

자산운용 보고서

1. 기본정보

1. 개요

- 가. 투자신탁의 명칭 마이다스옵티멈장기증권저축투자회사
- 나. 분류 유추얼(주식형) / 단위형 / 폐쇄형
- 다. 운용기간 3개월(2007-04-22 ~ 2007-07-21)
- 라. 작성자 마이다스에셋자산

간접투자자산 현황

(단위 : 원, 좌/주)

	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	5,319,559,438	5,883,222,214	10.60
부채 총액 (B)	42,615,122	137,193,165	221.94
순자산총액 (C=A-B)	5,276,944,316	5,746,029,049	8.89
발행 수익증권 총 수 (D)	4,752,402,236	4,252,266,579	-10.52
기준가격 (E=C/D*1000)	1,110.37	1,351.29	21.70

※ 기준가격이란 투자신탁의 순자산총액을 발행된 수익증권 총 수로 나눈 가격으로 수익증권의 매입 및 환매시 적용되는 가격임.

2. 운용성과

가. 기간 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
투자신탁	7.59	21.70	36.20	35.13	45.46
비교지수	8.01	22.33	34.94	34.91	43.14

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 75% + CD금리 25%

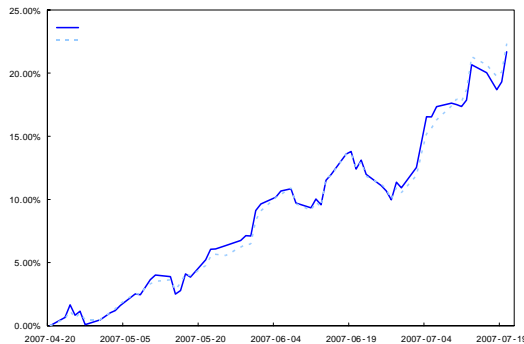
나. 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
투자신탁	45.46	33.33	31.46	19.95
비교지수	43.13	31.40	32.36	18.64

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 75% + CD금리 25%

벤치마크 : KOSPI 75% + CD금리 25%



3. 자산구성 현황

(단위 : 백만원,%)

동화별 구분	투자증권			파생상품		부동산	실물 자산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총 액
	주식	채권	기타	장내	장외			간접투 자증권	특별 자산			
원화	4,960 (84.31)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	782 (13.30)	128 (2.17)	5,870 (99.78)

※ ()내는 자산총액에 대한 비중

II. 상세정보

1. 투자신탁의 개요

설립일	2001-10-22	등록일	2001-10-25		2007-10-21
자산운용회사 (법인이사)	마이다스에셋자산		감독이사	나동민 김완희	박광수
자산보관회사	국민은행		일반사무관리회사	에이브레인(팀스)	
판매회사	현대증권	(주)신한은행	마이다스자산운용	교보증권	
	(단위 : 원, 좌/주)				
투자회사의 특징	자산의 대부분을 주식에 투자하는 주식형펀드입니다. 현물주식을 보유하면서 현재주가보다 더 높은 행사가격의 콜옵션을 매도하는 커버드콜 전략을 지속적으로 사용하여, 주가하락 위험을 부분적으로 헤지하면서 추가수익을 추구합니다.				

2. 자산보유 및 운용현황

- 주식

(단위 : 주, 원,%)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	680	449,480,000	9.06
현대중공업	830	310,005,000	6.25
POSCO	460	254,380,000	5.13
국민은행	2,600	223,600,000	4.51
한화	3,550	210,515,000	4.24
삼성화재	860	176,730,000	3.56
우리금융	7,170	174,231,000	3.51
한국가스공사	2,870	173,922,000	3.51
LG화학	1,870	171,105,000	3.45
신한지주	2,650	170,395,000	3.44
하이닉스	4,220	165,424,000	3.34
동부화재	4,580	164,422,000	3.31
STX조선	3,000	152,700,000	3.08
제일기획	510	149,940,000	3.02
현대건설	1,840	147,200,000	2.97
삼성물산	2,400	145,680,000	2.94
두산인프라코어	4,000	136,400,000	2.75
대한항공	2,000	119,600,000	2.41
LG전자	1,500	117,900,000	2.38
현대차	1,478	115,875,200	2.34
LG필립스LCD	2,500	109,125,000	2.20

(단위 : 주,원,%)

