

자산운용 보고서

투자신탁명(투자회사명) 마이다스블루칩배당혼합투자신탁1호
 투자신탁의 종류(형태) 주식혼합형
 운용기간 2006-12-07 ~ 2007-03-06

1. 투자신탁(투자회사)의 개요

최초설정일	2005-12-07	투자신탁기간	455 일
자산운용회사	마이다스셋자산		
판매 회사	한국외환은행 대구은행 하나은행(서울) 메리츠종합금융(구한		
수탁회사	한국외환은행	일반사무관리회사	에이브레인(팀스)
투자신탁의 특징	주식에 펀드 자산의 50%내외로 투자하며, 주식 투자시 블루칩 배당주에 주로 투자하여 높은 배당수익을 누리면서도 지수상승시의 수익 제고를 추구하는 펀드		

주) 투자신탁기간 : 펀드설정일로부터 보고서 작성 기준일까지의 운용기간

2. 투자신탁(투자회사)의 현황

(단위 : 백만원)

자산총액	13,780	부채총액	61	
순자산총액	13,719	기준가격(원)	전기말	1,095.79
			당기말	1,000.45

3. 자산구성 현황 및 비율

(단위 : 백만원,%)

구분	투자증권			단기대출 및 예금	파생상품		부동산	실물 자산	간접투 자증권	특별 자산	기타 자산	자산총액
	주식	채권	기타		장내	장외						
금액	7,935	4,004	0	1,622	3	0	0	0	0	0	216	13,780
비율	57.58	29.06	0.00	11.77	0.02	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1.57	100.00

* 자산운용보고서 작성기준일 현재 대차대조표의 관련금액을 기재함

기타 : CD/CP

기타자산 : 미수금, 선급비용, 선납원천세, 이연자산 등

* 파생상품 액면금액 별도표시 - 장내파생 : 0

4. 자산보유 및 운용현황

- 주식

(단위 : 주,원,%)

종 목 명	보유 수량	취득가액	평가액	평가손익	비율
삼성전자	1,416	898,496,251	805,704,000	-92,792,251	5.85
국민은행	5,022	359,073,000	417,830,400	58,757,400	3.03
POSCO	1,063	313,329,158	372,050,000	58,720,842	2.70
우리금융	13,900	291,900,000	317,615,000	25,715,000	2.30
GS건설	3,894	341,893,200	303,342,600	-38,550,600	2.20
한국전력	6,750	264,937,500	259,200,000	-5,737,500	1.88
KT	5,690	269,990,500	249,222,000	-20,768,500	1.81

(단위 : 주,원,%)

종 목 명	보유 수량	취득가액	평가액	평가손익	비율
현대차2우B	5,740	218,017,091	224,721,000	6,703,909	1.63
SK텔레콤	1,143	250,317,000	220,599,000	-29,718,000	1.60
삼성화재	1,286	199,402,300	210,261,000	10,858,700	1.53
외환은행	14,290	191,555,228	207,205,000	15,649,772	1.50
신한지주	3,799	203,652,990	201,347,000	-2,305,990	1.46
한화	5,820	197,880,000	190,896,000	-6,984,000	1.39
LG전자우	5,820	185,076,000	190,314,000	5,238,000	1.38
우리투자증권우	15,110	197,941,000	188,119,500	-9,821,500	1.37
STX조선	9,580	136,598,995	182,020,000	45,421,005	1.32
한진해운	5,030	138,576,500	167,499,000	28,922,500	1.22
한미반도체	22,360	154,284,000	158,756,000	4,472,000	1.15
현대중공업	1,001	125,125,000	157,657,500	32,532,500	1.14
한진중공업	5,590	166,023,000	156,520,000	-9,503,000	1.14
금호산업	7,810	192,147,910	149,561,500	-42,586,410	1.09
청호컴넷	8,410	159,366,771	147,175,000	-12,191,771	1.07
한국가스공사	3,910	160,310,000	139,000,500	-21,309,500	1.01
LG상사	6,978	162,542,782	138,862,200	-23,680,582	1.01
대한전선	6,430	153,677,000	136,316,000	-17,361,000	0.99
SK	1,683	121,787,186	133,630,200	11,843,014	0.97
웅진코웨이	4,640	112,752,000	129,920,000	17,168,000	0.94
GS홈쇼핑	1,759	140,544,100	128,758,800	-11,785,300	0.93
제일모직	3,360	132,720,000	124,824,000	-7,896,000	0.91
대신증권우	8,770	133,742,500	123,218,500	-10,524,000	0.89
현대제철	3,440	119,368,000	120,400,000	1,032,000	0.87
강원랜드	6,920	133,556,000	113,834,000	-19,722,000	0.83
KT&G	1,965	117,900,000	111,022,500	-6,877,500	0.81
LG화학	2,580	111,295,712	110,166,000	-1,129,712	0.80
CJ	1,158	125,064,000	109,431,000	-15,633,000	0.79
현진소재	5,604	95,548,200	109,278,000	13,729,800	0.79
동부화재	3,910	95,404,000	98,141,000	2,737,000	0.71
대구백화점	5,190	93,420,000	86,673,000	-6,747,000	0.63
동양제철화학	1,930	82,411,000	85,402,500	2,991,500	0.62
동아제약	1,147	93,595,200	84,878,000	-8,717,200	0.62
한솔제지	6,330	90,950,390	84,505,500	-6,444,890	0.61
동국제강	3,310	73,813,000	75,964,500	2,151,500	0.55
녹십자	1,411	81,838,000	75,065,200	-6,772,800	0.54
호텔신라	3,270	50,194,500	44,799,000	-5,395,500	0.33
리바트	3,260	43,358,000	39,446,000	-3,912,000	0.29
코아로직	1,366	43,848,600	29,027,500	-14,821,100	0.21
피앤텔	1,883	21,183,750	18,830,000	-2,353,750	0.14
코아로직배신	170	85,000	3,612,500	3,527,500	0.03
동아제약배신	29	145,000	2,146,000	2,001,000	0.02
합계	242,927	8,046,637,314	7,934,767,900	-111,869,414	57.58

