.07.16 ~ 현재	
2019.06.14 ~ 2021.07.15	
2018.05.29 ~ 2019.06.13	

▶ 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)}	
단기국공채공모주1(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 ^{주2)}	1	0.00	1	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	14	0.01	16	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	6	0.01	2	0.00
		합계	20	0.02	18	0.02
		증권거래세	19	0.02	5	0.01

단기국공채공모주1(채훈)A	자산운용사	16	0.08	16	0.08	
	판매회사	18	0.09	18	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	1	0.01	1	0.01	
	일반사무관리회사	1	0.00	1	0.00	
	보수합계	36	0.17	36	0.17	
	기타비용(주2)	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	3	0.01	4	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	1	0.01	0	0.00
		합계	4	0.02	4	0.02
		증권거래세	4	0.02	1	0.01
단기국공채공모주1(채훈)AG	자산운용사	0	0.07	0	0.07	
	판매회사	0	0.06	0	0.06	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.13	0	0.13	
	기타비용(주2)	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.01	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.01	0	0.00
		합계	0	0.02	0	0.02
		증권거래세	0	0.02	0	0.01
단기국공채공모주1(채훈)Ae	자산운용사	4	0.08	4	0.08	
	판매회사	2	0.04	2	0.04	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	7	0.13	7	0.13	
	기타비용(주2)	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	1	0.01	1	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.01	0	0.00
		합계	1	0.02	1	0.02
		증권거래세	1	0.02	0	0.01
단기국공채공모주1(채훈)C	자산운용사	29	0.08	24	0.08	
	판매회사	58	0.15	48	0.15	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	2	0.01	2	0.01	
	일반사무관리회사	1	0.00	1	0.00	
	보수합계	91	0.24	75	0.24	
	기타비용(주2)	1	0.00	1	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	6	0.01	6	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	2	0.01	1	0.00
		합계	8	0.02	6	0.02
		증권거래세	8	0.02	2	0.01
단기국공채공모주1(채훈)C-P1	자산운용사	0	0.08	0	0.08	
	판매회사	0	0.10	0	0.10	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.18	0	0.18	
	기타비용(주2)	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.01	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.01	0	0.00
		합계	0	0.02	0	0.02
		증권거래세	0	0.02	0	0.01
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	자산운용사	5	0.08	5	0.08	
	판매회사	5	0.09	6	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	11	0.17	11	0.17	
	기타비용(주2)	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	1	0.01	1	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.01	0	0.00
		합계	1	0.02	1	0.02
		증권거래세	1	0.02	0	0.01

단기국공채공모주1(채훈)C-Pe1	자산운용사	0	0.08	1	0.08	
	판매회사	0	0.05	0	0.05	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	1	0.13	1	0.13	
	기타비용(주2)	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.01	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.01	0	0.00
		합계	0	0.02	0	0.02
	증권거래세	0	0.02	0	0.01	
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe2	자산운용사	11	0.08	12	0.08	
	판매회사	6	0.04	7	0.04	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	1	0.01	1	0.01	
	일반사무관리회사	1	0.00	1	0.00	
	보수합계	18	0.13	20	0.13	
	기타비용(주2)	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	2	0.01	3	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	1	0.01	0	0.00
		합계	3	0.02	3	0.02
	증권거래세	3	0.02	1	0.01	
단기국공채공모주1(채훈)C-W	자산운용사	0	0.08	0	0.07	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.08	0	0.08	
	기타비용(주2)	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.01	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.01	0	0.00
		합계	0	0.02	0	0.02
	증권거래세	0	0.02	0	0.01	
단기국공채공모주1(채훈)CG	자산운용사	0	0.08	0	0.08	
	판매회사	0	0.11	0	0.11	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.19	0	0.19	
	기타비용(주2)	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.01	0	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.01	0	0.00
		합계	0	0.02	0	0.01
	증권거래세	0	0.02	0	0.00	
단기국공채공모주1(채훈)Ce	자산운용사	7	0.08	6	0.08	
	판매회사	7	0.08	6	0.08	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	14	0.16	13	0.16	
	기타비용(주2)	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	1	0.01	1	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	1	0.01	0	0.00
		합계	2	0.02	2	0.02
	증권거래세	2	0.02	0	0.01	

