

<< 자산운용보고서 >>

- ◆ 투자회사명 : 마이다스절대수익안정형투자회사
- ◆ 투자회사종류 : 혼합채권형(MF)
- ◆ 운용기간 : 2006년 12월 16일 ~ 2007년 03월 15일

1. 투자회사의 개요

설립일	2003-09-16	등록일	2003-09-15	결산일	2007-09-15
자산운용회사 (법인이사)	마이다스에셋자산운용(주)		판매회사	대우증권(주), 한국투자증권(주), 굿모닝신 한증권(주), 현대증권(주), 동부증권(주), 대한투 자증권(주), (주)신한은행, (주)한국씨티은행, 교보 증권(주)	
자산보관회사	(주)하나은행		일반사무관리회사	외환펀드서비스(주)	
감독이사	라동민, 박진국				
투자회사의 특징	안정형펀드로서 투자목적 달성을 위하여 순자산총액의 70%이상을 채권 및 유동성자산에 투자하고 주식에 대한 투 자는 순자산총액의 30% 이내로 한정합니다. 특히 4가지의 투자전략(포트폴리오 헤지전략, 선물시스템트레이딩, 옵션합 성전략, Event Arbitrage)를 복합적으로 사용하여 주가변동방향에 관계없이 안정적인 수익률을 달성하는 것을 목표로 합 니다. 채권은 국공채, 주식관련사채, 신용등급 A-이상인 사채권, 기타 이차지급 유가증권에 주로 투자하며 기업어음(CP)은 신 용등급A3(0)이상인 경우에 투자합니다.				

2. 투자회사의 현황

(단위:백만원)

자산총액	9,610	부채총액	66	
순자산총액	9,544	기준가격	전기말	1,015.72
			당기말	1,019.68

3. 자산구성 현황 및 비율

(단위:백만원,%)

구분	투자증권			단기대출 및 예금	파생상품		부동산	실물 자산	간접투 자증권	특별자 산	기타 자산	자산총액
	주식	채권	기타		장내	장외						
평가액	2,240	5,070	0	2,152	105	0	0	0	0	0	44	9,610
비율	23.31	52.75	0.00	22.40	1.09	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.45	100.00

* 기타자산의 내역 : 배당금, 선납원천세 및 기타미수입금

4. 자산보유 및 운용현황

◆ 주식

(단위: 주, 백만원,%)

종목명	보유수량	취득가액	평가액	평가손익	비율
하이닉스	3,980	155	127	-28	1.32
한진해운	1,500	48	55	7	0.57
현대건설	1,000	51	48	-2	0.50
삼성화재	550	82	87	5	0.90
삼성물산	1,000	30	33	3	0.34
한화	1,000	27	35	8	0.36
LG상사	1,640	35	36	1	0.38
제일모직	1,000	40	37	-3	0.39
SK	500	41	41	0	0.43
현대제철	770	25	27	2	0.28
신세계	100	53	52	-1	0.55
농심	120	31	30	-1	0.31
현대차	1,106	84	76	-8	0.79
POSCO	150	35	58	23	0.61
동부화재	1,800	41	48	7	0.50
삼성전자	570	369	334	-35	3.48
우리투자증권	2,000	42	40	-2	0.41
한미약품	300	35	37	3	0.39
현대중공업	400	48	65	17	0.68

현대모비스	500	38	40	2	0.42
SK텔레콤	400	79	78	-1	0.81
롯데쇼핑	150	48	50	2	0.52
기업은행	2,000	37	37	0	0.38
삼성엔지니어링	282	14	16	2	0.17
제일기획	200	39	45	6	0.47
SBS	890	44	42	-2	0.44
LG필립스LCD	1,860	61	58	-3	0.60
두산인프라코어	3,000	52	59	7	0.61
대우건설	2,300	42	44	2	0.46
LG화학	1,050	45	50	6	0.52
우리금융	2,500	47	56	10	0.59
신한지주	1,400	69	74	6	0.78
국민은행	2,050	152	170	18	1.77
S&T대우	2,000	41	38	-4	0.39
LG전자	588	38	33	-5	0.34
신화인터텍	6,253	35	35	0	0.37
미디어플렉스	3,000	44	47	3	0.49
합계	49,909	2,197	2,240	43	23.31

* 비율은 전체자산 중 당해주식이 차지하는 비율 기재

◆ 채권 (단위:백만원,%)