종목	보유수량	평가금액	비중
교보증권	4,500	108,675,000	2.19
한진해운	2,190	107,529,000	2.17
NHN	600	100,380,000	2.02
현대제철	1,560	98,436,000	1.98
SK에너지(분할)	717	96,449,950	1.94
현대모비스	980	96,334,000	1.94
대우건설	3,070	92,253,500	1.86
LG	1,630	86,390,000	1.74
삼성테크윈	1,300	72,540,000	1.46
신세계	100	63,400,000	1.28
LG상사	1,790	61,755,000	1.25
고려아연	290	59,160,000	1.19
SK	292	39,395,050	0.79
케이프	780	38,844,000	0.78
합계	71,367	4,960,170,700	100.00

※ 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

- 채권

(단위 : 원,%)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
해당사항 없음							

※ 채권 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

- 어음 및 채무증서

(단위 : 원,%)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
해당사항 없음							

※ 어음 및 채무증서 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

- 장내파생상품

(단위 : 계약,원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
KOSPI 200 콜옵션 0708 265.0	매도	50	6,100,000	
KOSPI 200 콜옵션 0708 265.0	매도	50	6,100,000	
KOSPI 200 콜옵션 0708 265.0	매도	48	5,856,000	
KOSPI 200 콜옵션 0708 265.0	매도	2	244,000	
합계		150	18,300,000	0

- 장외파생상품

(단위 : 계약,원)

종류	거래상대방	기초자산	매수/매도	만기일	계약금액	취득가격	평가금액	비고
해당사항 없음								

- 부동산(임대)

(단위 : 원)

종류	소재지		취득가격	보증금	비고
	등기번호	취득일	평가금액	임대수입	
해당사항 없음					

- 부동산(자금대여 및 차입)

(단위 : 원,%)

종류	대여(차입)기관	계약일자	대여(차입)금액	대여(차입)금리	만기(상환)일	비고
해당사항 없음						

- 실물자산

(단위 : 원)

종류	취득일자	취득가격	평가금액	비고
해당사항 없음				

- 특별자산

(단위 : 원,%)

종류	취득일자	취득가격	평가액	비고
해당사항 없음				

- 단기대출 및 예금

(단위 : 원,%)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
콜 4일물 4.82	교보증권	2007-07-19	700,277,804	4.82	2007-07-23	
예금	국민은행		82,035,260			
합계			782,313,064			

- 기타

(단위 : 원,%)

종류	평가금액	비고
유가증권매도미수금	126,428,450	
미수배당금	1,260,000	
합계	127,688,450	

- 유가증권 대여 및 차입

(단위 : 원,%)

종목	대여(차입)기관	대여(차입)수량	대여(차입)수수료	대여(차입)일자	만기(상환)일	비고
해당사항 없음						

3. 매매주식총수, 매매금액 및 매매회전율

(단위 : 주, 원,%)

매수		매도		3개월 매매회전율
수량	금액	수량	금액	
12,900	396,579,670	29,513	1,224,808,030	26.52

※ 매매회전율이란 주식매매의 빈번한 정도를 나타내는 지표로서 해당 운용기간동안 매도한 주식가액을 같은 기간동안 평균적으로 보유한 주식가액으로 나누어 산출. 해당 운용기간동안 평균적인 주식투자 규모가 100억원이고, 주식 매도금액 또한 100억원인 경우 매매회전율은 100%(일회전)임.

4. 운용의 개요 및 손익현황

- 운용개요

가 29.38% 가

가

가 , POSCO,

LG , LG, LG , LG, 가

, STX , LG , 가

, NHN, 가

가

가

- 손익현황

(단위 : 백만원.%)

구분	투자증권			파생상품		부동산	실물 자산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익 합계
	주식	채권	기타	장내	장외			간접투자 증권	특별 자산			
당기손익	1,204	0	0	-121	0	0	0	0	0	8	-31	1,060
전기손익	630	0	0	-6	0	0	0	0	0	8	-31	601

- 보수 지급 현황

(단위 : 백만원)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
자산운용회사 보수	10	0.18	10	0.18	
판매회사 보수	18	0.34	18	0.33	
수탁회사 보수	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사 보수	1	0.01	1	0.01	
보수 합계	29	0.54	29	0.54	

※ 투자신탁의 순자산총액 대비 비율

- 총보수, 비용비율

(단위 : %)

구분	전기	당기
총보수, 비용비율	2.89	2.80
매매수수료비율	0.26	0.13

※ 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 투자신탁에서 부담하는 '보수'와 투자신탁재산의 운용과정에서 경상적·반복적으로 발생하는 유가증권 매매수수료 등의 '기타비용'을 순자산총액으로 나눈 비율로서 해당 운용기간중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냄.