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 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)
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	전기	0.0061	0.1279	0.134
	당기	0.006	0.1381	0.1441
단기국공채공모주1(채훈)A	전기	0.6935	0.1302	0.8237
	당기	0.6933	0.1418	0.8351
단기국공채공모주1(채훈)AG	전기	0.5843	0.1085	0.6928
	당기	0.5757	0.3596	0.9353
단기국공채공모주1(채훈)Ae	전기	0.5131	0.124	0.6371
	당기	0.513	0.1171	0.6301
단기국공채공모주1(채훈)C	전기	0.9435	0.1283	1.0718
	당기	0.9434	0.1476	1.091
단기국공채공모주1(채훈)C-P1	전기	0.7386	0.0892	0.8278
	당기	0.737	0.133	0.87
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	전기	0.6934	0.1373	0.8307
	당기	0.6932	0.1381	0.8313
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe1	전기	0.5421	0.0984	0.6405
	당기	0.5425	0.0914	0.6339
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe2	전기	0.5181	0.128	0.6461
	당기	0.518	0.109	0.627
단기국공채공모주1(채훈)C-W	전기	0.3422	0.1101	0.4523
	당기	0.3414	0.1741	0.5155
단기국공채공모주1(채훈)CG	전기	0.7626	0.1282	0.8908
	당기	0.7619	0.1689	0.9308
단기국공채공모주1(채훈)Ce	전기	0.6434	0.1165	0.7599
	당기	0.6432	0.1236	0.7668

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, %)

단기국공채공모주1(채훈)(운용)

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	117,063	2,240	93.56	371.20

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: %)

단기국공채공모주1(채훈)(운용)

2021-05-24 ~ 2021-08-23	2021-08-24 ~ 2021-11-23	2021-11-24 ~ 2022-02-23
44.87	109.12	93.56

7. 동일한[해당] 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

▶ 투자현황

(단위: 백만원, %)

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권	보유비중
집합투자기구명	발행총수(A)	보유수(B)	(=A/B*100(%))
해당 사항 없음			

8. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

유동성 위험	증권시장규모 등을 감안할 때 거래량이 풍부하지 못한 종목에 투자할 경우 투자대상종목의 유동성 부족에 따른 환금성의 결여가 투자신탁재산 가치의 하락을 초래할 위험이 발생할 수 있습니다.
--------	--

신용위험	채무불이행 위험은 채권의 발행주체가 현금흐름의 부족으로 인해 채무를 불이행할 경우, 투자자금에 대한 이자와 원금의 손실이 발생할 수 있는 위험 또는 투자자금에 대한 이자와 원금의 회수완료 시간이 예상보다 길게 소요됨에 따른 기회비용이 발생할 수 있는 위험을 말하는 것입니다
주식등 가격변동위험 (시장위험)	주식시장은 시장 내의 수급과 시장 외부변수에 따라 그 등락을 거듭합니다. 그 중에서도 경제성장률, 환율, 금리변동 등의 요인들은 개별기업 성과의 좋고 나쁨에 상관없이 주식시장 전체에 영향을 끼쳐 개별주식가격의 등락을 초래하게 되므로, 주식시장에 투자하는 투자자에게는 예상하기 어려운 위험이기도 합니다. 이러한 외부변수들의 변화는 투자자산 가치의 변화를 초래할 수 있습니다.
주식등 가격변동위험 (종목위험)	개별주식은 해당기업의 수익성 및 성장성의 변화에 따라 주식의 가격이 변동되므로 이에 따라 이익 혹은 손실이 발생할 가능성이 항상 있습니다. 회사는 투자대상 기업의 성장성과 수익성이 개선될 것으로 예상하거나, 기업의 가치보다 현재 시장에서 거래되는 가격이 낮다고 판단할 경우에 해당 주식을 매수하지만, 회사의 판단이 항상 정확할 수는 없는 것이므로 투자손실의 위험이 항상 존재합니다.
금리변동위험	금리변동위험 채권의 가격은 이자율에 의해 결정됩니다. 일반적으로 이자율이 하락하면 채권가격의 상승으로 인한 자본이득이 발생하고 이자율이 상승하면 채권가격의 하락으로 자본손실이 발생합니다. 따라서 채권을 만기까지 보유하지 않고 중도에 매도하는 경우에는 시장상황에 따라 손실 또는 이득이 발생할 수 있습니다. 또한 채권의 가격은 채권의 만기 이전에 발생하는 이자수령액이 현재의 채권시장 이자율과 같은 이자율로 재투자된다는 가정 하에 계산됩니다. 그러나 실제로는 채권시장 이자율이 항상 변하고 있어, 만일 이자 수령 시의 시장이자율이 당초의 시장이자율보다 낮아질 경우 채권투자로부터 발생하는 수익이 예상수익보다 작아질 수도 있습니다.
파생상품 관련 위험	파생상품에의 투자는 적은 증거금으로 거액의 결제가 가능한 지렛대 효과(레버리지 효과)로 인하여 기초자산에 직접 투자하는 경우에 비하여 높은 위험에 노출될 수 있습니다. 기초 자산의 가격변동성을 완화하기 위한 헷지전략과 자산배분전략을 구사함에도 불구하고, 파생상품은 시장 내의 수급과 시장 외부변수에 따라 기초자산의 움직임과 상이하게 움직일 경우 파생상품에 투자하는 투자자에게 예상하기 어려운 투자자산 가치의 변화를 초래할 수 있습니다.
회사채 투자위험	회사채는 국공채 및 통안채에 비하여 높은 수준의 투자위험을 지니고 있으며, 따라서 회사채에 주로 투자하는 회사채형 투자신탁의 경우 국공채 등에 주로 투자하는 채권형 투자신탁보다 투자위험이 높음을 유의하시기 바랍니다.