종목명	액면가액	평가액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비율
통안41-739-2-12	2,000	2,014	2005-10-12	2007-10-12		N/A	20.95
통안43-707-2-28	3,000	3,008	2007-02-28	2009-02-28		N/A	31.30
통안42-24-546-14	50	48	2006-07-14	2008-01-11		N/A	0.50
합계	5,050	5,070					52.75

* 비율은 전체자산 중 당해채권이 차지하는 비율 기재

◆ 어음 (단위:백만원,%)

종목명	액면가액	평가액	발행일	상환일	신용등급	비율
해당없음						

* 비율은 전체자산 중 당해어음이 차지하는 비율 기재

◆ 채무증서 (단위:백만원,%)

종목명	액면가액	평가액	발행일	상환일	신용등급	비율
해당없음						

* 비율은 전체자산 중 당해채무증서(CD)가 차지하는 비율 기재

◆ 단기대출 및 예금 (단위:백만원,%)

구분	금융기관	대출(예금)일자	액면	대출(예금)이자	상환(만기)일	비율
은대	하나은행(통합)		52	0		0.54
콜론	대신증권	2007-03-15	2,100	0	2007-03-16	21.85
합계			2,152	0		22.40

* 비율은 전체자산 중 당해자산이 차지하는 비율 기재

◆ 장내파생상품 (단위: 계약,백만원)

종목명	매수(도) 구분	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
KOSPI200선물0706	매도	23	2,138	0
하나증권	위탁증거금	0	0	105

◆ 장외파생상품 (단위: 계약,백만원)

종목명	매수(도) 구분	계약수	미결제약정금액	비고
해당없음				

◆ 부동산(임대)

(단위:백만원)

종류	소재지	등기번호	취득일	취득가액(보증금)	평가액(임대료)	비고
해당없음						

◆ 부동산(자금대여 및 차입)

(단위:백만원,%)

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

◆ 실물자산

(단위:백만원)

종류	매입일	매입가	평가액	비고
해당없음				
합계		0	0	

◆ 간접투자증권

단위:좌(주),백만원,%)

간접투자지구명	보유수량	취득가액	평가액	평가손익	비율
해당없음					

* 비율은 전체자산 중 당해채권이 차지하는 비율 기재

◆ 기타자산 및 특별자산

(단위:백만원,%)

기타자산			특별자산		
종류	금액	비율	종류	금액	비율
기타미수입금	0	0.00		0	0.00
미수배당금	40	0.42		0	0.00
선납원천세	3	0.03		0	0.00
합계	44	0.45		0	0.00

* 기타자산과 특별자산을 구분하여 기재

◆ 유가증권대여 및 차입

(단위:백만원,%)

구분(종목)	대여(차입)기관	대여(차입)일자	대여수량 (차입금액)	대여수수로 (차입이자)	상환(만기)일	비율
해당없음						

5. 매매주식총수, 매매금액 및 매매회전율

(단위:주,백만원,%)

매수		매도		매매회전율
수량	금액	수량	금액	
237,528	2,875	273,631	2,982	120.7183

* 매매회전율 = 당해 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 당해 운용기간동안 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율
(주식의 보유가액이 0보다 큰 일수만 계산)

6. 운용의 개요 및 손익현황

◆ 운용개요

지난 분기중 펀드의 주식 포트폴리오에서는 대형주중에서는 SK, 국민은행, 한진해운, 삼성화재, 대우건설, 중소형주 중에서는 두산인프라코어, 덕산하이메탈, 호텔신라, 현대DSF, 대우정밀 등의 편입을 확대하였습니다. 편입축소 종목으로는 대형주 중에서는 농심, CJ, 한진중공업, 삼성전기 등이고, 중소형주 중에서는 풍산, 바이로메드, 한진, 청호컴넷 등의 편입을 축소하였습니다. 보유주식포트폴리오가 지수보다 좋은 실적을 올리면서 펀드 수익에 기여하였습니다. 한편 글로벌, EMW안테나, 모뎀, 디오스텍, 유진테크, 모건코리아 등 공모주에도 투자하여 좋은 투자실적을 거두었습니다.