- 채권

(단위 : 원,%)

종 목 명	액면가액	평가액	이표	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비율
국민은행2605이표일(3)	4,000,000,000	4,003,828,000	4.89	2006-05-18	2008-05-18	무보증(미등록)	AAA0	29.06
합계	4,000,000,000	4,003,828,000						29.06

- 어음

(단위 : 원,%)

종 목 명	액면가액	평가액	발행일	상환일	신용등급	비율
해당사항 없음						

- 채무증서

(단위 : 원,%)

종 목 명	액면가액	평가액	발행일	상환일	신용등급	비율
해당사항 없음						

- 장내파생상품

(단위 : 계약, 원)

종 목 명	매수(도) 구분	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	20	40,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	20	40,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	20	40,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	20	40,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	20	40,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	17	34,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	2	4,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	1	2,000	
합계		120	240,000	0

- 장외파생상품

(단위 : 계약, 원)

종 목 명	매수(도) 구분	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
해당사항 없음				

- 부동산(임대)

(단위 : 원)

종류	소재지		취득가액(보증금)	비고
	등기번호	취득일	평가액(임대료)	
해당사항 없음				

- 부동산(자금대여 및 차입)

(단위 : 원,%)

구분(대상)	대여(차입)기관	계약일자	대여(차입)금액	대여(차입)이율	상환(만기)일	비고
해당사항 없음						

- 실물자산

(단위 : 원)

종류	매입일	매입가	평가액	비고
해당사항 없음				

- 단기대출 및 예금

(단위 : 원,%)

구분	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	대출(예금)이자	상환(만기)일	비율
콜 2일물 4.60	대신증권	2007-03-06	1,500,000,000	189,041	2007-03-08	10.89
예금			121,693,191	70,007		0.88
합계			1,621,694,241	259,048		11.77

- 기타자산 및 특별자산

(단위 : 원,%)

구분	종 목 명	액면가액	평가액	비율
기타자산	기타미수금		11,649,660	0.08
기타자산	미수배당금		204,736,500	1.49

(단위 : 원,%)

구분	종 목 명	액면가액	평가액	비율
기타자산	선납원천세		103,170	0.00
합계			216,489,330	1.57

- 유가증권대여 및 차입

(단위 : 원,%)

구분	대여기관	대여일자	대여수량	대여수수료	상환일	비율
해당사항 없음						

- 간접투자증권

(단위 : 원,%)

간접투자지구명	보유수량	취득가액	평가액	평가손익	비율
해당사항 없음					

5. 매매주식총수, 매매금액 및 매매회전율

(단위 : 주, 원,%)

매수		매도		매매회전율
수량	금액	수량	금액	
43,915	1,236,544,210	126,262	3,548,713,540	36.89

6. 운용의 개요 및 손익현황

- 운용개요:

동 기간 중 국내 주식시장은 종합주가지수 기준으로 2006년도 말 배당락을 감안할 경우 고점부근에서 장을 마감하였으나 1월 초 글로벌 증시의 호조세 지속에도 불구하고 실적발표 기업들의 향후 실적전망 불투명과 국내 증시의 수급불안 등으로 지수는 조정을 보였습니다. 그러나 중국, 미국, 일본을 비롯한 글로벌 증시의 신고가 경신 및 외국인 매수세에 힘입어 2월말 역사적 신고가를 기록하였습니다. 최근 증시는 미국 서브프라임 모기지 시장의 부실로 전반적인 금융위축 가능성과 중국 주식시장의 투기과열 억제 분위기로 한차례 급락을 경험하였으나 이에 대한 우려감이 점차 완화되며 반등 국면에 있는 것으로 판단이 됩니다. 향후 증시는 국내 기업들의 모멘텀 개선과 여타 신흥시장 대비 밸류에이션 매력에 부각되며 완만한 상승을 지속할 것으로 전망이 됩니다. 업종별로는 향후 실적개선이 가장 확실하게 예상되는 조선 및 중공업과 글로벌 동종그룹 대비 밸류에이션 매력도가 높은 은행 등에 대한 투자가 유망해 보입니다.