2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등

동기간 환매중단, 상환연기, 부실자산 발생 관련 위험은 없었으며, 보고서 작성 시점에서 동 위험의 발생 가능성은 제한적입니다.

▶ 나. 주요 위험 관리 방안

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

유동성위험	보유종목의 시장유동성 점검은 초저유동성 종목에 대하여 모니터링하고, 종목별 전량매도소요일, 중소형주 비중 점검 등을 통하여 관리하고 있으며, 위험발생이 예상되는 경우 즉시 위험관리위원회를 개최하여 대응방안을 마련하며, 펀드의 유동성관리는 펀드별 현금자산 및 유동성비중에 대하여 Daily 모니터링하고, 환매스케줄 및 자금관리에 만전을 기하고 있습니다.
신용위험	주식 및 채권의 경우 Buying List 종목에 한해 투자 가능하며, Buying List 선정시 종목의 신용위험에 대한 점검절차를 가지고 있으며, 신용등급의 변동에 대하여 데일리 모니터링하고, 신용등급이 규정에서 정한 등급 미만으로 하락시에는 위험관리위원회의 점검절차를 통하여 대응방안을 마련하여 대응합니다. RP 거래의 경우 거래처 및 담보증권 점검을 통하여 신용위험을 관리하고 있습니다.
시장위험	주식 및 채권의 편입비, 종목별 편입비 등의 한도를 규약에 정하고, 한도 내에서의 운용을 원칙으로 하고 있으며, 개별주식종목의 경우 Loss-cut 규정을 두고 있으며, 듀레이션점검, 펀드별 BM대비 변동성, TE, IR, MDD 등의 위험조정성과지표의 관리를 통하여 시장위험을 관리하고 있습니다.
파생상품 관련위험	파생상품의 편입 한도를 규약에 정하고, 한도 내에서의 운용을 원칙으로 하고 있으며, 파생상품거래에 따른 위험평가액을 매일 모니터링하고 점검합니다.
통제방안	규약, 법규 및 내부 운용지침 등에서 요구하는 위험관리 항목과 일상적으로 발생할 수 있는 위험요소에 대하여 데일리 및 상시 모니터링하고 있으며, 주간 리스크관리리포트를 통한 점검, 월1회 정기 위험관리 실무위원회 등의 점검절차를 가지고 있으며, 실제 위험요인 발생시 즉각적으로 위험관리위원회를 개최하여 위험요인 분석 및 그에 따른 해결 방안 강구하고 추가적인 위험 발생의 방지에 최선을 다합니다.

2. 환매중단, 상환연기 등과 관련된 환매재개, 투자금상환 등의 방안 및 절차 등

해당 사항 없음

▶ 다. 자전거래 현황

1. 자전거래규모			
최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
해당사항 없음			

2. 최근 1년간 자전거래 발생 시 자전거래 사유, 관련 펀드간 이해상충 등 방지를 위해 실시한 방안, 절차 등
해당사항 없음

▶ 라. 주요 비상대응계획

집합투자재산위험관리규정 제39조(집합투자재산 운용에 따른 비상계획의 수립 및 점검)에 의거하여 '운용관련 비상상황에 대한 단계별 가이드라인'을 제정하고 운영하고 있으며, 대규모환매청구, 보유자산의 중대한 손실, 보유자산의 부실화 등의 정량적인 사항은 시스템으로 구축하여 데일리 모니터링 및 단계별 점검사항 발생시 위험요소에 대하여 점검하고, 조속하게 대처하여 추가적인 위험상황으로의 확대를 방지하고, 재난.재해, 민원 및 소송, 금융사고 등의 발생에 대하여도 위기상황에 대하여 단계별로 정의하고 발생시 단계별 대응방안에 따르며, 재난.재해의 경우에는 발생 즉시 비상대책위원회를 소집하여 BCP점검 및 비상대응계획을 수립하여 시행하여 위험을 최소화 하도록 최선을 다합니다.

9. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

▶ 고유재산 투자에 관한 사항

(단위: 원, %)

펀드명	투자시기	투자금액	수익률	비고
해당사항 없음				

주1) 수익률은 분기운용보고서 말일 기준

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(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)
금융투자협회

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

02-3787-3500