(단위 : 백만원)

구분	평가손익		처분손익		
	전기	당기	전기	당기	
투자증권	주식	61	-18	117	-26
	채권	-6	4	8	2
	기타투자증권	0	0	0	0
장내파생	0	0	-64	-17	
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

* 전기의 기타손익:48

* 당기의 기타손익:88 (수입이자:74, 보수:27)

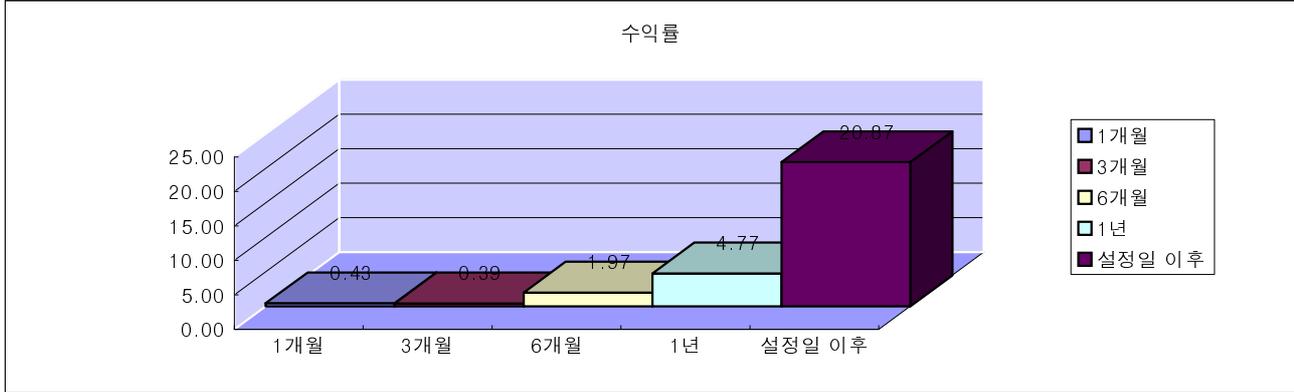
◆ 기간별 운용성과

(단위: %)

	1개월	3개월	6개월	1년	설정일 이후
수익률	0.43	0.39	1.97	4.77	20.87

* 기준일 현재 최근수익률을 기재

* 기간수익률을 그래프로 표시



◆ 보수지급 현황

(단위: 백만원)

구분	전기	당기
운용보수	12	11
판매보수	14	13
수탁보수	1	0
사무관리보수	1	1

◆ 총보수,비용비율

(단위: 연환산%)

구분	전기	당기
총보수,비용비율	1.4822	1.7139

총보수,비용비율(TER : Total Expense Ratio) :

펀드에서 경상적 반복적으로 지출된 각종 보수 및 비용을 순자산의 연평균 잔액으로 나눈 비율

7. 운용전문인력현황

성명	연령	주요경력 및 기간	협회등록번호
허필석	1967년	KAIST 테크노 MBA /CFA, 장기신용은행/삼성증권	00-02002-0011
이승준	1973년	Columbia Univ. Financial Math., 신영증권/미래에셋 자산운용	06-02002-0034
계상현	1974년	서강대 경영학, KTB	05-02002-0029

* 주요근무경력 및 기간란에는 검증가능한 주요운용경력과 기간을 표시

* 공동운용인 경우에는 책임운용전문인력과 일반운용전문인력으로 구분하여 모두 기재

8. 중개회사별 거래금액 수수료 및 그 비중

◆ 주식 거래

(단위: 백만원,%)

구분	06-12-16 ~ 07-01-15				07-01-16 ~ 07-02-15				07-02-16 ~ 07-03-15			
	거래금액	수수료	비중		거래금액	수수료	비중		거래금액	수수료	비중	
			거래금액	수수료			거래금액	수수료			거래금액	수수료
Morgan Stanley Sec	0	0	0.00	0.00	280	1	9.38	23.70	0	0	0.00	0.00
SK증권	122	0	6.50	4.08	397	0	13.32	11.21	265	0	26.64	26.64
교보증권	0	0	0.00	0.00	1,409	1	47.22	39.76	22	0	2.22	2.22
굿모닝신한증권	0	0	0.00	0.00	291	0	9.74	8.20	236	0	23.75	23.75
다이와(DAIWA)증권	410	1	21.87	34.30	0	0	0.00	0.00	0	0	0.00	0.00
대신증권	498	0	26.56	16.66	327	0	10.95	9.22	0	0	0.00	0.00