포트폴리오는 삼성전자, KT, 한국전력, POSCO, GS건설, 국민은행, KT&G, 기업은행, SK텔레콤, 우리금융 등의 블루칩 배당주식과 대신증권, 한진중공업, 한화, 대우백화점, 한미반도체, 리바트 등 일반 고배당주로 구성되어 있습니다. 동 기간 중에는 POSCO, 국민은행, 신한지주, 삼성화재, 우리금융, 한진해운, 현대중공업 등의 블루칩 배당주와 웅진코웨이, 현진소재, 한솔제지, 한미반도체 등의 일반 고배당주의 수익률이 좋았으며 리바트, GS홀쇼핑, 금호산업, 대한전선, LG상사, 강원랜드 등의 수익률이 부진하였습니다. 한편, 한편, 필요할 경우 주식 투자에 대한 부분적인 헤지 또는 추가수익 획득을 위하여 현물주식을 보유하고 있는 상태에서 콜옵션을 매도하는 커버드콜 전략을 사용할 수 있습니다.

(단위 : 백만원)

구분		평가손익		처분손익	
		전기	당기	전기	당기
투자 증권	주식	551	-109	185	-50
	채권	-2	-10	-5	-16
	기타투자증권	0	0	0	0
장내파생		5	-3	26	-39
장외파생		0	0	0	0
부동산		0	0	0	0
실물자산		0	0	0	0
특별자산		0	0	0	0
간접투자증권		0	0	0	0

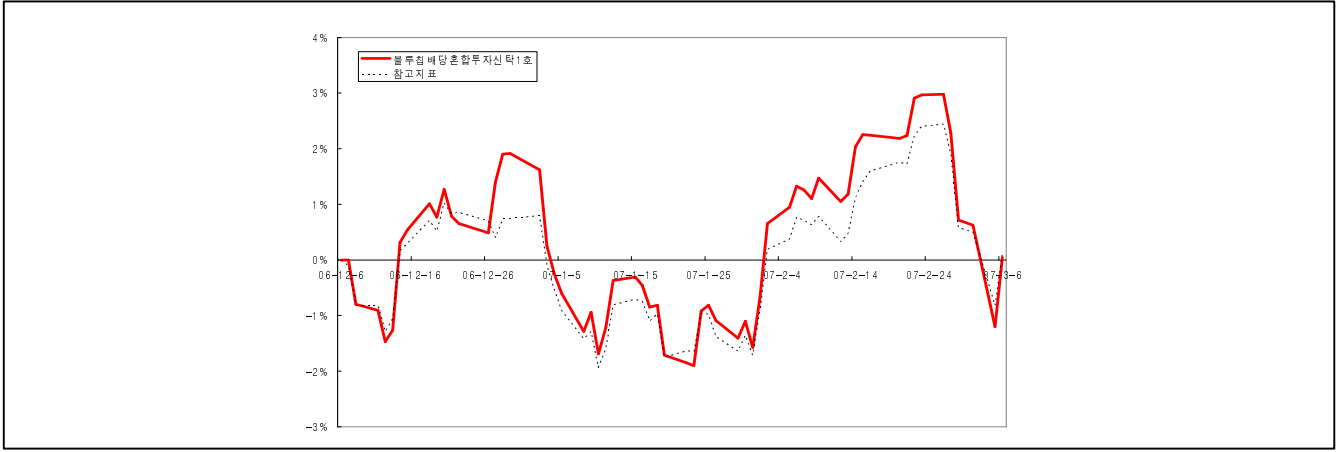
주) 기타손익의 당기내역 : 보수 : 54, 수수료 : 1, 대손상각비 : 0, 기타이익 : 0, 배당수익 : 213,
 채권수입이자 : 65, 유동수입이자 : 13, 수입수수료 : 0, 대손상각비환입 : 0,
 상환이익 : 5

- 기간별 운용성과

(단위 : %)

	1 개월	3 개월	6 개월	1 년	설정(등록)일 이후
수익률	-1.27	0.05	4.44	5.28	9.63

※ 참고지표 : KOSPI 50% + 블룸버그채권지수(국고채1~2년물) 50%



- 보수 지급 현황

(단위 : 백만원)