5. 운용전문인력 현황

(단위 : 억원, 개)

성명	연령	직위	운용현황		주요 운용경력 및 이력	협회등록번호
			운용중인 다른 간접투자기구 수	다른 운용자산 규모		
허필석	1967년	운용역	12	7,284	KAIST Techno MBA, 장기신용/삼성증권	00-02002-0011
계상현	1974년	운용역	12	2,857	서강대 경영학, KTB	05-02002-0029
이승준	1973년	운용역	3	2,535	Columbia Univ. Financial Math, 신영증권/미래에셋자산운용	06-02002-0034

6. 중개회사별 거래금액/수수료 및 그 비중

주식거래

(단위 : 백만원.%)

구분	5			6			7		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	1,007 (100.00)	1.01 (100.00)	0.00	136 (27.95)	0.14 (27.97)	0.00	126 (100.00)	0.13 (100.00)	0.00
	0 (0.00)	0.00 (0.00)	0.00	351 (72.05)	0.35 (72.03)	0.00	0 (0.00)	0.00 (0.00)	0.00

주식 외 투자증권 거래

(단위 : 백만원.%)

구분	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율

장내파생상품 거래

(단위 : 백만원.%)

구분	5			6			7		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
HFG IB	7 (100.00)	0.02 (100.00)	0.00	7 (100.00)	0.02 (100.00)	0.00	31 (100.00)	0.09 (100.00)	0.00

7. 이해관계인과의 거래에 관한 사항

(단위 : 백만원)

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

8. 의결권 공시대상 법인에 대한 의결권 행사 여부 및 그 내용

회사명	주주 총회일	보유 주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)				불행사사유
				찬성	반대	불행사	중립	
우리투자증권	070525	5,070	제1호의안: 제40기(2006.4.1~2007.3.31) 대차대조표 손익계산서 및 이익잉여금처분계산서(안) 승인의 건	5,070	0	0	0	
우리투자증권	070525	5,070	제2호의안: 이사선임의 건	5,070	0	0	0	
우리투자증권	070525	5,070	제3호의안: 사외이사가 아닌 감사위원 선임의 건	5,070	0	0	0	
우리투자증권	070525	5,070	제4호의안: 사외이사인 감사위원 선임의 건	5,070	0	0	0	
우리투자증권	070525	5,070	제5호의안: 이사보수한도 승인의 건	5,070	0	0	0	
SK	070529	1,100	제1호의안: 분할계획서 승인의 건	1,100	0	0	0	
SK	070529	1,100	제2-1호의안: 사외이사가 아닌 이사 선임	1,100	0	0	0	
SK	070529	1,100	제2-2호의안: 감사위원이 되는 사외이사 선임	1,100	0	0	0	
삼성화재	070531	1,210	제1호의안: 제57기(2006.4.1~2007.3.31) 대차대조표 손익계산서 및 이익잉여금처분계산서(안) 승인의 건	1,210	0	0	0	
삼성화재	070531	1,210	제2호의안: 사내이사인 감사위원회 위원 선임의 건	1,210	0	0	0	
삼성화재	070531	1,210	제3호의안: 이사 보수한도 승인의 건	1,210	0	0	0	
동부화재	070614	5,580	제1호의안: 제40기(2006.4.1~2007.3.31) 대차대조표 손익계산서 및 이익잉여금처분계산서 승인의 건	5,580	0	0	0	
동부화재	070614	5,580	제2호의안: 이사 선임의 건	5,580	0	0	0	
동부화재	070614	5,580	제3호의안: 사외이사인 감사위원 선임의 건	5,580	0	0	0	
동부화재	070614	5,580	제4호의안: 사외이사가 아닌 감사위원 선임의 건	5,580	0	0	0	
동부화재	070614	5,580	제5호의안: 이사 보수한도액 승인의 건	5,580	0	0	0	

9. 분배금 지급내역

분배금 지급일	분배금 지급금액(백만원)	분배후 수탁고(좌수 기준)	기준가격		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
해당사항 없음					

10. 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