동양종합금융증권	0	0	0.00	0.00	52	0	1.73	1.46	0	0	0.00	0.00
맥쿼리(ING)증권	333	1	17.71	27.79	0	0	0.00	0.00	0	0	0.00	0.00
미래에셋증권	0	0	0.00	0.00	0	0	0.00	0.00	136	0	13.69	13.69
신영증권	0	0	0.00	0.00	186	0	6.25	5.26	0	0	0.00	0.00
신흥증권	0	0	0.00	0.00	0	0	0.00	0.00	127	0	12.80	12.80
우리투자증권	352	0	18.74	11.76	0	0	0.00	0.00	0	0	0.00	0.00
푸르덴셜투자증권	162	0	8.63	5.42	18	0	0.62	0.52	208	0	20.91	20.91
하나증권	0	0	0.00	0.00	23	0	0.78	0.66	0	0	0.00	0.00

◆ 주식 외 투자증권 거래

(단위: 백만원,%)

구분	06-12-16 ~ 07-01-15				07-01-16 ~ 07-02-15				07-02-16 ~ 07-03-15			
	거래금액	수수료	비중		거래금액	수수료	비중		거래금액	수수료	비중	
			거래금액	수수료			거래금액	수수료			거래금액	수수료
SK증권	0	0	0.00	0.00	0	0	0.00	0.00	3,007	0	26.72	0.00
미래에셋증권	0	0	0.00	0.00	200	0	69.09	0.00	3,145	0	27.96	0.00
부국증권	49	0	55.40	0.00	69	0	24.02	0.00	2,574	0	22.88	0.00
이트레이드증권	40	0	44.60	0.00	20	0	6.89	0.00	2,525	0	22.44	0.00

◆ 장내파생상품 거래

(단위: 백만원,%)

구분	06-12-16 ~ 07-01-15				07-01-16 ~ 07-02-15				07-02-16 ~ 07-03-15			
	거래금액	수수료	비중		거래금액	수수료	비중		거래금액	수수료	비중	
			거래금액	수수료			거래금액	수수료			거래금액	수수료
굿모닝신한증권	1,856	0	34.08	57.33	21,437	3	100.00	100.00	9,182	2	68.79	79.39
하나증권	3,590	0	65.92	42.67	0	0	0.00	0.00	4,166	0	31.21	20.61

9. 이해관계인과의 거래에 관한 사항

(단위: 백만원)

이해관계인		거래의 종류(주)	자산의 종류	거래금액
성명(상호)	관계			
해당없음				

(주) 매매거래, 위탁거래, 중개거래, 임차거래 등

10. 의결권공시대상법인에 대한 의결권행사여부 및 그 내용(의결권을 행사하지 아니한 경우에는 그 사유)

회사명	주주총회일	보유주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)				불행사의 경우 그 사유
				찬성	반대	불행사	중립	
KCC	2007-02-23	100	정관변경	100	0	0	0	
KCC	2007-02-23	100	이사 보수한도액 승인	100	0	0	0	
KCC	2007-02-23	100	재무제표 승인	100	0	0	0	
KCC	2007-02-23	100	감사선임	100	0	0	0	
KCC	2007-02-23	100	이사선임	100	0	0	0	
POSCO	2007-02-23	150	이사보수 한도액승인	150	0	0	0	
POSCO	2007-02-23	150	이사선임	150	0	0	0	
POSCO	2007-02-23	150	재무제표 승인	150	0	0	0	
POSCO	2007-02-23	150	정관변경	150	0	0	0	
CJ	2007-02-28	300	이사 선임	0	300	0	0	
CJ	2007-02-28	300	감사위원회 위원 선임	300	0	0	0	
CJ	2007-02-28	300	이사 보수한도액 승인	0	300	0	0	
CJ	2007-02-28	300	재무제표 승인	300	0	0	0	
LG필립스LCD	2007-02-28	700	재무제표승인	700	0	0	0	
LG필립스LCD	2007-02-28	700	이사선임	700	0	0	0	
LG필립스LCD	2007-02-28	700	감사위원회 위원 선임	700	0	0	0	
LG필립스LCD	2007-02-28	700	이사보수한도액승인	700	0	0	0	
LG필립스LCD	2007-02-28	700	정관변경	700	0	0	0	
삼성전기	2007-02-28	1,000	재무제표 승인	1,000	0	0	0	
삼성전기	2007-02-28	1,000	감사위원회위원이되는 사외이사 선임	1,000	0	0	0	
삼성전기	2007-02-28	1,000	이사 보수한도액 승인	1,000	0	0	0	