구분	전기	당기
유용보수	24	23
판매보수	31	29
수탁보수	1	1
사무관리보수	1	1

- 총보수,비용비율

(단위 : 연환산)

구분	전기	당기
총보수,비용비율	1.56	1.46

7. 운용전문인력현황

성명	연령	주요 근무경력 및 기간	협회등록번호
이승준	1973년	Columbia Univ. Financial Math, 신영증권/미래에셋자산운용	06-02002-0034
허필석	1967년	KAIST Techno MBA, 장기신용/삼성증권	00-02002-0011
계상현	1974년	서강대 경영학, KTB	05-02002-0029

8. 중개회사별 거래금액, 수수료 및 그 비중

주식거래

(단위 : 백만원,%)

구분	1월			2월			3월		
	거래금액	수수료	비중	거래금액	수수료	비중	거래금액	수수료	비중
다이와증권	0	0.00	0/0	80	0.20	6/13	0	0.00	0/0
우리투자증권	289	0.29	28/27	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0
하나증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	2	0.00	0/0
한국투자증권	420	0.42	40/39	456	0.46	34/30	0	0.00	0/0
ABN AMRO증권(주식)	27	0.05	3/5	59	0.12	4/8	799	1.60	33/50
CJ투자증권	67	0.07	6/6	586	0.59	44/38	1,551	1.55	65/49
NH투자증권(세종)	242	0.24	23/23	165	0.16	12/11	44	0.04	2/1

주식 외 투자증권 거래

(단위 : 백만원,%)

구분	1월			2월			3월		
	거래금액	수수료	비중	거래금액	수수료	비중	거래금액	수수료	비중
대우증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	1,004	0.00	19/0
미래에셋증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	1,974	0.00	38/0

부국증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	1,267	0.00	24/0
이트레이드증권	2,008	0.00	100/0	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0
현대증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	968	0.00	19/0

장내파생상품 거래

(단위 : 백만원,%)

구분	1월			2월			3월		
	거래금액	수수료	비중	거래금액	수수료	비중	거래금액	수수료	비중
하나증권	27	0.08	100/100	19	0.06	100/100	18	0.05	100/100

※ 비중의 상위란 %는 거래금액 기준 비중, 하위란 %는 수수료 기준 비중임

9. 이해관계인과의 거래에 관한 사항

(단위 : 백만원)

이해관계인		거래의 종류	자산의 종류	거래금액
성명(상호)	관계			
해당사항 없음				

10. 의결권공시대상법인등에 대한 의결권행사여부 및 그 내용

회사명	주주 총회일	보유 주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)				불행사사유
				찬성	반대	불행사	중립	
대우건설	061222	13,180		13,180	0	0	0	
대우건설	061222	13,180		13,180	0	0	0	
대우건설	061222	13,180		13,180	0	0	0	
대우인터내셔	061222	5,000		5,000	0	0	0	
대우인터내셔	061222	5,000		5,000	0	0	0	
POSCO	070223	1,301		1,301	0	0	0	
POSCO	070223	1,301		1,301	0	0	0	
POSCO	070223	1,301		1,301	0	0	0	
POSCO	070223	1,301		1,301	0	0	0	
POSCO	070223	1,301		1,301	0	0	0	
POSCO	070223	1,301		1,301	0	0	0	
POSCO	070223	1,301		1,301	0	0	0	
POSCO	070223	1,301		1,301	0	0	0	
POSCO	070223	1,301		1,301	0	0	0	
POSCO	070223	1,301		1,301	0	0	0	
제일모직	070228	4,180		4,180	0	0	0	
제일모직	070228	4,180		4,180	0	0	0	
제일모직	070228	4,180		4,180	0	0	0	
제일모직	070228	4,180		4,180	0	0	0	
제일모직	070228	4,180		4,180	0	0	0	
제일모직	070228	4,180		4,180	0	0	0	
삼성전자	070228	2,059		2,059	0	0	0	
삼성전자	070228	2,059		2,059	0	0	0	
삼성전자	070228	2,059		2,059	0	0	0	
삼성전자	070228	2,059		2,059	0	0	0	
삼성전자	070228	2,059		2,059	0	0	0	
삼성전자	070228	2,059		2,059	0	0	0	

11. 공지사항

간접투자기구의 운용 및 투자등에 관련하여 보다 자세한 사항은 아래의 주소로 문의하거나, 해당 자산운용회사.판매회사의 영업점에 비치되고 홈페이지 (<http://www.midasasset.com>)에 게재되어 있는 영업보고서 및 사업보고서를 이용할수 있습니다.

주소 : 서울 영등포구 여의도동 23-3 마이다스에셋
전화번호 : 02)3787 - 3500