삼성전자	2007-02-28	600	이사선임	600	0	0	0	
삼성전자	2007-02-28	600	이사보수한도 승인	600	0	0	0	
삼성전자	2007-02-28	600	2-2. 사내이사 선임	600	0	0	0	
삼성전자	2007-02-28	600	2-1. 사외이사 선임	600	0	0	0	
삼성전자	2007-02-28	600	2-3. 감사위원회 위원 선임	600	0	0	0	
삼성전자	2007-02-28	600	대차대표, 승익 계산서 및 이익 잉여금 처분계산서 승인	600	0	0	0	
제일기획	2007-02-28	200	감사 선임	200	0	0	0	
제일기획	2007-02-28	200	이사 선임	200	0	0	0	
제일기획	2007-02-28	200	재무제표 승인	200	0	0	0	
제일기획	2007-02-28	200	감사 보수한도액 승인	200	0	0	0	
제일기획	2007-02-28	200	이사 보수한도액 승인	200	0	0	0	
바이로메드	2007-03-05	4,000	재무제표 승인	0	0	4,000	0	행사요건 불충족
LG상사	2007-03-07	1,140	정관 변경	1,140	0	0	0	
LG상사	2007-03-07	1,140	이사 보수한도액 승인	1,140	0	0	0	
LG상사	2007-03-07	1,140	재무제표 승인	1,140	0	0	0	
LG상사	2007-03-07	1,140	3-2호:감사위원회 위원이 되는 사외이사 선임	1,140	0	0	0	
LG상사	2007-03-07	1,140	3-1호:이사 선임	1,140	0	0	0	
S&T대우	2007-03-09	2,000	재무제표 승인	2,000	0	0	0	
S&T대우	2007-03-09	2,000	이사 보수한도액 승인	2,000	0	0	0	
S&T대우	2007-03-09	2,000	감사 보수한도액 승인	2,000	0	0	0	
SK텔레콤	2007-03-09	400	3-2호 의안 : 감사위원회 위원이 되는 사외이사 선임의 건	400	0	0	0	
SK텔레콤	2007-03-09	400	3-1호 의안 : 사내이사 선임의 건	400	0	0	0	
SK텔레콤	2007-03-09	400	이사 보수한도액 승인	400	0	0	0	
SK텔레콤	2007-03-09	400	재무제표 승인	400	0	0	0	
롯데쇼핑	2007-03-09	150	재무제표 승인	150	0	0	0	
롯데쇼핑	2007-03-09	150	이사 선임	150	0	0	0	
롯데쇼핑	2007-03-09	150	이사 보수한도액 승인	150	0	0	0	
현대제철	2007-03-09	2,500	이사 보수한도액 승인	2,500	0	0	0	
현대제철	2007-03-09	2,500	재무제표 승인	2,500	0	0	0	
현대제철	2007-03-09	2,500	사외이사인 감사위원 선임	2,500	0	0	0	
현대제철	2007-03-09	2,500	이사 선임	2,500	0	0	0	
현대차	2007-03-09	1,336	이사보수한도액승인	1,336	0	0	0	
현대차	2007-03-09	1,336	감사위원회 위원이 되는 사외이사 선임	1,336	0	0	0	
현대차	2007-03-09	1,336	이사선임	1,336	0	0	0	
현대차	2007-03-09	1,336	정관변경	1,336	0	0	0	
현대차	2007-03-09	1,336	재무제표승인	1,336	0	0	0	
한우티엔씨	2007-03-12	9,382	이사 선임	0	0	9,382	0	행사요건 불충족
한우티엔씨	2007-03-12	9,382	정관 변경	0	0	9,382	0	행사요건 불충족
한우티엔씨	2007-03-12	9,382	재무제표 승인	0	0	9,382	0	행사요건 불충족
한우티엔씨	2007-03-12	9,382	감사 보수한도액 승인	0	0	9,382	0	행사요건 불충족

11. 공지사항

- * 간접투자기구평가회사가 평가한 정보가 있을 경우 이를 기재할 수 있음(공모간접투자기구에 한함)
- * 간접투자기구의 운용 및 투자 등에 관련하여 보다 자세한 사항은 아래의 주소로 문의하거나, 해당 자산운용회사 및 판매회사의 영업점에 비치되고 홈페이지에 기재되어 있는 영업보고서 및 사업보고서를 이용할 수 있습니다.

주소 : 서울시 영등포구 여의도동 23-3

전화번호 : 02-3787-3500

홈페이지 : <http://www.midasasset.com>